

易方达增强回报债券型证券投资基金

2017 年半年度报告摘要

2017 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十九日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达增强回报债券	
基金主代码	110017	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 3 月 19 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,454,213,537.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达增强回报债券 A	易方达增强回报债券 B
下属分级基金的交易代码	110017	110018
报告期末下属分级基金的份额总额	3,447,758,831.74 份	1,006,454,705.53 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于债券品种，力争为基金持有人创造较高的当期收益和总回报，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用类固定收益品种（含可转换债券）、新股（含增发）申购及套利性股票投资之间的配置：1）基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和风险；2）对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析，考察其对固定收益市场信用利差的影响；3）基于新股发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析，预测新股申购的收益率以及风险；4）套利性投资机会的投资期间及预期收益率；5）股票市场走势的预测；6）可转换债券发行公司的成长性和转债价值的判断。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853

2.4 信息披露方式

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
-------------	--------------------------------

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（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）	
	易方达增强回报债券 A	易方达增强回报债券 B
本期已实现收益	73,537,864.55	20,973,921.51
本期利润	131,981,228.44	35,547,669.13
加权平均基金份额本期利润	0.0447	0.0417
本期基金份额净值增长率	3.58%	3.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	易方达增强回报债券 A	易方达增强回报债券 B
期末可供分配基金份额利润	0.0615	0.0514
期末基金资产净值	4,289,630,155.01	1,240,059,883.59
期末基金份额净值	1.244	1.232

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

易方达增强回报债券 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	1.63%	0.11%	0.87%	0.10%	0.76%	0.01%
过去三个月	2.30%	0.10%	-1.04%	0.11%	3.34%	-0.01%
过去六个月	3.58%	0.09%	-2.48%	0.11%	6.06%	-0.02%
过去一年	3.90%	0.11%	-3.81%	0.13%	7.71%	-0.02%
过去三年	46.19%	0.35%	3.18%	0.13%	43.01%	0.22%
自基金合同生效起至今	129.47%	0.30%	6.98%	0.13%	122.49%	0.17%

易方达增强回报债券 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	1.65%	0.11%	0.87%	0.10%	0.78%	0.01%
过去三个月	2.16%	0.10%	-1.04%	0.11%	3.20%	-0.01%
过去六个月	3.35%	0.09%	-2.48%	0.11%	5.83%	-0.02%
过去一年	3.45%	0.11%	-3.81%	0.13%	7.26%	-0.02%
过去三年	44.36%	0.36%	3.18%	0.13%	41.18%	0.23%
自基金合同生效起至今	120.57%	0.30%	6.98%	0.13%	113.59%	0.17%

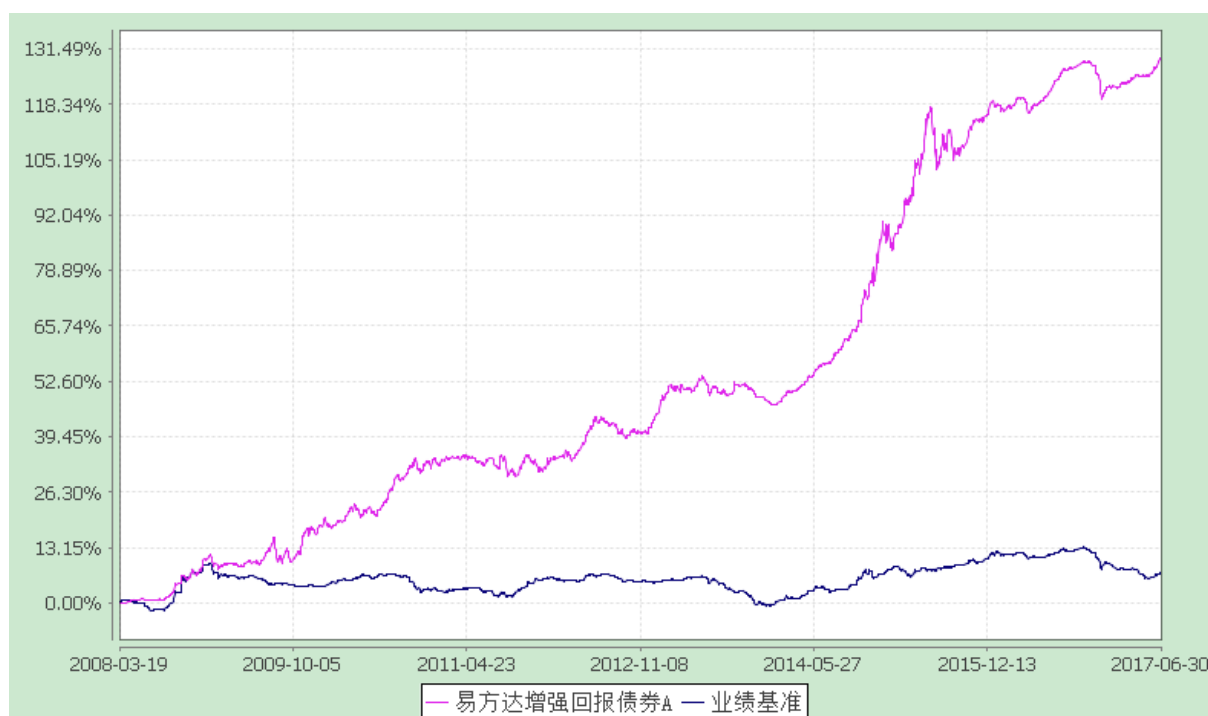
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达增强回报债券型证券投资基金

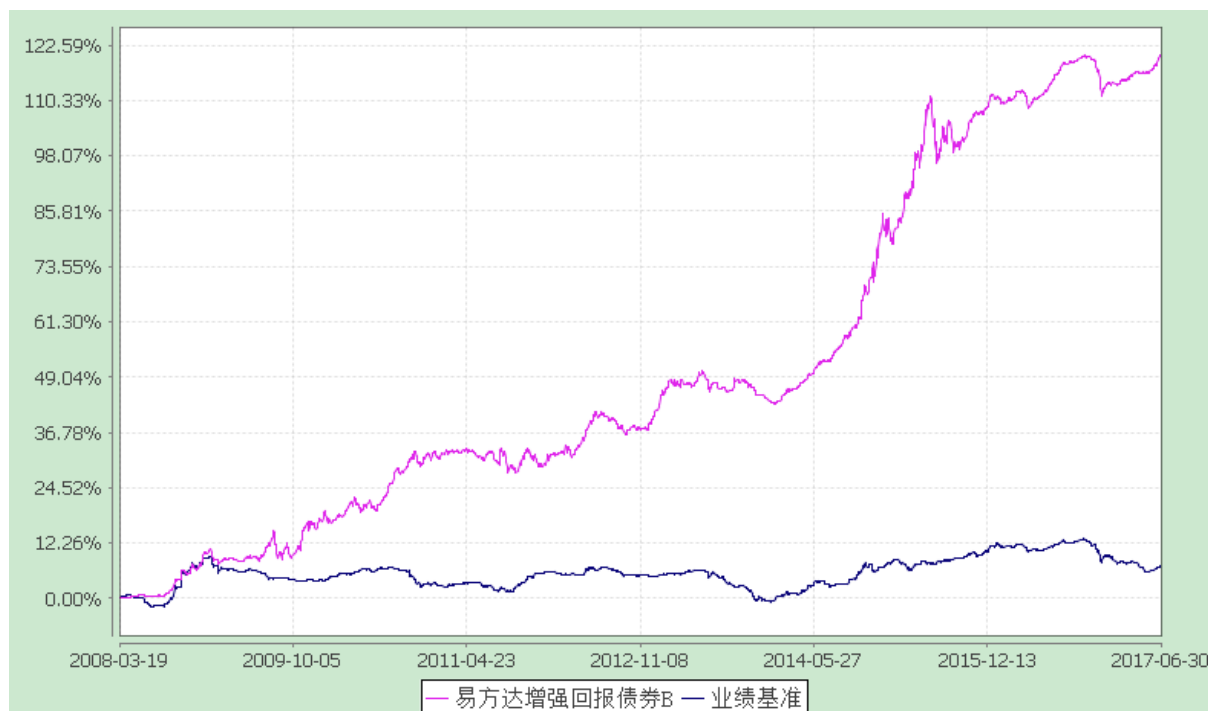
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008年3月19日至2017年6月30日)

易方达增强回报债券 A



易方达增强回报债券 B



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 129.47%，B 类基金份额净值增长率为 120.57%，同期业绩比较基准收益率为 6.98%。

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、大连等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资格。2005 年 8 月，易方达获得企业年金基金投资管理资格。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 2017 年 6 月 30 日，易方达的总资产管理规模达到 11000 亿元，其中公募基金管理规模 4842 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		
王晓晨	本基金的基金经理、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、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达双债增强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、易方达资产管理 (香港) 有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员 (RO)、提供资产管理负责人员 (RO)、易方达资产管理 (香港) 有限公司 RQFII / QFII 产品投资决策委员会成员、固定收益基金投资部副总经理	2011-08-15	-	14 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管、固定收益总部总经理助理、易方达货币市场基金基金经理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理。
张雅君	本基金的基金经理、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达富惠纯债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、易方达保本一号混合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、易方达安心回馈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、易方达安心回报债券型证券投资基	2014-07-19	-	8 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、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理助理。

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				
----------------------------------	--	--	--	--

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。

3.本基金基金经理张雅君因休产假超过 30 日，在其休假期间，本基金由同为基金经理的王晓晨继续进行管理。该事项已于 2017 年 2 月 8 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

4.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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后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 14 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；2 次为不同基金经理管理的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

2017 年一季度债券市场整体下跌。基本面方面，经济延续回升态势。基建投资快速扩张，房地产和制造业投资稳中有升。受总需求平稳以及企业补库存影响，工业生产持续向好。政策方面，

在抑制资产泡沫和防范金融风险背景下，央行继续实施稳健中性的货币政策，两次上调公开市场操作利率，并在一季度末对银行体系实施宏观审慎评估体系考核。资金面方面，一季度资金面多数时间呈现紧平衡状态，资金利率中枢上升，月末季末等关键时点资金价格波动较大。一季度基本面、政策面和资金面对债券市场均较为不利，导致债券市场收益率大幅上升。

2017 年二季度债券市场继续大幅波动。首先是 4 月公布的 3 月经济数据大幅好于市场预期，同时银行监管集中发文，大行委外资金赎回预期加剧，资金面也由于缴税因素从月初的短暂宽松恢复紧张局面，导致收益率快速上行。5 月债市在监管趋严背景下延续调整，收益率曲线大幅平坦化，信用债利差也逐步扩大。进入 6 月，监管协调不断加强，货币政策也有所缓和，央行通过公开市场提前投放流动性大幅缓解了市场对季末资金面的担忧，银行同业存单的发行利率也从高位开始快速回落。同时，5 月的经济数据有所回落，市场对于经济复苏的前景出现分歧。在多重因素叠加作用下，无风险利率高位回落，信用债收益率也快速下行，信用利差有所收窄。

2017 年上半年股市分化明显。受经济回暖、企业盈利改善影响，周期板块和盈利能力较强、估值较低的蓝筹板块表现相对较好，中小市值成长板块表现较弱。上半年上证综指整体上涨 2.86%，代表大盘风格的上证 50 指数上涨 11.5%，而创业板指数则下跌 7.34%。这种分化在二季度显得尤为明显。

上半年本基金认为债券市场缺乏趋势性机会，债券部分整体以稳健操作为主，维持较低的杠杆和较短的久期，信用评级整体提高，保持了组合较高的流动性，债券部分获得较好的正收益。可转债部分，本基金在 6 月增加可转债和可交换债持仓，获得较好正收益。另外本基金持仓的定增获配股票以及转债转股的股票仓位在上半年表现良好，贡献了基金收益的最大部分。

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 1.244 元，本报告期份额净值增长率为 3.58%；B 类基金份额净值为 1.232 元，本报告期份额净值增长率为 3.35%；同期业绩比较基准收益率为 2.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年金融监管协调预计将有所加强，货币政策由偏紧转为中性，分析融资供需的变化对于利率的影响尤为重要。融资需求和经济增长密切相关，当前经济增长的主要动力是基建和地产投资，这也是融资的主要需求方。融资供给取决于银行的资金融出意愿。2017 年上半年银行体系在监管和高负债成本的双重压力下出现了比较明显的融资供给收缩，这是推升广谱利率的核心原因。融资供需是相互作用的，融资供给的收缩在推升利率后，会反过来抑制融资需求，带来经济的下滑和融资需求的内生萎缩，这会导致融资量萎缩和利率下滑的组合出现。目前融资需求相对平稳，融资需

求大幅萎缩的条件是基建投资和地产投资的大幅回落，短期看，前面两项投资的显著回落需要较长时间的验证。从融资供给角度看，在监管协调加强的大背景下，融资供给的收缩速度可能已经在放缓，但银行体系高负债成本的现况还没有得到实质缓解，短端利率水平高位运行的态势在短期内仍难以看到逆转迹象，债券市场较难看到趋势性机会。后续我们将密切关注融资供需格局的变化及时调整投资策略。

权益方面，同样受制于融资供需和资金面的影响，我们判断股票市场难以摆脱存量博弈的特征，较难走出趋势性行情，板块分化可能仍是未来股票市场的主要特征。

考虑到债券市场期限利差和信用利差均处于历史较低水平，短期经济运行仍然平稳，资金面仍有波动，货币政策放松的空间有限，本基金债券部分将继续进行稳健操作，持仓以中短久期高等级信用债为主，并密切跟踪融资供需的变化，等待经济、政策信号明确后可能出现的长久期债券做多机会。权益部分，由于不能在二级市场买卖股票，本基金重点关注定增以及可转债和可交换债券的机会，控制好权益类资产的整体仓位，目标是在承受一定波动的情况下获得超过债券的投资回报，本基金将坚持稳健投资的原则，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，公司常务副总裁担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、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

易方达增强回报债券 A：本报告期内实施的利润分配金额为 28,538,782.07 元。

易方达增强回报债券 B：本报告期内实施的利润分配金额为 10,201,571.24 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额：易方达增强回报债券 A 为 28,538,782.07 元，易方达增强回报债券 B 为 10,201,571.24 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

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：易方达增强回报债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	73,758,990.44	66,419,322.63
结算备付金	25,004.48	40,162,985.27
存出保证金	104,786.87	18,449.15
交易性金融资产	5,548,183,109.75	5,231,396,753.01
其中：股票投资	654,150,597.70	455,926,585.88
基金投资	-	-
债券投资	4,884,032,512.05	4,753,984,777.00
资产支持证券投资	10,000,000.00	21,485,390.13
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-

买入返售金融资产	-	684,547,626.82
应收证券清算款	-	83,347,481.17
应收利息	75,565,052.25	115,449,157.12
应收股利	-	-
应收申购款	17,059,173.68	6,801,170.33
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,714,696,117.47	6,228,142,945.50
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
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	80,000,000.00	989,002,704.49
应付证券清算款	59,562,203.25	45,030,472.42
应付赎回款	35,567,649.83	15,506,141.31
应付管理人报酬	2,755,333.38	2,866,928.58
应付托管费	847,794.90	882,131.88
应付销售服务费	352,903.35	414,383.31
应付交易费用	93,212.80	107,512.05
应交税费	5,402,367.10	5,402,367.10
应付利息	-52,477.00	548,243.62
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	477,091.26	662,697.30
负债合计	185,006,078.87	1,060,423,582.06
所有者权益：		
实收基金	4,454,213,537.27	4,276,397,243.79
未分配利润	1,075,476,501.33	891,322,119.65
所有者权益合计	5,529,690,038.60	5,167,719,363.44
负债和所有者权益总计	5,714,696,117.47	6,228,142,945.50

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.244 元，B 类基金份额净值 1.232 元；基金份额总额 4,454,213,537.27 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 3,447,758,831.74 份，B 类基金份额总额 1,006,454,705.53 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达增强回报债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至
----	-----------------------	----------------------------

	2017 年 6 月 30 日	2016 年 6 月 30 日
一、收入	191,140,448.74	85,306,033.76
1.利息收入	109,259,856.16	249,872,833.42
其中：存款利息收入	979,512.01	1,712,620.34
债券利息收入	104,445,783.66	246,547,090.63
资产支持证券利息收入	441,197.19	885,576.33
买入返售金融资产收入	3,393,363.30	727,546.12
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	8,617,891.92	-737,383.44
其中：股票投资收益	-2,814,830.99	1,411,583.19
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,850,319.50	-4,472,191.56
资产支持证券投资收益	674,440.27	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,907,963.14	2,323,224.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	73,017,111.51	-165,080,451.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	245,589.15	1,251,035.04
减：二、费用	23,611,551.17	67,759,054.87
1. 管理人报酬	14,873,432.63	27,373,457.04
2. 托管费	4,576,440.93	8,422,602.17
3. 销售服务费	2,044,086.83	6,748,793.07
4. 交易费用	347,032.67	234,474.14
5. 利息支出	1,511,992.49	24,708,803.89
其中：卖出回购金融资产支出	1,511,992.49	24,708,803.89
6. 其他费用	258,565.62	270,924.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	167,528,897.57	17,546,978.89
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	167,528,897.57	17,546,978.89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达增强回报债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,276,397,243.79	891,322,119.65	5,167,719,363.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	167,528,897.57	167,528,897.57

润)			
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)	177,816,293.48	55,365,837.42	233,182,130.90
其中: 1.基金申购款	2,373,751,748.47	518,286,474.83	2,892,038,223.30
2.基金赎回款	-2,195,935,454.99	-462,920,637.41	-2,658,856,092.40
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)	-	-38,740,353.31	-38,740,353.31
五、期末所有者权益(基金净值)	4,454,213,537.27	1,075,476,501.33	5,529,690,038.60
项目	上年度可比期间 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)	6,573,841,688.73	2,508,783,285.48	9,082,624,974.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,546,978.89	17,546,978.89
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)	-1,677,888,165.51	-290,718,253.71	-1,968,606,419.22
其中: 1.基金申购款	7,325,453,134.04	2,022,825,987.65	9,348,279,121.69
2.基金赎回款	-9,003,341,299.55	-2,313,544,241.36	-11,316,885,540.91
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)	-	-909,745,607.90	-909,745,607.90
五、期末所有者权益(基金净值)	4,895,953,523.22	1,325,866,402.76	6,221,819,925.98

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

易方达增强回报债券型证券投资基金(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[2008]226号《关于核准易方达增强回报债券型证券投资基金募集的批复》批准，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《易方达增强回报债券型证券投资基金基金合同》向社会公开募集。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2008 年

3 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,997,182,080.86 份基金份额，其中认购资金利息折合 262,294.55 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《易方达增强回报债券型证券投资基金基金合同》和《易方达增强回报债券型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据认购/申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认/申购费用、在赎回时收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用、赎回费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 B 类基金份额。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 B 类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类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类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》、《易方达增强回报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[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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日

	成交金额	占当期股票成交总额的比 例	成交金额	占当期股票成交总 额的比例
广发证券	42,756,822.19	32.64%	-	-

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	34,205.26	32.64%	34,205.26	74.33%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,873,432.63	27,373,457.04
其中：支付销售机构的客户维护费	1,250,562.42	1,308,628.23

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.65% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.65\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,576,440.93	8,422,602.17

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.2.3 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		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达增强回报债券 A	易方达增强回报债券 B	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,036,711.94	1,036,711.94
中国建设银行	-	121,797.10	121,797.10
广发证券	-	3,755.67	3,755.67
合计	-	1,162,264.71	1,162,264.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	易方达增强回报债券 A	易方达增强回报债券 B	合计
易方达基金管理有限公司	-	5,680,742.21	5,680,742.21
中国建设银行	-	182,954.75	182,954.75
广发证券	-	5,773.02	5,773.02
合计	-	5,869,469.98	5,869,469.98

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日 B 类基金资产净值的 0.4% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% / \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 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；由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出。

6.4.8.3 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 2017年1月1日至2017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
中国建设银行	131,066,886.85	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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
中国建设银行	107,245,091.78	-	-	-	3,540,000,000.00	318,682.33

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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

易方达增强回报债券 A

无。

易方达增强回报债券 B

无。

6.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
	中国建设银行-活期存款	73,758,990.44	136,131.74	79,792,509.96

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 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 2017年1月1日至2017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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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	136130	16 葛洲 01	分销	3,000,000	300,000,000.00
广发证券	1680058	16 盐都债	分销	200,000	20,000,000.00

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
002572	索菲亚	2016-07-28	2017-08-01	非公开发行流通受限	53.05	39.73	4,410,932	116,999,971.30	175,246,328.36	-
002583	海能达	2016-08-19	2017-08-23	非公开发行流通受限	11.10	15.31	8,108,109	90,000,009.90	124,135,148.79	-
601012	隆基股份	2016-09-12	2017-09-11	非公开发行流	14.20	16.49	492,957	6,999,989.40	8,128,860.93	-

				通受限						
601111	中国国航	2017-03-13	2018-03-12	非公开发行流通受限	7.79	8.39	12,836,970	99,999,996.30	107,702,178.30	-

注：1) 索菲亚家居股份有限公司于 2017 年 4 月 24 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 7 元人民币现金（含税），同时按每 10 股转增 10 股进行资本公积金转增股本；

2) 海能达通信股份有限公司于 2017 年 5 月 25 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 0.35 元人民币现金（含税）；

3) 隆基绿能科技股份有限公司于 2017 年 5 月 15 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 1 元人民币现金（含税）；

4) 以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

6.4.9.2 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
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项停牌	6.46	-	-	1,300,000	7,574,831.96	8,398,000.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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为 0，无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 80,000,000.00 元，于 2017 年 7 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。

6.4.10 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 2017 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 548,917,453.67 元，属于第二层次的余额为 4,999,265,656.08 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 242,193,887.33 元，第二层次 4,989,202,865.68 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 2017 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(2016 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	654,150,597.70	11.45
	其中：股票	654,150,597.70	11.45
2	固定收益投资	4,894,032,512.05	85.64
	其中：债券	4,884,032,512.05	85.46
	资产支持证券	10,000,000.00	0.17
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	73,783,994.92	1.29
7	其他各项资产	92,729,012.80	1.62
8	合计	5,714,696,117.47	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	322,948,728.08	5.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,640,000.00	0.36
E	建筑业	5,050,000.00	0.09
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	204,993,819.42	3.71
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	101,518,050.20	1.84
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	-	-
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	654,150,597.70	11.83

7.3 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

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	002572	索菲亚	4,410,932	175,246,328.36	3.17
2	002583	海能达	8,108,109	124,135,148.79	2.24
3	601111	中国国航	12,836,970	107,702,178.30	1.95
4	600004	白云机场	3,444,107	63,578,215.22	1.15
5	601336	新华保险	1,058,143	54,388,550.20	0.98
6	601318	中国平安	950,000	47,129,500.00	0.85
7	000089	深圳机场	3,605,714	33,713,425.90	0.61
8	600674	川投能源	2,000,000	19,640,000.00	0.36
9	601989	中国重工	1,300,000	8,398,000.00	0.15
10	601012	隆基股份	492,957	8,128,860.93	0.15

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.efunds.com.cn 网站的半年度报告正文。

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	601111	中国国航	99,999,996.30	1.94
2	600004	白云机场	57,567,579.97	1.11
3	601336	新华保险	55,108,087.44	1.07
4	603113	金能科技	13,370.00	0.00
5	601952	苏垦农发	9,320.00	0.00
6	601881	中国银河	6,810.00	0.00
7	002774	快意电梯	3,050.00	0.00

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	002318	久立特材	44,132,873.49	0.85
2	601318	中国平安	37,706,692.09	0.73
3	300115	长盈精密	16,034,626.35	0.31
4	300137	先河环保	11,189,580.00	0.22
5	600037	歌华有线	7,617,081.00	0.15
6	600820	隧道股份	5,492,486.00	0.11
7	601989	中国重工	5,175,000.00	0.10
8	002666	德联集团	2,185,972.55	0.04
9	300177	中海达	1,346,294.40	0.03
10	603708	家家悦	25,570.00	0.00
11	603067	振华股份	22,470.00	0.00
12	600977	中国电影	19,910.00	0.00
13	002819	东方中科	17,275.00	0.00
14	601881	中国银河	12,680.00	0.00
15	600936	广西广电	10,951.00	0.00
16	002774	快意电梯	9,235.00	0.00

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	212,708,213.71
卖出股票收入（成交）总额	130,998,696.88

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	989,932,000.00	17.90

	其中：政策性金融债	989,932,000.00	17.90
4	企业债券	1,170,758,453.70	21.17
5	企业短期融资券	1,217,600,000.00	22.02
6	中期票据	1,136,765,000.00	20.56
7	可转债（可交换债）	368,977,058.35	6.67
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,884,032,512.05	88.32

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	110032	三一转债	2,010,830	238,886,604.00	4.32
2	150207	15 国开 07	2,100,000	210,525,000.00	3.81
3	130406	13 农发 06	1,800,000	179,838,000.00	3.25
4	1182359	11 中远 MTN1	1,500,000	152,535,000.00	2.76
5	011760076	17 国药控股 SCP001	1,500,000	150,210,000.00	2.72

7.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	119027	侨城 05	100,000	10,000,000.00	0.18

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	104,786.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	75,565,052.25
5	应收申购款	17,059,173.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,729,012.80

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	238,886,604.00	4.32
2	132001	14 宝钢 EB	50,599,686.00	0.92
3	110030	格力转债	9,085,600.00	0.16
4	110034	九州转债	6,327,500.00	0.11
5	128011	汽模转债	1,875,805.40	0.03
6	127003	海印转债	630,331.65	0.01
7	113010	江南转债	317,315.20	0.01

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	002572	索菲亚	175,246,328.36	3.17	非公开发行

					流通受限
2	002583	海能达	124,135,148.79	2.24	非公开发行 流通受限
3	601111	中国国航	107,702,178.30	1.95	非公开发行 流通受限
4	601989	中国重工	8,398,000.00	0.15	重大事项停 牌
5	601012	隆基股份	8,128,860.93	0.15	非公开发行 流通受限

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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达增强回报债券 A	49,775	69,266.88	2,456,769,005.58	71.26%	990,989,826.16	28.74%
易方达增强回报债券 B	47,839	21,038.37	548,431,958.91	54.49%	458,022,746.62	45.51%
合计	97,614	45,630.89	3,005,200,964.49	67.47%	1,449,012,572.78	32.53%

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	易方达增强回报债券 A	17,527.89	0.0005%
	易方达增强回报债券 B	11,220.39	0.0011%
	合计	28,748.28	0.0006%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	易方达增强回报债券 A	0
	易方达增强回报债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达增强回报债券 A	0
	易方达增强回报债券 B	0

	合计	0
--	----	---

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达增强回报债券 A	易方达增强回报债券 B
基金合同生效日（2008 年 3 月 19 日）基金份额总额	2,376,350,929.38	620,831,151.48
本报告期期初基金份额总额	3,019,601,968.90	1,256,795,274.89
本报告期基金总申购份额	1,351,201,191.02	1,022,550,557.45
减：本报告期基金总赎回份额	923,044,328.18	1,272,891,126.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,447,758,831.74	1,006,454,705.53

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 2017 年 3 月 10 日发布公告，自 2017 年 3 月 10 日起聘任关秀霞女士担任公司首席国际业务官（副总经理级）；于 2017 年 4 月 19 日发布公告，自 2017 年 4 月 19 日起聘任高松凡先生担任公司首席养老金业务官（副总经理级）。

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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	12,680.00	0.01%	10.14	0.01%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	2,948,570.25	2.25%	2,358.90	2.25%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	14,749,645.00	11.26%	11,799.74	11.26%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	14,460,819.35	11.04%	11,568.58	11.04%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	56,070,160.09	42.80%	44,856.13	42.80%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	42,756,822.19	32.64%	34,205.26	32.64%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增长江证券股份有限公司一个交易单元。

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

的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	24,541,211.34	2.27%	-	-	-	-
中信建投	565,943,410.84	52.27%	1,433,000,000.00	19.78%	-	-
国信证券	444,791,760.55	41.08%	720,000,000.00	9.94%	-	-
天风证券	15,394,825.25	1.42%	2,335,000,000.00	32.24%	-	-
东吴证券	-	-	117,000,000.00	1.62%	-	-
安信证券	17,681,447.62	1.63%	272,500,000.00	3.76%	-	-
长江证券	-	-	164,402,000.00	2.27%	-	-
兴业证券	-	-	9,000,000.00	0.12%	-	-
国金证券	2,039,310.08	0.19%	20,000,000.00	0.28%	-	-
中银国际	-	-	250,000,000.00	3.45%	-	-
海通证券	10,989,787.65	1.02%	1,606,000,000.00	22.17%	-	-
广州证券	1,272,957.51	0.12%	20,020,000.00	0.28%	-	-
长城证券	-	-	296,000,000.00	4.09%	-	-

			00.00			
--	--	--	-------	--	--	--

易方达基金管理有限公司

二〇一七年八月二十九日