易方达保证金收益货币市场基金

2014 第二季度 报告

2014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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月二十一日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达保证金货币
基金主代码	159001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月29日
报告期末基金份额总额	558,371,522.00份
投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	中国人民银行公布的活期存款基准利率的税后收益率,即活期存款基准利率×(1-利息税税率)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	易方达保证金货币A	易方达保证金货币B
下属两级基金的交易代码	159001	159002
报告期末下属两级基金的份额总额	349,018,875份	209,352,647份

§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(2014年4月1日-2014年6月30日)	
	易方达保证金货币A	易方达保证金货币B
1.本期已实现收益	3,998,623.12	3,450,218.44
2.本期利润	3,998,623.12	3,450,218.44
3.期末基金资产净值	349,018,875.00	209,352,647.00

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金收益分配是每月集中支付。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达保证金货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.1769%	0.0167%	0.0885%	0.0000%	1.0884%	0.0167%

易方达保证金货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.3283%	0.0167%	0.0885%	0.0000%	1.2398%	0.0167%

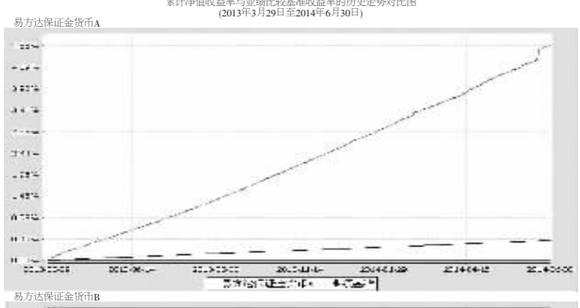
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达保证金收益货币市场基金

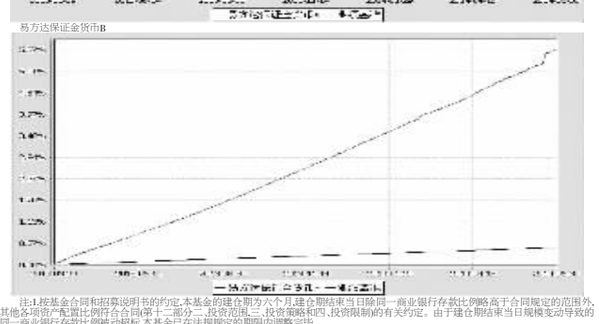
累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年3月29日至2014年6月30日)

易方达保证金货币A



易方达保证金货币B



注:1.按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束当日除同一商业银行存款比例略高于合同规定的范围外,其他各项资产配置比例符合合同(第十二部分二、投资范围二、投资策略和四、投资限制)的有关约定。由于建仓期结束当日规模变动导致的同一商业银行存款比例被动超标,本基金已在法规规定的期限内调整完毕。

2.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为4.8781%,B类基金份额净值收益率为5.6741%,同期业绩比较基准收益率为0.4463%。

§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		
王晓晨	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,易方达信用债券型证券投资基金的基金经理,易方达资产管理(香港)有限公司基金经理,固定收益总部总经助理	2013-04-22	-	11年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管。
石大怿	本基金的基金经理,易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理,易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理,易方达天天利理财货币市场基金的基金经理,易方达货币市场基金的基金经理,易方达天天增利货币市场基金的基金经理,易方达月月盈利债券市场基金的基金经理,易方达天天增利货币市场基金的基金经理,易方达月月利理财货币市场基金的基金经理,易方达月月盈利债券市场基金的基金经理	2013-04-22	-	5年	硕士研究生,曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。

注:1.此处的"任职日期"和"离任日期"分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

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,以及强化事后监控分析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,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4次,为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

2014年二季度国内经济有所企稳,但是总体仍然处于较弱的状态,5月工业增加值同比增长8.8%,月度环比由1%升至9.6%。5月消费同比增长12.5%,月度环比由11.8%升至18.9%,同样有所企稳。投资增速水平仍较低,从结构上看,房地产投资和制造业投资增速大幅下滑,而基建投资增速大幅上升,这可能意味着经济在上半年的投资意愿明显下滑。5月率则后的出口数据有所增长,但是幅度非常微弱,并不足以拉动经济增长。通胀水平有所上升,但总体水平温和,变动不大。由于美外融资的下降,社会融资总量的环比增速比美内贷款增速更为平稳,没有出现明显回升。海外方面,一季度受到严寒天气和企业补库库存的影响而表现不佳的美国经济,在二季度恢复增长;欧洲经济在二季度则再现衰退。

经济基本面较弱的态势为二季度的债券市场提供了支撑,市场利率在二季度配置债券的热情仍然较高。二季度的货币政策较为宽松公开市场操作在五、六月推行了净投放,除此之外,央行在四、五月两度实施了定向下调准备金率的政策。除了六月IPO重启导致市场资金面出现了短期的紧张和六月底资金利率季节性上行之外,整个二季度,银行间市场资金面延续了一季度宽松的态势。债券市场在二季度延续了一季度的牛市,市场收益率继续下行,1年期政策性金融债和AAA级短融的收益率在二季度下行50bp,收益率曲线维持较为陡峭的形态。

报告期内基金的运作仍以保持组合较高的流动性为首要任务,二季度基金的规模波动较大,我们顺动配置短期逆回购,维持了债券较高的配置比例,保证了组合较高的流动性。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金本报告期内A类基金份额净值收益率为1.1769%;B类基金份额净值收益率为1.3283%;同期业绩比较基准收益率为0.0885%。

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2014年三季度,国内经济短期可能维持弱势。正面因素是:国际经济的风险继续下降,特别是美国经济可能会超预期复苏;短期内人民币的贬值将有利于出口的增长;而随着改革的不断深入,改革红利的释放将使经济结构和增长模式发生转变。但短期内,国内私人部门扩张投资的意愿能否恢复仍是经济能否复苏的关键。国务院持续出台了微刺激政策,但仍坚持不采取总量刺激政策的基本态度,并仍强调不会采取大规模的刺激政策。

央行有望在三季度保持宽松的资金面,但态度可能仍较为保守。货币政策宽松的大门已经打开,但央行的态度限制了市场对未来货币政策和资金面进一步宽松的预期。整体来看,政策是否进一步宽松只根结底仍需要看经济形势的变化,但是资金面维持宽松相对是比较确定的。

综上所述,目前我们对债券市场持中性的态度,但是对资金面能够维持较宽松保持乐观。本基金将继续保持组合较高的流动性,以信用债券、金融债、短期逆回购为主要投资对象,在保证资产流动性的前提下提高组合收益。

基金管理人将坚持规范运作、审慎投资,勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

§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	固定收益投资	439,715,512.68	77.12
	其中:债券	439,715,512.68	77.12
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	119,000,259.50	20.87
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,422,375.99	0.42
4	其他资产	9,009,924.71	1.58
5	合计	570,148,072.88	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2.33
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	9,999,865.00	1.79
	其中:买断式回购融资	-	-

注:1.表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	90
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	121
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2014-04-15	121	本货币基金被赎回,规模下降导致组合剩余期限被动超标	发生日后1个交易日

注:本基金合同约定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天"。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	43.24	1.81
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	17.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	8.84	-
4	90天(含)-180天	16.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	19.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.50	1.81

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	摊余成本(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	269,056,367.23	48.19
	其中:政策性金融债	269,056,367.23	48.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	170,659,145.45	30.56
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	439,715,512.68	78.75
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	49,337,271.66	8.84

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130227	13国开27	800,000	79,982,481.24	14.32
2	140410	14农发10	500,000	50,143,880.07	8.98
3	140316	14进出16	500,000	49,566,130.20	8.88
4	110212	11国开12	500,000	49,337,271.66	8.84
5	130232	13国开32	400,000	40,026,604.06	7.17
6	041356041	13蒙高路CP001	300,000	30,209,743.24	5.41
7	041453018	14昆明CP001	300,000	30,209,624.82	5.41
8	041356049	13川高速CP002	300,000	30,156,908.09	5.40
9	041358093	13隧桥CP003	300,000	30,068,946.10	5.39
10	041453023	14攀钢CP001	300,000	29,988,090.13	5.37

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	48次
报告期内偏离度的最高值	0.4430%
报告期内偏离度的最低值	0.0470%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2978%

5.7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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1基金投资的前五名证券发行主体本期没有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。

5.8.3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。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,009,924.71
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,009,924.71

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达保证金货币A	易方达保证金货币B
报告期期初基金份额总额	253,166,294	226,605,060
报告期基金总申购份额	3,863,928,384	3,091,603,775
报告期基金总赎回份额	3,768,075,803	3,108,856,188
报告期期末基金份额总额	349,018,875	209,352,647

注:总申购份额含因份额升降级等导致的强制调增份额,总赎回份额含因份额升降级等导致的强制调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准易方达保证金收益货币市场基金募集的文件;

2、《易方达保证金收益货币市场基金基金合同》;

3、《易方达保证金收益货币市场基金托管协议》;

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。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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

二〇一四年七月二十一日

易方达岁丰添利债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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
报告送出日期:二〇一四年七月二十一日

§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2014年7月16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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	场外:易方达岁丰添利债券(LOF)A;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	393,177,759.13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,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(2014年4月1日-2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,920,100.55
2.本期利润	9,462,840.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0234
4.期末基金资产净值	394,882,756.90
5.期末基金份额净值	1.004

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 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	2.45%	0.27%	1.36%	0.01%	1.09%	0.26%

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2014年6月30日)

注:1.按基金合同和招募说明书的约定,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(第十五部分(二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制)的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为15.47%,同期业绩比较基准收益率为20.67%。

§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		
刘琦	本基金的基金经理,易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理,易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理,易方达资产管理(香港)有限公司基金经理	2013-04-02	-	6年	博士研究生,曾任嘉实基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理,嘉实国际资产管理有限公司助理副总裁,易方达基金管理有限公司固定收益投资部投资经理。

注:1.此处的"任职日期"和"离任日期"分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

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,以及强化事后监控分析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,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2次,为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

2014年二季度,宏观经济下行趋势放缓,部分数据均呈现经济增速有所企稳。地产投资增速出现加速下滑,但政府的基建投资增长有所对冲,固定资产投资下降幅度较小,显示政府稳增长措施效果的同时预期,股票市场在4月上旬小幅反弹,也带动转债市场上涨,随后回在悲观的基本面预期下回落,市场总体呈现窄幅震荡的格局。转债市场则在债券市场收益率大幅下降之后,走出估值修复行情,整体表现强于正股。

本基金在二季度操作总体谨慎,偏向保守。小幅增持部分短久期城投品种,维持了较低的债券久期和组合杠杆,以获取持有期收益为主要目标。转债仓位也维持在较低的水平,以规避市场风险为主,并通过波段操作获取部分品种的结构性机会。

短久期及适度杠杆水平,获取一定持有期收益。具体品种方面,国债、金融债等利率品种因经济政策继续强调稳增长、经济软着陆概率加大,有调整风险,短期限偏高收益率信用债具有一定配置价值,大盘可转债估值偏低,可能受益于利率水平的回落,以及经济软着陆,具有一定配置价值。

易方达岁丰添利基金下一阶段的操作将采取积极稳健的投资策略,灵活调整组合,维持适度中等久期,保持较高流动性资产,维持适度偏高的持有到期收益率,努力把握国债、金融债、信用债,以及可转换债券在不同市场环境下的阶段性机会,力争以理想稳健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	3,744,430.00	0.57
	其中:股票	3,744,430.00	0.57
2	固定收益投资	611,501,575.28	93.11
	其中:债券	601,680,339.66	91.61
	资产支持证券	9,821,235.62	1.50
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	26,061,085.94	3.97
7	其他资产	15,445,572.33	2.35
8	合计	656,752,663.55	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	采矿业	-	-
C	制造业	8,530.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,735,900.00	0.95
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
	合计	3,744,430.00	0.95

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	300335	迪森股份	315,000	3,735,900.00	0.95
2	002726	龙大肉食	500	8,530.00	0.00

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	30,006,000.00	7.60
	其中:政策性金融债	30,006,000.00	7.60
4	企业债券	339,099,297.09	85.87
5	企业短期融资券	20,170,000.00	5.11
6	中期票据	88,929,000.00	22.52
7	可转债	123,476,042.57	31.27
8	其他	-	-
9	合计	601,680,339.66	152.37

5.5 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	1380232	13滨州债	300,000	30,300,000.00	7.67
2	110023	民生转债	325,000	30,160,000.00	7.64
3	1480349	14合肥滨投债	300,000	30,141,000.00	7.63
4	130236	13国开36	300,000	30,006,000.00	7.60
5	110025	国金转债	259,250	29,761,900.00	7.54

5.6 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

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	119024	侨城02	100,000	9,821,235.62	2.49

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	49,136.37
2	应收证券清算款	3,006,285.22
3	应收股利	-
4	应收利息	12,359,407.60
5	应收申购款	496.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.11
8	其他	-
9	合计	15,445,572.33

5.11.4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	110023	民生转债	30,160,000.00	7.64
2	110022	同仁转债	18,185,276.20	4.61
3	110015	石化转债	16,951,290.00	4.29
4	110024	隧道转债	12,509,926.00	3.17
5	113005	平安转债	7,263,760.00	1.84
6	113003	重工转债	3,721,361.20	0.94
7	110018	国电转债	2,768,670.80	0.70

5.11.5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

报告期期初基金份额总额	450,253,145.92
报告期基金总申购份额	30,310,884.88
减:报告期基金总赎回份额	87,386,271.67
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	393,177,759.13

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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

二〇一四年七月二十一日

易方达双债增强债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年七月二十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月16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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达双债增强债券
基金主代码	110035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月1日
报告期末基金份额总额	87,668,529.64份
投资目标	本基金主要投资于信用债、可转债等固定收益品种,通过积极主动的投资管理,力争为投资者提供持续稳定的回报。
投资策略	本基金根据对基本面因素的分析,以及对不同资产的风险收益特征及相关关系进行研究,确定大类资产配置比例;通过对信贷水平、信用利差水平、信用债市场供求关系等因素进行分析,进行信用债投资;通过对转股溢价率、隐含波动率、对应正股的市场走势、供求关系等因素进行分析,投资可转债;综合考虑组合收益、利率风险以及流动性,投资于利率品种;综合考虑新股估值水平、中签率、上市后的平均涨幅等因素,决定新股申购投资。
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率*40%+天相可转债指数收益率*40%+中债国债总全价指数收益率*20%
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。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	易方达双债增强债券A	易方达双债增强债券C
下属两级基金的交易代码	110035	110036
报告期末下属两级基金的份额总额	56,958,925.42份	30,709,604.22份

§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(2014年4月1日-2014年6月30日)	
	易方达双债增强债券A	易方达双债增强债券C
1.本期已实现收益	1