易方达医疗保健行业股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年 12 月 31 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
报告送出日期：二〇一三年一月二十二日

§1 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。

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2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达医疗保健行业股票
基金主代码	110023
交易代码	110023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年1月28日
报告期末基金份额总额	2,467,959,727.43份
投资目标	主要投资医疗保健行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将根据对医疗保健行业各子行业的综合分析，从中选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的上市公司进行投资，在努力控制风险的前提下追求超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为主动股票基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益较高的投资品种，理论上其风险收益水平高于混合基金和债券基金。同时，本基金为行业基金，在享受医疗保健行业收益的同时，也必须承担单一行业带来的风险。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	-65,316,002.33
2.本期利润	-44,034,090.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0143
4.期末基金资产净值	2,362,170,392.72
5.期末基金份额净值	0.957

注：1.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；

2.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。

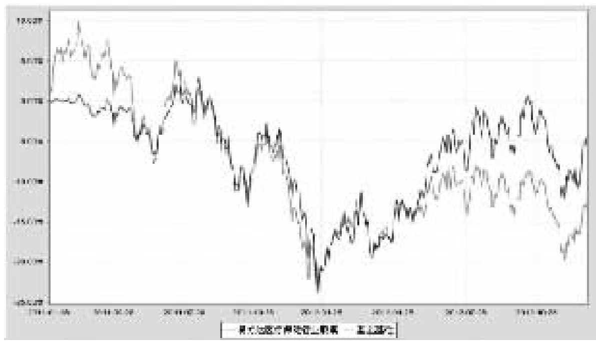
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	②-④
过去三个月	-0.10%	1.13%	-0.21%	0.97%	0.11%	0.16%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

易方达医疗保健行业股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2011年1月28日至2012年12月31日）



注：1.基金合同中关于基金投资比例的约定：

（1）股票资产占基金资产净值的比例为60%—95%；

（2）现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；

（3）本基金投资于上海申银万国证券研究所有限公司界定的医药生物行业股票的比例不低于股票资产的85%，如因基金管理人界定医疗保健行业的方法调整或者上市公司经营发生变化等，本基金持有申万研究界定的医药生物行业股票的比例低于股票资产的85%，本基金应在三十个交易日之内进行调整；

（4）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%；

（5）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%；

（6）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；

（7）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%；

（8）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，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%；

（9）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%；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%；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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；

（10）在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；

（11）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。

2.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。

3.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-4.30%，同期业绩比较基准收益率为-12.22%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李文健	本基金的基金经理、行业研究员	2011-1-28	-	12年	硕士研究生，曾任汇凯集团综合管理部业务主管、国泰君安证券股份有限公司研究所研究员、华林证券有限公司研究所研究员、鹏华基金管理有限公司研究部研究员。

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 公平交易专项说明

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，以及强化事后分析评估监督机制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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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17次，原因为年末指数成分股调整，指数基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生反向交易。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年10、11月，A股市场延续了上个季度的下跌走势，但12月市场在权重股的带动下出现了强劲的反弹。整个第四季度，沪深300指数上涨了10.02%。在市场的风格转换中，医药板块再次呈现与大盘迥异的走势，11月跌幅较大，12月却反弹乏力，整个第四季度申万生物医药指数反而下跌了0.2%。医药板块扭转了5月以来跑赢大盘的趋势，主要原因有：

1、国内宏观经济的一些指标出现了明显的改善，包括工业增加值的环比增速、工业企业的收入和利润增速、房地产的销售面积和销售额，以及发电量增速等都有向好趋势。市场认为宏观经济有复苏的迹象，因此金融、地产、有色、煤炭等早周期的板块表现活跃。

2、中央新的领导班子提出发展城镇化的战略构想，城镇化成为投资主题，地产、建筑建材、工程机械等相关行业成为热点板块。

3、前期强势的白酒板块，在第四季度遭遇“塑化剂”事件，下跌幅度较大。市场担心同样强势的医药板块也会遭遇类似的事件。

三季度末，本基金对四季度的市场展望中，对医药板块在四季度的表现持乐观的态度，强调保持较高仓位，继续调整持仓结构。但由于市场发生变化，仓位有所降低，结构上略微平衡了一、二线品种的配置比例。

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0.957元，本报告期份额净值增长率为-0.10%，同期业绩比较基准收益率为-0.21%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金对医药板块在2013年一季度的表现持相对乐观的态度，主要是基于以下的判断：

1）医药行业去年一季度的运行数据较低，预计今年一季度，收入和利润增速有望超过20%的水平。

2）行业政策仍以偏利好为主，09年以来的药品行政性降价趋于尾声，近期公布的一些省市药品招标方案明显向产品质量、技术含量、标准层次等非价格因素倾斜，缓和了前期的恶性价格竞争，同时有利于龙头企业进一步强化竞争优势。

3）国家发展城镇化的战略，将扩大基层对医疗卫生的需求，因此医药板块也是“城镇化”主题的受益者，而且更为持续和确定。近期政府将公布新一版的基本用药目录，新进目录的品种有望进入新一轮的销售增长期。

4）目前一线医药公司的2013年动态估值大约20-25倍，在历史上属偏低水平，下跌空间有限。

因此，本基金计划在2013年第一季度适当调高仓位，继续进行持仓结构的调整。在行业内部分化严重，产业集中度不断提升的背景下，优质企业成长的空间更大。本基金配置进一步向产业基础较好、竞争优势明显、发展潜力较大的优势公司倾斜。

本基金长期看好医疗保健行业的投资价值，将坚持价值投资的理念，努力抓住医疗改革、人口老龄化、产业升级、产业整合等主题带来的投资机会，寻找持续成长性好、竞争优势显著、定价相对合理的投资品种，提高投资操作的效率，争取为投资者创造良好的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,852,679,622.13	78.04
	其中：股票	1,852,679,622.13	78.04
2	固定收益投资	103,337,747.20	4.35
	其中：债券	103,337,747.20	4.35
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,145.00	2.11
	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	153,486,788.52	6.47
6	其他各项资产	214,535,164.43	9.04
7	合计	2,374,039,467.28	100.00

5.2 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	采掘业	-	-
C	制造业	1,573,551,804.53	66.61
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	117,158,822.15	4.96
C8	医药、生物制品	1,456,392,982.38	61.65
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
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	242,262,998.96	10.26
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	36,864,818.64	1.56
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,852,679,622.13	78.43

5.3 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	000963	华东医药	5,335,378	181,402,852.00	7.68
2	000423	东阿阿胶	4,436,673	179,285,955.93	7.59
3	600535	天士力	2,276,366	125,814,748.82	5.33
4	000538	云南白药	1,751,956	119,133,008.00	5.04
5	002038	双鹭药业	2,992,539	118,384,842.84	5.01
6	600276	恒瑞医药	3,290,516	99,044,531.60	4.19
7	600521	华海药业	7,960,993	90,755,320.20	3.84
8	002317	众生药业	2,460,908	76,042,057.20	3.22
9	600518	康美药业	5,149,426	67,663,457.64	2.86
10	000999	华润三九	2,798,385	66,321,724.50	2.81

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,850,000.00	4.23
	其中：政策性金融债	99,850,000.00	4.23
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,487,747.20	0.15
8	其他	-	-
9	合计	103,337,747.20	4.37

5.5 报告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

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	120238	12国开38	500,000	49,930,000.00	2.11
2	120245	12国开45	500,000	49,920,000.00	2.11
3	110022	同仁转债	29,820	3,487,747.20	0.15

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	31,470.76
2	应收证券清算款	213,397,249.69
3	应收股利	-
4	应收利息	678,870.77
5	应收申购款	427,573.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	214,535,164.43

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中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未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	3,427,072,328.43
本报告期基金总申购份额	172,978,667.68
减：本报告期基金总赎回份额	1,132,091,268.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,467,959,727.43

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达医疗保健行业股票型证券投资基金募集的文件；
2.《易方达医疗保健行业股票型证券投资基金基金合同》；
3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4.《易方达医疗保健行业股票型证券投资基金托管协议》；
5.基金管理人业务资格批件和营业执照；
6.基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一三年一月二十二日

易方达消费行业股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年一月二十二日

§1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达消费行业股票
基金主代码	110022
交易代码	110022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月20日
报告期末基金份额总额	3,288,429,735.80份
投资目标	主要投资消费行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将根据对消费行业各子行业的综合分析，从中选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的上市公司进行投资，在努力控制风险的前提下追求更高回报。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×85%+中债总指数收益率×15%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中预期风险与预期收益较高的投资品种，理论上其风险收益水平高于混合基金和债券基金。同时，本基金作为行业基金，在享受消费行业收益的同时，也必须承担单一行业带来的风险。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	-136,941,027.68
2.本期利润	-103,097,230.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0284
4.期末基金资产净值	2,684,856,621.61
5.期末基金份额净值	0.816

注：1.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；

2.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。

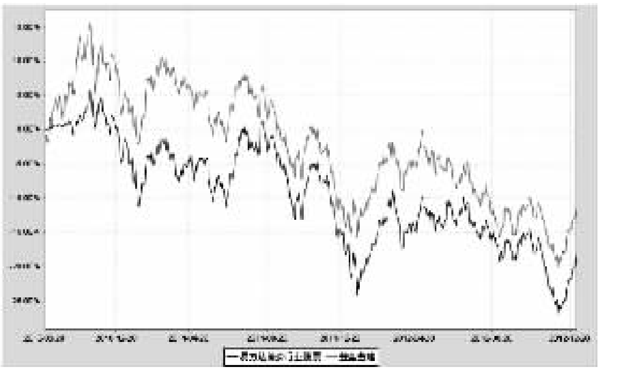
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	②-④
过去三个月	-2.74%	1.01%	0.40%	0.98%	-3.14%	0.03%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

易方达消费行业股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2010年8月20日至2012年12月31日）



注：1.基金合同中关于基金投资比例的约定：

（1）股票资产占基金资产的80%—95%；

（2）本基金投资于中证指数公司界定的主要消费行业和可选消费行业股票的比例不低于股票资产的95%；

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

（5）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%；

（6）本基金参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，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；

（7）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（8）本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，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%；

（9）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%；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%；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%；本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%；

（10）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

2.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。

3.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-18.40%，同期业绩比较基准收益率为-11.58%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘芳洁	本基金的基金经理	2010-8-20	2012-11-24	8年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、易方达科翔股票型证券投资基金（原科翔证券投资基金）的基金经理。
萧楠	本基金的基金经理	2012-9-28	-	6年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金投资部基金经理助理。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，刘芳洁的“任职日期”为基金合同生效之日，萧楠的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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 公平交易专项说明

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，以及强化事后分析评估监督机制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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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17次，原因为年末指数成分股调整，指数基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生反向交易。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年4季度A股市场经历了较大幅度的波动。进入10月后，股指一路下挫，12月4日上证指数跌至1949.46点，创下了2009年3月以来的新低。然而，市场于12月5日开始了强劲的上涨，在地产、金融等周期性板块的带动下，4季度上证指数上涨8.77%，深成指上涨5.04%。而内地消费指数则表现不佳，上涨了0.54%。2012年股指最终能够从极度悲观的预期中走出来，一方面有赖于宏观面上各种负面因素已充分反应在股价之中，另一方面投资者似乎逐渐找到了经济转型的落脚点，此外，RQFII在香港的热卖，也给了A股市场有力的信心支撑。

从消费行业各子行业表现来看，汽车板块（含整车制造、零部件制造、销售服务三个子版块）表现最为强劲，家电行业、农业板块表现也较为突出。而以白酒为代表的食品饮料行业在终端销售不畅的压力下走势疲弱，随后又在“塑化剂”风波下遭到了重创，给本基金带来了较大的损失。前三个季度表现一直比较强劲的医药商业板块也出现了较大幅度的下跌。

本基金在四季度初超配了白酒股，尽管在“塑化剂”事件持续发酵时期做了大幅度的减仓，但仍然没能够充分规避下跌风险，使得本基金在这个时期遭到了较大的损失。在这种情况下，本基金调整了配置思路，大幅度调整了食品饮料板块的个股结构，12月中旬以来逐步追回部分损失。

进入四季度以后，本基金加大了对前期一直低配的汽车板块的配置力度，取得了较好的效果。同时，本季度适度减持了前期超额收益较多的医药商业板块，以及一些估值较高、预期较高的个股。

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0.816元，本报告期份额净值增长率为-2.74%，同期业绩比较基准收益率为0.40%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年，我们认为市场会在反复中前行，我们也会对市场保持谨慎乐观。我们相信，中国从不缺乏增长的潜力，只要能够不断解放生产力，市场会为我们找到方向。所以，从宏观面来看，投资者所热切期盼的制度改革、经济转型，能否如期反映在相关政策上，以及最终能否如期反映在上市公司的基本面上，是决定未来方向的主要因素。另一方面，我们也相信，无论宏观环境怎样变化，那些竞争力来自企业自身、经受过经济周期洗礼的优秀公司，仍然会给我们带来持续的回报。

当前，从我们跟踪的各类消费相关的数据看，不少细分子行业已经有明显的回暖趋势，同时，个别子行业的竞争格局正在发生令人无法忽视的变化。我们认为，2013年消费行业整体不必悲观，并且，投资者可以从子行业、个股的分化中，获得投资机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,316,348,179.29	85.28
	其中：股票	2,316,348,179.29	85.28
2	固定收益投资	119,828,000.00	4.41
	其中：债券	119,828,000.00	4.41
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	137,800,388.90	5.07
	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	139,657,798.97	5.14
6	其他各项资产	2,597,338.55	0.10
7	合计	2,716,231,705.71	100.00

5.2 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	采掘业	-	-
C	制造业	1,901,538,417.19	70.82
C0	食品、饮料	1,035,400,572.68	38.56
C1	纺织、服装、皮毛	42,604,000.00	1.59
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	38,230,772.30	1.42
C5	电子	43,799,789.76	1.63
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	658,943,041.90	24.54
C8	医药、生物制品	28,685,240.55	1.07
C99	其他制造业	53,875,000.00	2.01
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
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	275,790,923.83	10.27
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	90,718,838.27	3.38
L	传播与文化产业	48,300,000.00	1.80
M	综合类	-	-
	合计	2,316,348,179.29	86.27

5.3 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	000651	格力电器	9,300,000	237,150,000.00	8.83
2	600519	贵州茅台	1,130,000	236,192,600.00	8.80
3	600887	伊利股份	10,000,000	219,800,000.00	8.19
4	600104	上汽集团	9,099,995	160,523,911.80	5.98
5	000568	泸州老窖	2,900,000	102,660,000.00	3.82
6	002344	海宁皮城	3,531,093	93,856,451.94	3.50
7	000963	华东医药	2,500,000	85,000,000.00	3.17
8	002385	大北农	3,933,686	84,967,617.60	3.16
9	600199	金种子酒	4,000,000	76,840,000.00	2.86
10	002304	洋河股份	800,000	74,696,000.00	2.78

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,828,000.00	4.46
	其中：政策性金融债	119,828,000.00	4.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	119,828,000.00	4.46

5.5 报告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

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	120238	12国开38	1,000,000	99,860,000.00	3.72
2	120245	12国开45	200,000	19,968,000.00	0.74

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	972,046.50
2	应收证券清算款	376,437.74
3	应收股利	-
4	应收利息	1,067,251.45
5	应收申购款	181,602.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,597,338.55

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	3,821,307,927.29
本报告期基金总申购份额	61,644,657.40
减：本报告期基金总赎回份额	594,522,848.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,288,429,735.80

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达消费行业股票型证券投资基金募集的文件；
2.《易方达消费行业股票型证券投资基金基金合同》；
3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4.《易方达消费行业股票型证券投资基金托管协议》；
5.基金管理人业务资格批件和营业执照；
6.基金托管人业务资格批件和营业执照。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一三年一月二十二日

易方达岁丰添利债券型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年 12 月 31 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
报告送出日期：二〇一三年一月二十二日

§1 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。

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2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	场外：易方达岁丰添利债券；场内：易基岁丰
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
报告期末基金份额总额	2,679,114,943.70份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	57,668,733.60
2.本期利润	76,068,244.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0284
4.期末基金资产净值	2,763,648,378.71
5.期末基金份额净值	1.032

注：1.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；

2.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。

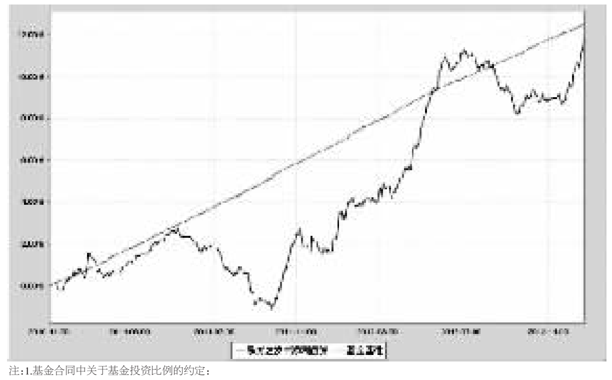
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	②-④
过去三个月	2.89%	0.17%	1.37%	0.02%	1.52%	0.15%

3.2.2自基金合同生效以来基金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
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2010年11月9日至2012年12月31日）



注：1.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）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。

2.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。

3.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11.78%，同期业绩比较基准收益率为12.51%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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证券投资基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、固定收益总部总经理、固定收益投资部总经理	2010-11-9	-	12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、固定收益部总经理。

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 公平交易专项说明

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，以及强化事后分析评估监督机制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 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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17次，原因为年末指数成分股调整，指数基金因被动跟踪标的指数和其他组合发生反向交易。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2012年四季度国内经济呈现企稳复苏迹象，工业增加值同比增速与PMI持续好转，PPI环比下半年以来首次转正并企稳，房地产和基建投资逐步回暖，而CPI维持在低位。持续的低通胀环境以及宏观指标的不断改善逐步改变着市场的预期，加之十八大顺利召开后，政治上的不确定性因素逐步消退，新一代领导人的崭新面貌激发起市场对于改革释放制度红利的信心。

虽然临近年底资金面异常紧张、资金价格居高不下，但经济复苏以及市场信心的恢复引导股票市场止跌回升并在12月份大幅上涨。债券市场方面，受资金面紧张影响，短端品种收益率上行幅度超过长端，收益率曲线异常平坦化；利率品种和高等级信用债收益率大幅上行，而低等级信用债由于绝对收益率较高以及“获取持有期收益”这样的一直预期继续获得市场青睐，收益率稳定甚至小幅下行。

四季度我们基于对经济复苏趋势确认的判断，看好权益类资产的表现，岁丰添利维持原有较高的可转债仓位并增加持仓，静待市场的反弹。债券资产方面，减持利率品种，降低组合久期，增加信用债仓位以获取持有期收益。受益于权益市场的优秀表现，岁丰添利在四季度获得较好的投资回报。

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1.032 元，本报告期份额净值增长率为2.89%，同期业绩比较基准收益率为1.37%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年一季度经济环境，从国内因素看，货币信贷和社会融资总量的适度增长将创造较2012年四季度宽松的货币环境，经济有望延续复苏趋势；从国外因素看，欧债问题得到妥善处理、美国财政悬崖问题暂时得到解决，短期外部风险消退。信心的逐步增强可能将继续提升市场对大类资产的风险偏好程度，我们认为权益类资产的表现将优于固定收益资产的表现。

一季度资金利率中枢有望下移，预计收益率曲线将从异常平坦化转向陡峭化，结合以上判断，我们在债券资产上将保持中性偏低的杠杆以及中性偏短的久期。分品种看，利率品种在经济企稳复苏以及全球量化宽松的背景下难现系统性机会；信用债方面，企业资产负债率的上升以及对影子银行的监管和治理使得企业的信用状况呈现不稳定状态，经济复苏空间有限以及市场风险偏好的变化也将对信用债形成制约；从利差角度看，低等级信用债与高等级信用债利差已低至2012年利差最低点，高等级较低等级体现出更好的配置价值和流动性优势。

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，继续保持原有的可转债仓位，静待权益市场表现，保持适度杠杆，灵活调整组合久期，同时努力把握国债、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。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	99,764,726.52	2.15
	其中：股票	99,764,726.52	2.15
2	固定收益投资	4,339,640,804.70	93.32
	其中：债券	4,329,640,804.70	93.10
	资产支持证券	10,000,000.00	0.22
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	49,242,582.79	1.06
6	其他各项资产	161,857,101.82	3.48
7	合计	4,650,505,215.83	100.00

5.2 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	采掘业	-	-
C	制造业	47,505,446.52	1.72
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	47,505,446.52	1.72
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	-	-
E	建筑业	35,290,880.00	1.28
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	16,968,400.00	0.61
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	99,764,726.52	3.61

5.3 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	002663	普邦园林	1,264,000	35,290,880.00	1.28
2	600815	厦工股份	3,419,648	23,903,339.52	0.86
3	300335	迪森股份	1,180,000	16,968,400.00	0.61
4	002662	京威股份	1,908,060	16,123,107.00	0.58
5	002667	鞍重股份	300,000	7,479,000.00	0.27

注：本基金本报告期末仅持有以上股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	98,640,000.00	3.57
	其中：政策性金融债	98,640,000.00	3.57
4	企业债券	2,726,218,307.30	98.65
5	企业短期融资券	160,023,000.00	5.79
6	中期票据	560,332,000.00	20.28
7	可转债	784,427,497.40	28.38
8	其他	-	-
9	合计	4,329,640,804.70	156.66

5.5 报告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

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	113003	重工转债	2,100,970	222,240,606.60	8.04
2	110015	石化转债	1,428,120	146,967,829.20	5.32
3	1280128	12渝地产债	1,100,000	114,268,000.00	4.13
4	110013	国投转债	931,760	113,665,402.40	4.11
5	122108	11新天01	1,000,000	101,000,000.00	3.65

5.6 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	119023	侨城01	100,000	10,000,000.00	0.36

注：本基金本报告期末仅持有以上资产支持证券。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	26,782.00
2	应收证券清算款	92,924,598.08
3	应收股利	-
4	应收利息	68,905,721.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	161,857,101.82

5.8.4 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	222,240,606.60	8.04
2	110015	石化转债	146,967,829.20	5.32
3	110013	国投转债	113,665,402.40	4.11
4	110018	国电转债	90,211,123.20	3.26
5	110017	中海转债	78,303,021.60	2.83
6	110016	川投转债	27,431,447.20	0.99
7	125731	美丰转债	19,867,280.40	0.72
8	125089	深机转债	9,145,100.00	0.33
9	113002	工行转债	5,660,902.80	0.20
10	129031	巨轮转2	3,499,080.00	0.13

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600815	厦工股份	23,903,339.52	0.86	公开增发流通受限

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集的文件；
2.《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》；
3.《易方达岁丰添利债券型证券投资基金托管协议》；
4.基金管理人业务资格批件、营业执照；
5.基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一三年一月二十二日