

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
报告送出日期:二〇一一年四月二十二日
重要提示
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。
本基金经中国证监会于2010年4月15日复核了本报告中的财务指标、净值收益率和投资组合报告,并同意该报告可以披露。复核报告见2010年4月15日登载于《中国证券报》的《易方达稳健收益债券型证券投资基金2010年第1季度报告复核报告》。
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。
本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。
本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至2011年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:易方达稳健收益债券

基金代码:110007

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2008年1月22日

报告期末基金份额总额:786,360,532.07份

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。

本基金基于以下三个因素的判断,进行债券资产在固定收益品种、可转换债券、股票、货币市场投资的配置,1)主要基于对利率水平、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)基于新发行额中,中签率、上市后的平均涨幅等,预测新股申购收益水平及风险;3)股票市场走势的预测,4)可转换债券发行公司的经营和财务评价的判断。

业绩比较基准:中债国债指数(100%)

风险收益特征:本基金为债券基金,基金证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,股票型基金,高于货币市场基金。

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

下属基金的基金简称:易方达稳健收益债券 A

下属基金的基金代码:110007

报告期末下属两级基金的份额总额:545,312,486.97份

报告期末下属两级基金的基金净值表现:241,048,045.60份

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)

易方达稳健收益债券 A 易方达稳健收益债券 B

1.本期已实现收益 1,682,647.04 1,103,073.23

2.本期利润 -10,001,354.63 -3,648,403.44

3.期初平均基金份额本期利润 -0.0166 -0.0128

4.期末基金资产净值 573,027,116.24 253,780,788.28

5.期末基金份额净值 1.0508 1.0528

注:1)所列基金业亚洲指数不包括持有认沽或认沽的各类费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

2)本期已实现的收益指本基金本期收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)减去期间费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.1 本期净资产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 净值增长率① 0.13% 0.09% 0.08% 0.10% -1.47% 0.09%

标准差② 0.19% 0.08% 0.08% 0.10% 0.00% 0.00%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -1.32% 0.10% 0.08% 0.10% -1.40% 0.09%

易方达稳健收益债券 B:

阶段 净值增长率① 0.10% 0.08% 0.08% 0.10% -1.47% 0.09%

标准差② 0.19% 0.08% 0.08% 0.10% 0.00% 0.00%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -1.32% 0.10% 0.08% 0.10% -1.40% 0.09%

3.2.2 目前基金类型以来基金累计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:

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

2008年1月20日-2011年3月31日

易方达稳健收益债券 B:

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

2008年4月17日至2011年3月31日

注:1)所列基金业亚洲指数不包括持有认沽或认沽的各类费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

2)本期已实现的收益指本基金本期收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)减去期间费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.3 本期净资产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 净值增长率① 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

标准差② 0.29% 0.29% 0.29% 0.29% 0.20%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -4.29% 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

易方达稳健收益债券 B:

阶段 净值增长率① 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

标准差② 0.29% 0.29% 0.29% 0.29% 0.20%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -4.29% 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

3.2.4 目前基金类型以来基金累计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:

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

2008年4月17日至2011年3月31日

易方达稳健收益债券 B:

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

2008年4月17日至2011年3月31日

注:1)所列基金业亚洲指数不包括持有认沽或认沽的各类费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

2)本期已实现的收益指本基金本期收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)减去期间费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.5 本期净资产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 净值增长率① 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

标准差② 0.29% 0.29% 0.29% 0.29% 0.20%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -4.29% 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

易方达稳健收益债券 B:

阶段 净值增长率① 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

标准差② 0.29% 0.29% 0.29% 0.29% 0.20%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -4.29% 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

3.2.6 目前基金类型以来基金累计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:

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

2008年4月17日至2011年3月31日

易方达稳健收益债券 B:

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

2008年4月17日至2011年3月31日

注:1)所列基金业亚洲指数不包括持有认沽或认沽的各类费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

2)本期已实现的收益指本基金本期收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)减去期间费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.7 本期净资产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 净值增长率① 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

标准差② 0.29% 0.29% 0.29% 0.29% 0.20%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -4.29% 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

易方达稳健收益债券 B:

阶段 净值增长率① 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

标准差② 0.29% 0.29% 0.29% 0.29% 0.20%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -4.29% 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

3.2.8 目前基金类型以来基金累计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:

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

2008年4月17日至2011年3月31日

易方达稳健收益债券 B:

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

2008年4月17日至2011年3月31日

注:1)所列基金业亚洲指数不包括持有认沽或认沽的各类费用,计价费用后实际收益水平要低于所列数据。

2)本期已实现的收益指本基金本期收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)减去期间费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.9 本期净资产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 净值增长率① 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

标准差② 0.29% 0.29% 0.29% 0.29% 0.20%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -4.29% 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

易方达稳健收益债券 B:

阶段 净值增长率① 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

标准差② 0.29% 0.29% 0.29% 0.29% 0.20%

业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准

①-③ ②-④

过去三个月 -4.29% 1.36% 2.06% 1.16% -6.35% 0.20%

3.3.1 本期平均基金份额本期利润

易方达稳健收益债券 A: 1.19,892,598.475

易方达稳健收益债券 B: 747,324,396.92

3.3.2 本期基金份额净值增长率

易方达稳健收益债券 A: 12,133,730.54</p