易方达岁丰添利债券型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011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:二〇一一年八月二十六日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月22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2011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	易方达岁丰添利债券
基金主代码	161115
交易代码	161115
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在深圳证券交易所上市交易。封闭期结束后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2010年11月9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	2,679,114,943.70份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年12月3日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过主要投资债券品种,力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益,实现基金资产的长期增值。
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)基于对宏观经济、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) 基于可转换债券发行公司的基本面,债券利率水平、票息率及派息频率、信用风险等固定收益因素,以及期权定价模型,对可转换债券进行定价分析并制定相关投资策略;4)基于对新股(含增发股)发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析,预测新股(含增发股)申购的收益率以及风险。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,理论上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	唐州徽
	联系电话	020-38799008	010-66594855
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38799488	010-66594942

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	广州市体育西路189号城建大厦28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(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	39,826,812.38
本期利润	20,857,919.39
加权平均基金份额本期利润	0.0078
本期基金份额净值增长率	0.79%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2011年6月30日)**
期末可供分配基金份额利润	0.0030
期末基金资产净值	2,687,043,520.64
期末基金份额净值	1.003

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。

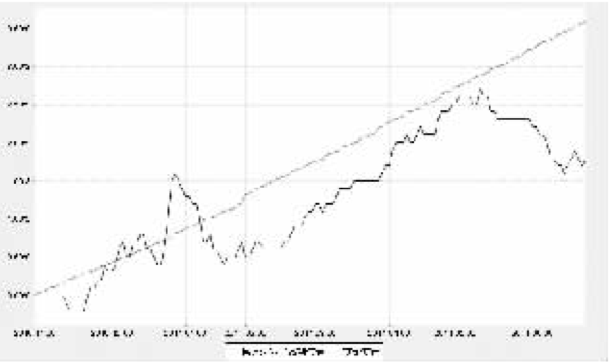
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.50%	0.08%	0.49%	0.02%	-0.99%	0.06%
过去三个月	0.29%	0.09%	1.48%	0.02%	-1.19%	0.07%
过去六个月	0.79%	0.10%	2.85%	0.02%	-2.06%	0.08%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.80%	0.10%	3.59%	0.02%	-1.79%	0.08%

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

易方达岁丰添利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
(2010年11月9日至2011年6月30日)



注:1.本基金合同于2010 年11 月9 日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1)固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%,其中,信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的40%;

(2)权益类资产的比例不高于基金资产的20%;

(3)持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;

(5)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(6)进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(7)本基金不能在二级市场主动投资权证但可以通过一级市场申购可分离债等方式持有权证,本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%, 本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%,法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;

(8)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(9)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的10%;

(10)基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(11)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(12)本基金只投资于信用级别评级为BBB 以上(含BBB)的资产支持证券,基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3 个月内予以全部卖出;

(13)本基金只投资于投资级别的信用债券,基金持有信用债券期间,如果其信用等级下降至投资级别以下,应在评级报告发布之日起30个交易日内予以全部卖出。其中,本基金所指投资级别是指具有由国内评级机构出具的BBB级及以上级(若为短期融资券,则为A-3级及以上级)信用评级的信用债券;

(14)本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

(15)法律法规和基金合同规定的其他投资比例限制。

若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应 程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在十个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。

3.本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

4.本基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值增长率为1.80%,同期业绩比较基准收益率为3.59%。

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。截至2011年6月30日,公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、盈峰投资控股集团有限公司、广东省广晟资产经营有限公司和广州市广永国有资产经营有限公司。公司现有全国社保基金投资管理人、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务资格。

自成立以来,易方达基金管理有限公司秉承"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的增长"的经营理念,努力以规范的运作、良好的业绩和优质的服务,为投资者创造最佳的回报。

截至2011年6月30日,易方达基金管理有限公司共管理1只封闭式基金、26只开放式基金,具体包括基金科瑞和易方达科讯股票型基金、易方达科汇灵活配置混合型基金、易方达科翔股票型基金、易方达平稳增长基金、易方达策略成长基金、易方达50指数基金、易方达积极成长基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型基金、易方达深证100交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型基金、易方达策略成长二号混合型基金、易方达价值成长混合型基金、易方达增强回报债券型基金、易方达中小盘股票型基金、易方达行业领先企业股票型基金、易方达沪深300指数基金、易方达深证100交易型开放式指数基金联接基金、易方达亚洲精选股票型基金、易方达上证中盘交易型开放式指数基金、易方达上证中盘交易型开放式指数基金联接基金、易方达消费行业股票型基金、易方达岁丰添利债券型基金、易方达医疗保健行业股票型基金、易方达黄金主题基金(LOF)、易方达安心回报债券型基金。同时,公司还管理着多个全国社保基金、企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

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		
钟鸣远	本基金的基金经理、易方达增强回报债券型基金的基金经理、易方达安心回报债券型基金的基金经理、固定收益部总经理	2010-11-09	-	11年	硕士研究生,曾任国家开发银行深圳分行资金计划部职员,联合证券有限责任公司固定收益部投资经理,泰康人寿保险股份有限公司固定收益部研究员,新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理,易方达基金管理有限公司固定收益部经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理。

注:1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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,通过投资交易系统中的公平交易模块,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 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

无。

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。

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

2011年上半年国内债券市场震荡下跌。物价水平屡创高位,居民通胀预期居高难下,央行坚定不移实行适度"从紧"的货币政策,2次上调基准存贷款利率,连续6个月上调法定存款准备金率,大型银行的存款准备金率已达到21.5%的历史最高水平,商业银行资金面出现多年未见的紧张局面,中短期回购利率在春节前和半年末均超过8.0%甚至达到10%以上的历史罕见高位,利率产品和信用产品都出现了明显调整。总体来看,上半年债券市场上短端收益率比长端收益率调整幅度更大,收益率曲线呈现典型的平坦化特征。

从影响债市的基本面因素看,上半年宏观数据显示实体经济的增速已逐步放缓,但通胀水平在新涨价因素的带动下持续走高。经济增速下行与通胀水平上行交织的"滞涨"特征,在今年更趋明显。为控制通胀预期,央行连番动用上调存款准备金率、加息、发行3年央票、动态和差别准备金率等各种紧缩手段,货币信贷增速在央行的严厉调控下大幅下降,货币市场利率明显走高并持续高位,对国内债券市场构成沉重的打击。管理层大力提升直接融资比例的政策导向,也显著增加了债市的供应。今年上半年国内债券基金面临艰难的投资环境,债券基金以往通过缩短组合久期、投资高票息信用债抵御利率风险的传统避险策略,效果难以令人满意。新股的快速发行,进一步挤压了以往一级市场上的高估值泡沫,盲目的新股申购让债券基金承担了较大风险。最后,债券基金以往超额收益来源之一的可转债市场,也跟随权益市场大幅调整而对债基的惨淡表现雪上加霜。

本报告期内,本基金准确把握宏观经济形势变化,保持较低债券仓位和偏短组合久期,配置品种以中短期央行票据和5年内信用债为主;基于通胀压力短期内难以消除、政策紧缩将维持较长时期、权益类产品难寻较大系统性机会的判断,本基金基本回避新股申购,严格控制可转债投资比例,较好回避了上半年债券市场和权益类市场的调整行情。自6月下旬开始,考虑到央行本轮加息周期已经进入下半场,本基金适当回补了债券仓位并提升组合久期,实现较好投资回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末, 本基金份额净值为1.003 元, 本报告期份额净值增长率为0.79% , 同期业绩比较基准收益率为2.85% 。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

持续高企的通胀环境在推动国内债券市场大幅调整的同时,也提升了债券市场的投资价值,市场收益率尤其是信用债市场收益率水平的一再上升,为债券基金创造了良好的中长期配置机会。展望未来,货币政策虽近期仍继续从紧但已面临过度调控的担忧和压力,预计下半年随着国内通胀水平高点的确认,央行货币政策也将进入一个相对稳定的观察期,债券市场可望摆脱目前的震荡局面,走出阶段性的上涨行情。此外,上半年持续的股票市场调整也修正了去年以来A股尤其是新股普遍的高估值状况,这都给岁丰添利债券基金创造更好投资收益提供了机会。

但值得注意的是,虽然当前中高等级的信用债绝对收益率已接近历史高位,中长期投资回报具有较好的安全保护,但中低等级的信用债也面临着不容忽视的信用风险和流动性风险。近期部分地区地方融资平台出现的还本付息压力导致城投债信用风险溢价水平的上升,可能逐步向其他低等级信用债蔓延,后续信用债收益率水平将出现明显分化。作为债市投资者,需要高度警惕其信用风险以及与之密切相关的流动性风险。不过总体来说,虽然信用债面临一定的不利因素,但无论从绝对收益率还是信用利差水平看,无论是短融还是中票都已接近历史最高水平,对未来升息及流动性紧张的预期反映相对充分,具备较强的安全边际。

易方达岁丰添利基金下一阶段的操作将采取谨慎稳妥的投资策略,灵活调整组合久期,努力把握国债、金融债、央行票据等高信用等级债券,企业债、公司债等高收益信用产品,以及可转换债券在不同市场环境下的阶段性机会,力争以理想的投资业绩回报基金持有人。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,公司营运总监担任估值委员会主席,研究部、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签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 40,186,721.41 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")在对易方达岁丰添利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:易方达岁丰添利债券型证券投资基金
报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产:		
银行存款	10,469,308.03	22,808,096.30
结算备付金	4,568,331.78	991,805.13
存出保证金	159,381.70	-
交易性金融资产	3,302,094,337.85	2,595,048,487.38
其中:股票投资	45,824,105.98	30,641,060.00
基金投资	-	-
债券投资	3,256,270,231.87	2,564,407,427.38
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	98,000,267.00
应收证券清算款	22,980,616.74	60,787,698.96
应收利息	44,089,718.53	17,814,511.31
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,384,361,694.63	2,795,450,866.08
负债和所有者权益	**本期末 2011年6月30日**	**上年度末 2010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	694,027,059.87	16,000,000.00
应付证券清算款	-	70,993,188.71
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,549,326.47	1,600,137.90
应付托管费	442,664.70	457,182.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	42,782.15	15,901.35
应交税费	308,271.20	-
应付利息	719,960.73	12,133.20
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	228,108.87	-
负债合计	697,318,173.99	89,078,543.42
所有者权益:		
实收基金	2,679,114,943.70	2,679,114,943.70
未分配利润	7,928,576.94	27,257,378.96
所有者权益合计	2,687,043,520.64	2,706,372,322.66
负债和所有者权益总计	3,384,361,694.63	2,795,450,866.08

注:1.本基金合同生效日为2010年11月9日,截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.003元,基金份额总额2,679,114,943.70份。

6.2 利润表

会计主体:易方达岁丰添利债券型证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入	43,281,712.15
1.利息收入	52,070,669.41
其中:存款利息收入	233,384.44
债券利息收入	51,603,290.39
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	233,994.58
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	10,179,905.14
其中:股票投资收益	-206,737.51
基金投资收益	-
债券投资收益	9,484,475.63
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	902,167.02
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-18,968,892.99
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	30.59
减:二、费用	22,423,792.76
1.管理人报酬	9,363,923.73
2.托管费	2,675,406.78
3.销售服务费	-
4.交易费用	80,016.09
5.利息支出	9,928,058.99
其中:卖出回购金融资产支出	9,928,058.99
6.其他费用	376,387.17
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	20,857,919.39
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	20,857,919.39

注:本基金合同生效日为2010年11月9日,截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达岁丰添利债券型证券投资基金
本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	2,679,114,943.70	27,257,378.96	2,706,372,322.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,857,919.39	20,857,919.39
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-40,186,721.41	-40,186,721.41
五、期末所有者权益(基金净值)	2,679,114,943.70	7,928,576.94	2,687,043,520.64

注:本基金合同生效日为2010年11月9日,截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:梁棠,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

易方达岁丰添利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[2010]第1358号《关于核准易方达岁丰添利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《易方达岁丰添利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,《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》于2010年11月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,679,114,943.70份基金份额,其中认购资金利息折合328,024.37份基金份额。本基金为契约型基金,基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期,封闭期结束后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会2010年2月8日颁布的《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>》、《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制。

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2011年6月30日的财务状况以及2011年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)封闭期内,基金收益分配采用现金方式;开放期内,基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资,投资人可选择获取现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资,

若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金红利;登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额只能采取现金红利方式,不能选择红利再投资;

(2)每一基金份额享有同等分配权;

(3)封闭期内,在符合有关基金收益分配条件的前提下,本基金收益每年至少分配1 次,最多分配12 次,并且本基金每年度收益分配比例不得低于基金该年度已实现收益的90%,

但若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配。封闭期内,若基金合同生效满6个月后,若基金在每月最后一个交易日收盘后每10 份基金份额可分配利润金额高于0.05 元(含),则基金须进行收益分配,每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的80%;

(4)开放期内,本基金收益每年最多分配12 次,每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的60%;

(5)基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(6)本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过15 个工作日。

(7)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别证券投资公允价值时采用的估值方法如下:

(1)非公开发行有明确锁定期的股票的估值

(i) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

(ii) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,应按中国证监会相关规定处理。

(2)长期停牌股票的估值

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的长期停牌股票进行估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。

(3)银行间同业市场交易的债券的估值

在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券,参照中国证券业协会证券投资基金估值工作小组关于固定收益品种的估值处理标准,选取中央国债登记结算有限责任公司按现金流量折现法独立计算的价格进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(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。

(5)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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。

注:根据2011年4月9日《易方达基金管理有限公司关于公司股东更名的公告》,基金管理人股东广东盈峰投资控股集团有限公司已更名为"盈峰投资控股集团有限公司",基金管理人已完成股东更名事项的工商变更登记。

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、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。

6.4.8 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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2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 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,363,923.73
其中:支付销售机构的客户维护费	362,683.89

注:基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.7%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提, 按月支付。由基金管理人于次月首日起5 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月首日起10 个工作日内从基金财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 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,675,406.78

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%÷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

基金托管费每日计提, 按月支付。由基金管理人于次月首日起5 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月首日起10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日					
	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	30,004,475.41	138,090,299.62	-	-	1,155,609,000.00	514,095.75

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010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	19,085,076.00	0.71%	30,002,100.00	1.12%

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 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	10,469,308.03	203,425.89

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2011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
002205	国统股份	2011-01-10	2012-01-11	非公开发行流通受限	27.00	26.00	24,078	650,106.00	626,028.00	-
300217	东方电热	2011-05-12	2011-08-18	新股流通受限	25.88	28.98	460,000	11,904,800.00	13,330,800.00	-
601208	东材科技	2011-05-16	2011-08-23	新股流通受限	20.00	21.61	104,918	2,098,360.00	2,267,277.98	-
6.4.9.1.2 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
1180122	11吉利债	2011-06-23	2011-07-05	新发流通受限	99.97	99.97	200,000	19,994,404.37	19,994,404.37	-
1181306	11苏京沪CP02	2011-06-30	2011-07-01	新发流通受限	100.00	100.47	300,000	30,000,000.00	30,141,000.00	-

注:1.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。

2.新疆国统管道股份有限公司于2011年6月17日(流通受限期内),向全体股东按每10股派发1.00元现金(含税)。

6.4.9.2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暂时停牌等流通受限股票。

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2011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360,127,059.87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
1181004	11鞍钢CP01	2011-07-01	100.01	500,000	50,005,000.00
1181005	11粤物资CP01	2011-07-01	100.17	129,000	12,921,930.00
1181104	11成渝CP01	2011-07-01	99.88	700,000	69,916,000.00
1181279	11北营钢CP01	2011-07-01	99.68	500,000	49,840,000.00
1181283	11大唐集CP01	2011-07-01	99.88	1,000,000	99,880,000.00
1101032	11央行票据32	2011-07-01	99.49	817,000	81,283,330.00
合计		-	-	3,646,000	363,846,260.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2011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333,900,000.00元,于2011年7月1日、2011年7月4日、2011年7月6日、2011年7月28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)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。

(b)以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2011年6月30日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为1,133,082,905.48 元,第二层级的余额为2,169,011,432.37元,无属于第三层级的余额(2010年12月31日:第一层级的余额为616,425,487.38元,第二层级的余额为1,978,623,000.00元,无属于第三层级的余额)。

(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	45,824,105.98	1.35
	其中:股票	45,824,105.98	1.35
2	固定收益投资	3,256,270,231.87	96.22
	其中:债券	3,256,270,231.87	96.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	15,037,639.81	0.44
6	其他各项资产	67,229,716.97	1.99
7	合计	3,384,361,694.63	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	16,224,105.98	0.60
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,267,277.98	0.08
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	626,028.00	0.02
C7	机械、设备、仪表	13,330,800.00	0.50
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	29,600,000.00	1.10
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	45,824,105.98	1.71

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	600795	国电电力	10,000,000	29,600,000.00	1.10
2	300217	东方电热	460,000	13,330,800.00	0.50
3	601208	东材科技	104,918	2,267,277.98	0.08
4	002205	国统股份	24,078	626,028.00	0.02

注:本基金本报告期末仅持有以上股票。

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	002233	塔牌集团	18,505,275.18	0.68
2	300217	东方电热	11,904,800.00	0.44
3	601208	东材科技	2,098,360.00	0.08
4	000630	铜陵有色	1,435,788.10	0.05
5	002205	国统股份	650,106.00	0.02
6	601558	华锐风电	270,000.00	0.01
7	601216	内蒙君正	150,000.00	0.01
8	002563	森马服饰	100,500.00	0.00
9	002557	洽洽食品	20,000.00	0.00
10	002566	益盛药业	19,950.00	0.00
11	002556	辉隆股份	18,750.00	0.00
12	601116	三江购物	11,800.00	0.00
13	002561	徐家汇	8,000.00	0.00

注:1.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。

2.本基金本报告期仅买入以上股票。

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	002233	塔牌集团	18,388,603.63	0.68
2	000630	铜陵有色	1,338,408.15	0.05
3	601558	华锐风电	219,758.99	0.01
4	601216	内蒙君正	178,200.00	0.01
5	002563	森马服饰	94,425.00	0.00
6	601118	海南橡胶	55,960.00	0.00
7	002557	洽洽食品	18,800.00	0.00
8	002556	辉隆股份	18,355.00	0.00
9	002566	益盛药业	18,280.00	0.00
10	601116	三江购物	16,380.00	0.00
11	002561	徐家汇	10,115.00	0.00

注:1.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。

2.本基金本报告期仅卖出以上股票。

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	35,193,329.28
卖出股票收入(成交)总额	20,357,285.77

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	313,836,000.00	11.68
3	金融债券	195,934,000.00	7.29
	其中:政策性金融债	195,934,000.00	7.29
4	企业债券	1,149,593,846.67	42.78
5	企业短期融资券	1,340,026,000.00	49.87
6	中期票据	-	-
7	可转债	256,880,385.20	9.56
8	其他	-	-
9	合计	3,256,270,231.87	121.18

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1001069	10央行票据69	2,200,000	214,346,000.00	7.98
2	110013	国投转债	1,310,010	156,323,493.30	5.82
3	1181283	11大唐集CP01	1,000,000	99,880,000.00	3.72
4	1101032	11央行票据32	1,000,000	99,490,000.00	3.70
5	122068	11海螺01	800,000	79,992,000.00	2.98

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3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	159,381.70
2	应收证券清算款	22,980,616.74
3	应收股利	-
4	应收利息	44,089,718.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,229,716.97

7.9.4 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	110011	歌华转债	39,658,500.00	1.48

7.9.5 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	300217	东方电热	13,330,800.00	0.50	新股流通受限
2	601208	东材科技	2,267,277.98	0.08	新股流通受限
3	002205	国统股份	626,028.00	0.02	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

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
3,745	715,384.50	2,367,489,576.60	88.37%	311,625,367.10	11.63%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司	237,221,056	12.36%
2	海通证券股份有限公司	159,433,700	8.31%
3	山西证券股份有限公司	100,006,000	5.21%
4	宝钢集团有限公司	99,996,999	5.21%
5	长江金色晚晴(集合型)企业年金计划-浦发银行	73,579,755	3.83%
6	招商证券股份有限公司	68,876,500	3.59%
7	中信证券-中信-中信证券稳健回报集合资产管理计划	62,934,720	3.28%
8	中国人寿保险(集团)公司	61,953,718	3.23%
9	中国投资担保有限公司	50,007,750	2.61%
10	中国人民财产保险股份有限公司	50,007,750	2.61%

注:本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9 重大事件揭示

9.1 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。

9.2 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。本报告期内,根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》,李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理;因工作调动,董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1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	
平安证券	1	19,886,986.78	97.69%	16,158.03	97.59%	-
国泰君安	1	470,298.99	2.31%	399.73	2.41%	-

注:a)本报告期内本基金无减少交易单元,新增平安证券有限责任公司、国泰君安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。

9.7.2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
平安证券	201,402,843.23	17.19%	-	-	-	-
国泰君安	970,552,154.27	82.81%	5,050,900,000.00	100.00%	-	-

易方达基金管理有限公司
二〇一一年八月二十六日