

易方达信用债债券型证券投资基金

2015 半年度报告摘要

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)持续以公允价值计量的金融工具

(i)构成金融工具公允价值

于2015年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融资产中无属于第一层次的金融工具,属于第二层次的金融工具公允价值为969,607,506.32元,无属于第三层次的金融工具公允价值;属于第三层次的金融工具公允价值为4,339,035.37元,第二层次306,219,750.00元,无属于第三层次的金融工具。

(ii)公允价值所属层次的重大变动

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(包括涨停或跌停)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计入第一层次;并根据估值调整中可采用在证券交易所上市相同标的股票的公允价值,确定相关股票公允价值归属层次。除上述情况外,对于在证券交易所上市、未挂牌转让的固定收益品种和可转换债券、资产支持证券和私募债券等,本基金于2015年6月19日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券业协会估值技术委员会估值工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值,并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

(a)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015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(2014年12月31日:无)。

(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不多。

(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。

7.1 期末基金份额组合情况

7.2 投资组合情况

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	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	869,607,506.32	94.43
4	其中:债券	869,607,506.32	94.43
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	16,666,026.44	2.05
11	其他资产	910,338,788.01	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.4.1 期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债期货	-	-
3	金融债券	110,792,000.00	21.64
4	其中:政策性金融债	110,792,000.00	21.64
5	企业债券	696,424,506.32	136.00
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	62,301,000.00	10.24
8	可转债	-	-
9	合计	869,607,506.32	167.94

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150210	15国开10	700,000	70.851,000.00
2	124677	14附息债	500,000	53,625,000.00
3	124650	12国债03	400,000	47,375,000.00
4	124778	14国债03	400,000	41,804,000.00
5	127005	14国债03	400,000	40,544,000.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融投资明细

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。

7.12.1 本基金投资组合内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 本基金本报告期无国债期货交易。

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	37,610.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,626,414.70
5	应收申购款	-
6	待摊费用	-
7	其他资产	-
8	合计	16,666,026.44

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.4.1 期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债期货	-	-
3	金融债券	110,792,000.00	21.64
4	其中:政策性金融债	110,792,000.00	21.64
5	企业债券	696,424,506.32	136.00
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	62,301,000.00	10.24
8	可转债	-	-
9	合计	869,607,506.32	167.94

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150210	15国开10	700,000	70.851,000.00
2	124677	14附息债	500,000	53,625,000.00
3	124650	12国债03	400,000	47,375,000.00
4	124778	14国债03	400,000	41,804,000.00
5	127005	14国债03	400,000	40,544,000.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融投资明细

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。

7.12.1 本基金投资组合内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 本基金本报告期无国债期货交易。

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	37,610.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,626,414.70
5	应收申购款	-
6	待摊费用	-
7	其他资产	-
8	合计	16,666,026.44

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.4.1 期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债期货	-	-
3	金融债券	110,792,000.00	21.64
4	其中:政策性金融债	110,792,000.00	21.64
5	企业债券	696,424,506.32	136.00
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	62,301,000.00	10.24
8	可转债	-	-
9	合计	869,607,506.32	167.94

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150210	15国开10	700,000	70.851,000.00
2	124677	14附息债	500,000	53,625,000.00
3	124650	12国债03	400,000	47,375,000.00
4	124778	14国债03	400,000	41,804,000.00
5	127005	14国债03	400,000	40,544,000.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融投资明细

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。

7.12.1 本基金投资组合内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 本基金本报告期无国债期货交易。

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	37,610.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,626,414.70
5	应收申购款	-
6	待摊费用	-
7	其他资产	-
8	合计	16,666,026.44

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.4.1 期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债期货	-	-
3	金融债券	110,792,000.00	21.64
4	其中:政策性金融债	110,792,000.00	21.64
5	企业债券	696,424,506.32	136.00
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	62,301,000.00	10.24
8	可转债	-	-
9	合计	869,607,506.32	167.94

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150210	15国开10	700,000	70.851,000.00
2	124677	14附息债	500,000	53,625,000.00
3	124650	12国债03	400,000	47,375,000.00
4	124778	14国债03	400,000	41,804,000.00
5	127005	14国债03	400,000	40,544,000.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融投资明细

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。

7.12.1 本基金投资组合内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 本基金本报告期无国债期货交易。

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	37,610.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,626,414.70
5	应收申购款	-
6	待摊费用	-
7	其他资产	-
8	合计	16,666,026.44

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.4.1 期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债期货	-	-
3	金融债券	110,792,000.00	21.64
4	其中:政策性金融债	110,792,000.00	21.64
5	企业债券	696,424,506.32	136.00
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	62,301,000.00	10.24
8	可转债	-	-
9	合计	869,607,506.32	167.94

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150210	15国开10	700,000	70.851,000.00
2	124677	14附息债	500,000	53,625,000.00
3	124650	12国债03	400,000	47,375,000.00
4	124778	14国债03	400,000	41,804,000.00
5	127005	14国债03	400,000	40,544,000.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融投资明细

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。

7.12.1 本基金投资组合内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 本基金本报告期无国债期货交易。

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	37,610.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,626,414.70
5	应收申购款	-
6	待摊费用	-
7	其他资产	-
8	合计	16,666,026.44

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.4.1 期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债期货	-	-
3	金融债券	110,792,000.00	21.64
4	其中:政策性金融债	110,792,000.00	21.64
5	企业债券	696,424,506.32	136.00
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	62,301,000.00	10.24
8	可转债	-	-
9	合计	869,607,506.32	167.94

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150210	15国开10	700,000	70.851,000.00
2	124677	14附息债	500,000	53,625,000.00
3	124650	12国债03	400,000	47,375,000.00
4	124778	14国债03	400,000	41,804,000.00
5	127005	14国债03	400,000	40,544,000.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融投资明细

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。

7.12.1 本基金投资组合内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 本基金本报告期无国债期货交易。

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	37,610.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,626,414.70
5	应收申购款	-
6	待摊费用	-
7	其他资产	-
8	合计	16,666,026.44

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.4.1 期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	国债期货	-	-
3	金融债券	110,792,000.00	21.64