

(上接B029版)

注册地址: 青岛市市南区苗岭路29号奥帆大厦15层【507-151016】
办公地址: 上海市浦东新区深圳路22号青岛国际金融中心40楼B座2060611
联系人: 王彬、杨林
联系人: 王彬、杨林
联系电话: 0532-88022326
客户服务热线: 95548
传真: 0532-88022605
网址: www.qlfunds.com.cn
94) 中国银行股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址: 上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39-40层
法定代表人: 李卫
联系人: 李卫
开放式基金咨询电话: 400-620-8888
开放式基金业务传真: 021-50372474
网址: www.bocchina.com
95) 中国工商银行
注册地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址: 郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人: 曹国明
联系人: 何田田
联系电话: 0371-65585670
开放式基金咨询电话: 0371-967218、4008139666
开放式基金业务传真: 0371-65586665
网址: www.icbc.com.cn
96) 财达证券
注册地址: 石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24楼
办公地址: 石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24楼
法定代表人: 崔建强
联系人: 王彬
联系电话: 0311-66006342
客户服务热线: 400-612-8888
传真: 0311-66006334
网址: www.s10000.com
97) 泛华保险
注册地址: 四川省成都市成华区建设路9号高地中心C1101室
办公地址: 四川省成都市成华区建设路9号高地中心C1101室
法定代表人: 于海峰
联系人: 张蔚
联系电话: 028-82089096-828
客户服务热线: 4008878566
传真: 028-82089096-805
网址: www.yfjfund.com
98) 华融证券
注册地址: 上海虹口区中环路685弄37号4号楼49层
办公地址: 上海浦东新区陆家嘴1118号鄂尔多斯国际906-906室
法定代表人: 杨文斌
联系人: 张蔚
联系电话: 021-58870011
客户服务热线: 400-700-9665
传真: 021-68599616
网址: www.chowhuy.com
99) 天弘基金
注册地址: 上海市徐汇区龙田路190号9号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人: 其实
联系人: 潘俊友
联系电话: 021-54509998
客户服务热线: 400-1818-188
传真: 021-64385308
网址: www.1234567.com.cn
100) 聚米基金
注册地址: 杭州市余杭区仓前街道海曙路82号
办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人: 陈郁君
联系人: 张蔚
联系电话: 0571-88978699
客户服务热线: 4000-766-123
传真: 0571-26698533
网址: www.fund123.cn/
101) 同顺顺
注册地址: 浙江省杭州市文二西路一元茂大厦903室
办公地址: 浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人: 凌晓平
联系人: 张蔚
联系电话: 0571-88911818
客户服务热线: 0571-88920897、4008-773-772
传真: 0571-8880423
网址: www.Sifund.com
102) 聚信基金
注册地址: 北京市朝阳区义顺后沙峪国际新城街6号
办公地址: 北京市朝阳区朝林街17号华严北里12号民建大厦6层
法定代表人: 闫晓杰
联系人: 张蔚
联系电话: 010-62020088
客户服务热线: 400-888-6661
网址: www.myfund.com
103) 上海证券
注册地址: 上海市浦东新区高路626号2202室办公地址: 上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际大厦16层
法定代表人: 张宏伟
联系人: 张宏伟
电话: 021-58788678-8201
客服电话: 400-089-1289
公司网站: www.cricfund.com
104) 万联基金
注册地址: 北京市朝阳区北四环中路27号院2号楼3201/3201单元
办公地址: 北京市朝阳区北四环中路27号院2号楼3201单元
法定代表人: 李绍福
联系人: 高晓芳
电话: 010-59393023
客服电话: 400-808-0069
公司网站: http://www.wy-fund.com
105) 众禄基金
注册地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层J单元

办公地址: 深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25层J单元
法定代表人: 薛峰
联系人: 董彩平
电话: 0755-33227950
传真: 0755-88022950
客户服务热线: 4006-788-887
公司网站: www.zlfund.cn、www.jimw.com.cn
11) 易方达基金管理有限公司
注册地址: 广东省珠海市横琴新区宝业路4004-83室
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
法定代表人: 叶俊英
电话: 400-881 8088
传真: 020-38799249
联系人: 余嘉豪
二) 律师事务所和经办注册会计师
律师事务所: 北京市天元律师事务所
负责人: 王立华
电话: 010-88092150
经办律师: 宋永毅、陈华
联系人: 王立华
三) 会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展银银行大厦6楼
住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路202号普华永道中心11楼
负责人: 杨劲松
联系电话: 021 23238888
联系人: 沈兆杰
经办注册会计师: 薛冀、庄贤
四) 基金的投资
本基金名称: 易方达稳健收益债券型证券投资基金
基金类型: 债券型基金
本基金的投资目标
通过投资于债券品种, 追求基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资范围
本基金的投资范围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、可转债等。 资产可转换为债券、资产支持证券、债券回购等固定收益品种, 国债、金融债, 以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种, 基金管理人可在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金各类资产的投资比例为: 债券等固定收益品种不低于基金资产的80%, 其中, 可转债投资不超过基金资产净值的30%; 股票等权益类资产不超过基金资产净值的50%; 国债、金融债以及资产支持证券到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略
1) 资产配置策略
本基金基于对以下因素的分析, 进行基金资产在固定收益品种、可转债债券、股票主动投资及股票、股增券及转债之间的配置: 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比率以及风险; 3. 股票市场走势的预测; 4. 可转债债券发行频率及上市后的平均涨幅等, 预测可转债债券的收益比率及风险。

2) 固定收益品种的投资策略
a) 固定收益品种的资产配置策略
本基金通过宏观经济政策、包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸顺差、财政收支、价格指数和汇率等宏观经济政策、包括货币财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等 进行分析, 预测未来的利率走势, 判断债券市场对上述变量和政策的反应, 并据此调整调整债券组合的平均久期, 提高债券组合的总投资收益。

b) 期限结构策略
本基金通过对宏观经济政策、包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸顺差、财政收支、价格指数和汇率等宏观经济政策、包括货币财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等 进行分析, 预测未来的利率走势, 判断债券市场对上述变量和政策的反应, 并据此调整调整债券组合的平均久期, 提高债券组合的总投资收益。

c) 股票品种的选择
在债券组合平均久期、期限结构、类属配置和信用风险管理的基础上, 本基金对影响债券市场走势的主要因素, 包括经济、货币供应、信用风险、票息、税赋、含权等因素进行分析, 选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、规模水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析, 研究到期期限、金融债、企业债以及交易所有限行间市场债券品种的利率和权益趋势, 制定债券类资产的配置策略, 以获取不同债券类之间的利差优势所带来的投资收益。

九、基金的投资组合报告
1) 资产配置策略
本基金基于对以下因素的分析, 进行基金资产在非信用类固定收益品种(国债、央行票据、金融债、企业债、可转债、资产支持证券、债券回购等固定收益品种)、股票主动投资及股票、股增券及转债之间的配置: 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. 对宏观经济、行业前景以及公司业务发展的分析, 考量其行业前景、公司治理、财务状况、信用评级、行业地位、竞争优势、商业模式、创新能力等方面具有竞争优势, 并对未来中长期内以横面的竞争力优势。 本基金将根据企业业绩的长期增长趋势以及其类属的平均估值水平, 应用本基金管理人以及交易的投资策略, 选择将投资于该品种的基金进行投资。

九、基金的业绩比较基准
中债总指数(全价)

十、基金的风险收益特征
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。

十一、基金的投资组合报告(未经审计)
本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定, 已于2013年10月24日复核了本报告内容真实、准确和完整。

本投资组合报告有关数据的期间为2013年4月1日至2013年6月30日。

1. 报告期末按行业分类的股票投资组合			
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	121,626,596.80	6.81
	其中: 股票	121,626,596.80	6.81
2	固定收益投资	1,582,222,299.45	88.64
	其中: 债券	1,582,222,299.45	88.64
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买入返售金融资产的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	38,965,643.30	2.18
6	其他各项资产	42,216,028.43	2.37
7	合计	1,785,030,567.98	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合			
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	56,749,889.10	5.75
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	5,050,617.97	0.51
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
J	金融业	4,178,692.00	0.42
K	房地产业	24,012,944.91	2.43
L	租赁和商务服务业	-	-
M	信息、软件和信息技术服务业	12,885,242.70	1.31
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	18,749,210.12	1.90
合计		121,626,596.80	12.33

3. 报告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					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600805	悦达投资	2,046,837	18,749,210.12	1.90
2	600340	华夏幸福	559,869	18,218,137.36	1.85
3	600176	中国石化	2,097,388	16,003,070.44	1.62
4	600519	贵州茅台	49,429	9,566,367.73	0.97
5	600016	民生银行	1,000,000	8,570,000.00	0.87
6	000981	威孚高科	167,942	5,607,583.38	0.57
7	300258	精研科技	496,940	5,217,870.00	0.53
8	000027	深圳能源	1,004,009	3,505,617.97	0.51
9	600887	新亚药业	150,000	4,492,000.00	0.48
10	600060	海信电器	600,000	4,314,000.00	0.44

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合			
债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
国家债券	159,920,000.00	16.21	
央行票据	-	-	
金融债券	192,410,000.00	19.50	
其中:政策性金融债	192,410,000.00	19.50	
企业债券	964,572,806.05	97.75	
企业中期票据	30,000,000.00	3.04	
中期票据	50,321,000.00	5.10	
可转换	184,998,493.40	18.75	
其他	-	-	
合计	1,582,222,299.45	160.35	

5. 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130005	13国债05	1,500,000	150,000,000.00	15.20
2	124106	12国债06	799,990	84,718,944.00	8.59
3	122607	12国债07	769,590	82,061,381.70	8.32
4	110001	11国债01	579,360	63,401,227.20	6.43
5	122608	12国债08	500,000	52,995,000.00	5.37

6. 报告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。
7. 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8. 本基金报告期末持有的股指期货
a) 本基金本报告期末未持有股指期货。
b) 本基金本报告期末未持有股指期货。
c) 本基金本报告期末未持有股指期货。

序号	资产名称	名称	金额(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-	160,170.35	0.16
2	央行票据	-	-	-	-
3	应收利息	-	-	14,914,358.94	1.51
3	应收股利	-	-	142,500.00	0.01
4	应收账款	-	-	24,910,817.29	2.52
5	应收中期票	-	-	2,083,266.27	0.21
6	其他	-	-	2,984,200	0.30
7	待摊费用	-	-	-	-
8	其他	-	-	-	-
9	合计	-	-	42,216,028.43	4.30

9. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113003	重工转债	63,401,227.20	6.43
2	110015	石化转债	142,500.00	0.01
3	110015	石化转债	15,268,370.00	1.58
4	110016	川投转债	35,356,700.00	3.58
5	110018	国电转债	8,067,448.80	0.82
6	110022	中航转债	6,444,195.00	0.65
7	127001	南航转债	1,196,056.70	0.12

6 报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的费用
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效后, 在2013年7月19日, 基金合同生效以来截至2013年6月30日的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下所示:

稳健收益基金基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表					
阶段	净值增长率(1)	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)
自稳健收益基金合同生效至2008年12月31日	8.09%	0.12%	9.87%	0.22%	-1.78%
2009年1月1日至2009年12月31日	4.58%	0.25%	-4.44%	0.11%	9.02%
2010年1月1日至2010年12月31日	8.59%	0.32%	-0.87%	0.10%	9.46%
2011年1月1日至2011年12月31日	-4.19%	0.30%	2.52%	0.11%	-6.71%
2012年1月1日至2012年12月31日	13.64%	0.31%	-0.67%	0.07%	14.31%
2013年1月1日至2013年6月30日	3.15%	0.36%	0.47%	0.10%	2.68%
自稳健收益基金合同生效至2013年6月30日	37.86%	0.28%	6.48%	0.13%	31.38%

2. 稳健收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表					
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率标准差③	①-③	②-④
自稳健收益基金合同生效至2008年12月31日	8.40%	0.12%	9.87%	0.22%	-1.47%
2009年1月1日至2009年12月31日	4.90%	0.25%	-4.44%	0.11%	9.34%
2010年1月1日至2010年12月31日	8.92%	0.32%	-0.87%	0.10%	9.79%
2011年1月1日至2011年12月31日	-3.91%	0.30%	2.52%	0.11%	-6.43%
2012年1月1日至2012年12月31日	13.91%	0.31%	-0.67%	0.07%	14.60%
2013年1月1日至2013年6月30日	3.39%	0.36%	0.47%	0.10%	2.92%

注: 稳健收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
稳健收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司
注: 稳健收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
稳健收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司

1. 月收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率标准差(3)	①-③	②-④
自月收益基金合同生效至2008年12月31日	0.5710%	0.0065%	0.6150%	-	-0.0440%
2009年1月1日至2009年12月31日	1.4389%	0.0116%	2.2665%	0.0046%	-0.8276%
2010年1月1日至2010年12月31日	2.3181%	0.0200%	3.2952%	0.0021%	-0.9771%
2011年1月1日至2011年12月31日	0.19%	0.01%	0.34%	0.0021%	-0.15%
2012年1月1日至2012年12月31日	0.19%	0.01%	0.34%	0.0021%	-0.15%
2013年1月1日至2013年6月30日	4.58%	0.02%	6.52%	0.00%	-1.94%

2. 月收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率标准差(3)	①-③	②-④
自月收益基金合同生效至2008年12月31日	0.6413%	0.0069%	0.6150%	-	0.0263%
2009年1月1日至2009年12月31日	1.6923%	0.0118%	2.2665%	0.0046%	-0.5742%
2010年1月1日至2010年12月31日	1.8186%	0.0230%	2.2929%	0.0022%	-0.4743%
2011年1月1日至2011年12月31日	0.21%	0.01%	0.34%	0.00%	-0.13%
2012年1月1日至2012年12月31日	0.21%	0.01%	0.34%	0.00%	-0.13%
2013年1月1日至2013年6月30日	4.42%	0.02%	5.52%	0.00%	-1.10%

月收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
月收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司

十二、基金的费用
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。 投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效后, 在2013年7月19日, 基金合同生效以来截至2013年6月30日的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下所示:
1.A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
2. 稳健收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司
注: 稳健收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
稳健收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司

1. 月收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
2. 月收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司
注: 稳健收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
稳健收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司

1. 月收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
2. 月收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司
注: 稳健收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
稳健收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司

1. 月收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
2. 月收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司
注: 稳健收益A级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
稳健收益B级基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表
数据期间: 自2008年12月31日至2013年6月30日
数据来源: 易方达稳健收益债券型证券投资基金管理人易方达基金管理有限公司