易方达岁丰添利债券型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014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
送出日期:二〇一五年三月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2015年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达岁丰添利债券(LOF)
场内简称	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
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
报告期末基金份额总额	148,375,848.71份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年12月3日

2.2 基金产品说明

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)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)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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	王永民
	联系电话	020-38797888	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38799488	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦43楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	70,698,131.90	74,723,499.65	200,775,921.16
本期利润	108,581,195.69	18,663,116.04	244,148,640.73
加权平均基金份额本期利润	0.2743	0.0077	0.0911
本期基金份额净值增长率	52.53%	-0.30%	9.37%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.3414	-0.0312	0.0169
期末基金资产净值	219,256,939.17	789,221,921.78	2,763,648,378.71
期末基金份额净值	1.478	0.969	1.032

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。

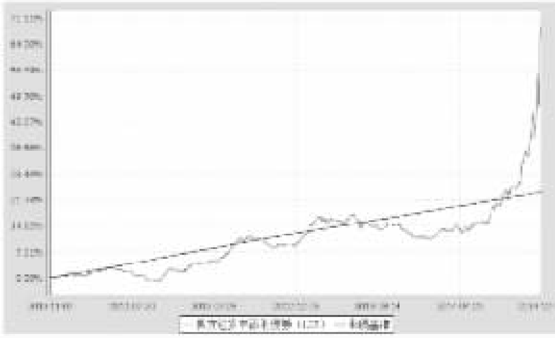
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	36.10%	1.59%	1.35%	0.02%	34.75%	1.57%
过去六个月	47.21%	1.15%	2.72%	0.01%	44.49%	1.14%
过去一年	52.53%	0.85%	5.42%	0.02%	47.11%	0.83%
过去三年	66.31%	0.53%	16.68%	0.02%	49.63%	0.51%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	69.98%	0.46%	23.39%	0.02%	46.59%	0.44%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

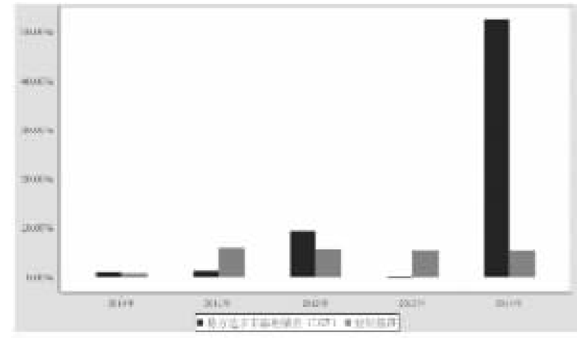
易方达岁丰添利债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年11月9日至2014年12月31日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为69.98%,同期业绩比较基准收益率为23.39%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达岁丰添利债券型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注:本基金合同生效日为2010年11月9日,合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014年	-	-	-	-	-
2013年	0.620	166,105,126.13	-	166,105,126.13	-
2012年	0.670	179,500,698.38	-	179,500,698.38	-
合计	1.290	345,605,824.51	-	345,605,824.51	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,本基金管理人于2001年4月17日成立,注册资本1.2亿元,旗下设有北京、广州、上海、南京、成都分公司和香港子公司、资产管理子公司。本基金管理人秉承"取信于市场,取信于社会"的宗旨,坚持"在诚信规范的前提下,通过专业化运作和团队合作实现持续稳健增长"的经营理念,以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩,赢得市场认可。2004年10月,本基金管理人取得全国社会保障基金投资管理人资格;2005年8月,获得企业年金基金投资管理人资格;2007年12月,获得合格境内机构投资者(QDII)资格;2008年2月,获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2014年12月31日,本基金管理人旗下共管理59只开放式基金、1只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务,资产管理总规模达4300亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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。
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(自2008年3月19日至2014年1月17日)、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理(自2011年6月21日至2014年1月17日)、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理(自2013年8月23日至2014年1月17日)	2010-11-09	2014-01-18	14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、固定收益总部总经理、固定收益投资部总经理。

注:1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期,钟鸣远的"任职日期"为基金合同生效之日,刘琦的"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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》,内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合,围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易(含银行间市场)等投资管理活动,贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括:集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括:通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会;投资人员应公平对待其管理的不同投资组合,控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差;建立集中交易制度,交易系统具备公平交易功能,对于满足公平交易执行条件的同向指令,系统将自动启用公平交易功能,按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行;根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制,通过系统与人工控制相结合的方式,力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待;建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制,对于发现的异常问题要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间(纯被动指数组合和量化投资组合除外)确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易,投资人员须提供充分的投资决策依据,并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制,并借助相关技术系统,使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况,持续督促公平交易制度的落实执行,并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司投资风险管理部与监察部合作,利用统计分析的方法和工具,按照不同的时间窗口(包括当日内、3日内、5日内),对我司旗下所有投资组合2014年度的同向交易价差情况进行了分析,包括旗下各大类资产组合之间(即公募、社保、年金、专户四大类业务之间)的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

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13次,其中12次为旗下指数基金因投资策略需要而和其他组合发生反向交易,1次为不同基金经理管理的非指数基金间因投资策略不同而发生的反向交易,该次交易基金经理已提供决策依据,并履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年,中国经济增速下滑,增长动力趋缓,二季度表现略好于一季度,主要宏观指标总体下滑,一季度经济增速下滑风险偏大,二季度经济增速稳中趋缓。宏观调控政策总体灵活调整,稳中有进。一季度货币信贷政策维持稳健,宏观调控政策逐步更强调把经济运行保持在合理区间,并提早于市场预期推出促改革、调结构、惠民生的定向刺激政策,推动经济稳定发展。二季度,宏观调控稳中求进,改革创新,在坚持稳健货币政策和积极财政政策的前提下,积极推出并加大定向宽松政策,改善货币信贷条件,加大棚户区改造、基建投资力度。

2014年下半年,国内经济增速稍有企稳后又继续下滑,主要宏观指标波动加大。三季度,主要宏观经济数据先上后下,经济下行压力较大,固定资产投资增速、出口增速和消费增速都有不同程度的回落,发电量、工业增加值增速等指标大幅低于预期;通胀水平低于预期。宏观调控当局加大力度推进促改革、调结构、惠民生的定向刺激政策,稳定经济发展。四季度,国内经济增速继续下滑,主要宏观指标总体继续趋缓。宏观调控稳中求进、改革创新,改变以往定向宽松政策,进行降息,货币信贷条件进一步改善。宏观调控当局经历两年经济下行波动及区间调控、定向刺激等有效调控后,积累了大量经验,政策储备充足,平衡能力更强;下半年政策相对上半年也有所调整,积极改善货币信贷条件,降低社会融资成本,同时也推进利率市场化等金融改革,厘清金融市场秩序。

本期内,资金面总体稳定,相对2013年较为宽松。人民币汇率双向波动加大,贸易顺差保持较高水平,然而金融机构外汇占款偏少,资金流入不明显,货币当局通过公开市场及其他创新工具释放基础货币。银行间隔夜回购利率平均在3%附近,7天回购利率平均在4%以下。本期内,债券和权益类资产均表现好,市场综合性债券指数上涨幅度超过10%,市场综合性股票指数上涨50%左右。

本期内,基金根据对经济走势、政策以及资金面的变化判断,灵活调整组合资产配置。上半年,基于对经济增速有望延续去年四季度以来的回落,货币信贷政策有望加大定向宽松,以及资金面维持中性偏宽松的判断,对债券和可转债投资保持谨慎乐观,维持适度偏高杠杆水平,增持信用资质较好的高收益债券,对可转债适度进行波段操作。下半年,基于对经济下行压力偏大,货币信贷政策有望进一步加大宽松,及资金面维持偏宽松判断,对债券和可转债投资保持乐观,维持偏高杠杆水平,积极对大盘可转债进行波段操作。

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1.478元,本报告期份额净值增长率为52.53%,同期业绩比较基准收益率为5.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年经济与投资环境,中国经济增长逐步趋缓,总体形势依旧较为复杂,经济下行压力依旧较大,但是经济增速失速概率很小。货币信贷宽松政策进一步加大,改革继续积极推进,房地产刺激政策效果逐步体现,物价压力不大,金融运行总体平稳,有利经济增长。制造业仍旧有去产能压力,房地产持续回暖,基建投资继续回升,经济短周期反弹动力增强。2014年四季度以来,经济下行压力仍旧较强,宏观调控当局逐步改变定向宽松为全面宽松基调,进行降息,加大货币信贷宽松力度,降低社会融资成本,加快审批开工一大批重点项目,大幅增加基建投资,降低按揭贷款利率,放松房贷政策,刺激房地产市场。国际经济方面,发达经济体总体稳固,美国经济增长积极,就业市场继续改善,物价压力较小,美联储量化宽松政策如期退出,市场预计加息时点尚在今年年中以后,短期对市场冲击小。欧元区经济下行压力较大,通缩压力较大,欧洲央行推出量化宽松政策,刺激通胀预期。新兴经济体较为复杂,分化明显,但乐观迹象增多。总体上,2015年,国内经济形势依旧复杂,政策宽松,改革积极推进,国际形势总体稳固,政策波动风险增大。

2015年银行间资金面状况预计将继续维持弱平衡,资金利率处于相对低位,通胀预期偏低,固定资产投资增速有望逐步企稳,出口继续保持一定增速,房地产市场有望出现一定改善,对经济下行的负面效应逐步减弱甚至消失,政策保持相对宽松,防范系统性金融风险,债券市场有望继续获得正收益,信用债收益率相对资金水平偏高,信用利差回到了2012年高位,具有一定配置价值。组合在债券投资上,将继续保持中等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、金融债等利率债品种收益率因经济政策继续强调稳增长,通胀偏低,可能维持振荡,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,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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,公司营运总监担任估值委员会主席,研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对易方达岁丰添利债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2014年12月31日的资产负债表、2014年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:易方达岁丰添利债券型证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	763,376.59	317,459,866.61
结算备付金	7,786,160.47	29,302,159.50
存出保证金	130,625.41	711,225.98
交易性金融资产	337,006,620.39	677,004,754.92
其中:股票投资	23,535,811.62	7,814,400.00
基金投资	-	-
债券投资	313,470,808.77	663,628,754.92
资产支持证券投资	-	5,561,600.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	8,000,000.00
应收证券清算款	18,037,705.97	25,178,598.26
应收利息	5,205,260.98	18,438,361.25
应收股利	-	-
应收申购款	7,253,807.84	992.06
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	376,183,557.65	1,076,095,958.58
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	135,399,445.60	281,798,629.25
应付证券清算款	16,931,779.31	-
应付赎回款	1,211,693.72	1,176,300.18
应付管理人报酬	126,176.35	493,786.27
应付托管费	36,050.41	141,081.79
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	39,187.83	186,524.23
应交税费	2,658,994.90	2,658,994.90
应付利息	162,834.59	28,165.82
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,455.77	390,554.36
负债合计	156,926,618.48	286,874,036.80
所有者权益:		
实收基金	148,375,848.71	814,597,604.22
未分配利润	70,881,090.46	-25,375,682.44
所有者权益合计	219,256,939.17	789,221,921.78
负债和所有者权益总计	376,183,557.65	1,076,095,958.58

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.478元,基金份额总额148,375,848.71份。

7.2 利润表

会计主体:易方达岁丰添利债券型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	122,235,616.50	92,314,208.28
1.利息收入	28,791,940.66	145,569,381.24
其中:存款利息收入	3,201,093.69	12,601,936.59
债券利息收入	25,079,664.64	129,635,314.28
资产支持证券利息收入	338,412.42	750,879.89
买入返售金融资产收入	172,769.91	2,581,250.48
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	55,382,542.00	2,369,276.12
其中:股票投资收益	5,933,095.49	-1,417,092.66
基金投资收益	-	-
债券投资收益	49,172,751.65	3,456,730.30
资产支持证券投资收益	246,769.86	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	29,925.00	329,638.48
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	37,883,063.79	-56,060,383.61
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	178,070.05	435,934.53
减:二、费用	13,654,420.81	73,651,092.24
1.管理人报酬	2,845,103.29	17,358,371.87
2.托管费	812,886.71	4,959,534.78
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	93,135.31	796,254.88
5.利息支出	9,404,658.17	49,499,138.58
其中:卖出回购金融资产支出	9,404,658.17	49,499,138.58
6.其他费用	498,637.33	1,037,792.13
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	108,581,195.69	18,663,116.04
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	108,581,195.69	18,663,116.04

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达岁丰添利债券型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	814,597,604.22	-25,375,682.44	789,221,921.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	108,581,195.69	108,581,195.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-666,221,755.51	-12,324,422.79	-678,546,178.30
其中:1.基金申购款	97,060,331.91	10,975,752.01	108,036,083.92
2.基金赎回款	-763,282,087.42	-23,300,174.80	-786,582,262.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	148,375,848.71	70,881,090.46	219,256,939.17
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,679,114,943.70	84,533,435.01	2,763,648,378.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,663,116.04	18,663,116.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,864,517,339.48	37,532,892.64	-1,826,984,446.84
其中:1.基金申购款	55,378.07	-1,097.68	54,280.39
2.基金赎回款	-1,864,572,717.55	37,533,990.32	-1,827,038,727.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-166,105,126.13	-166,105,126.13
五、期末所有者权益(基金净值)	814,597,604.22	-25,375,682.44	789,221,921.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:叶俊英,主管会计工作负责人:张优造,会计机构负责人:陈荣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达岁丰添利债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2010]第1358号《关于核准易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集的批复》核准,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》于2010年11月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,679,114,943.70份基金份额,其中认购资金利息折合328,024.37份基金份额。本基金为契约型基金,基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期,封闭期结束后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司(以下简称"粤财信托")	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,845,103.29	17,358,371.87
其中:支付销售机构的客户维护费	156,772.99	488,832.39

注:基金管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.7%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人于次月首日起5个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	812,886.71	4,959,534.78

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人于次月首日起5个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	10,282,662.05	-	-	251,520,000.00	119,236.60
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	110,820,183.80	-	-	282,870,000.00	121,410.02

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年12月31日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发期货有限公司	6,000,540.00	4.04%	20,001,800.00	2.46%

注:除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。广发期货有限公司是基金管理人股东广发证券控制的机构。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	763,376.59	57,513.64	7,459,866.61	370,733.39

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券	1480455	14玉溪开投债	分销	200,000	20,000,000.00
广发证券	1480480	14揭城投债	分销	200,000	20,000,000.00
广发证券	002731	萃华珠宝	新股网上发行	1,000	11,920.00
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券	112177	13围海债	分销	45,000	4,500,000.00
广发证券	1382239	13文峰MTN2	分销	200,000	20,000,000.00
广发证券	1382252	13中条山MTN1	分销	200,000	19,980,000.00

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额69,399,455.90元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1382186	13满世煤MTN1	2015-01-07	99.85	300,000	29,955,000.00
120301	12进出01	2015-01-15	99.91	200,000	19,982,000.00
1380162	13金霞债	2015-01-15	100.56	100,000	10,056,000.00
1382252	13中条山MTN1	2015-01-19	99.47	200,000	19,894,000.00
合计				800,000	79,887,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额65,999,989.70元,于2015年1月5日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

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)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为192,362,870.39元,属于第二层次的余额为144,643,750.00元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次385,179,654.92元,第二层次291,825,100.00元,无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(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很小。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

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	23,535,811.62	6.26
	其中:股票	23,535,811.62	6.26
2	固定收益投资	313,470,808.77	83.33
	其中:债券	313,470,808.77	83.33
	资产支持证券	-	-
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	8,549,537.06	2.27
7	其他各项资产	30,627,400.20	8.14
8	合计	376,183,557.65	100.00

8.2 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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	23,535,811.62	10.73
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	23,535,811.62	10.73

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600109	国金证券	1,189,278	23,535,811.62	10.73

注:本报告期末本基金投资国金证券(600109)占基金资产净值超过10%,属于被动超标。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600109	国金证券	31,080,191.04	3.94
2	601989	中国重工	6,164,436.00	0.78
3	600820	隧道股份	3,910,823.88	0.50
4	600674	川投能源	3,546,908.59	0.45
5	002714	牧原股份	24,070.00	0.00
6	300383	光环新网	19,150.00	0.00
7	300397	天和防务	12,025.00	0.00
8	002731	萃华珠宝	11,920.00	0.00
9	002713	东易日盛	10,500.00	0.00
10	601969	海南矿业	10,340.00	0.00
11	300375	鹏翎股份	9,790.00	0.00
12	300389	艾比森	9,215.00	0.00
13	002711	欧浦钢网	9,145.00	0.00
14	002725	跃岭股份	7,680.00	0.00
15	002716	金贵银业	7,175.00	0.00
16	002709	天赐材料	6,830.00	0.00
17	601015	陕西黑猫	6,150.00	0.00
18	300388	国祯环保	6,070.00	0.00
19	603019	中科曙光	5,290.00	0.00
20	002726	龙大肉食	4,895.00	0.00

注:买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300335	迪森股份	8,492,025.63	1.08
2	600109	国金证券	7,756,658.15	0.98
3	601989	中国重工	6,193,971.80	0.78
4	600674	川投能源	4,698,312.26	0.60
5	600820	隧道股份	3,936,951.12	0.50
6	300397	天和防务	57,825.00	0.01
7	603019	中科曙光	52,320.00	0.01
8	002731	萃华珠宝	42,900.00	0.01
9	002714	牧原股份	37,600.00	0.00
10	300383	光环新网	33,375.00	0.00
11	300389	艾比森	30,415.00	0.00
12	002713	东易日盛	20,125.00	0.00
13	601969	海南矿业	20,000.00	0.00
14	601015	陕西黑猫	18,900.00	0.00
15	300388	国祯环保	15,530.00	0.00
16	300375	鹏翎股份	14,100.00	0.00
17	002711	欧浦钢网	13,170.00	0.00
18	002726	龙大肉食	12,855.00	0.00
19	002716	金贵银业	10,335.00	0.00
20	002709	天赐材料	9,915.00	0.00

注:卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	44,865,854.51
卖出股票收入(成交)总额	31,485,958.96

注:"买入股票成本"或"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 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	央行票据	-	-
3	金融债券	19,993,000.00	9.12
	其中:政策性金融债	9,991,000.00	4.56
4	企业债券	93,718,716.00	42.74
5	企业短期融资券	50,044,000.00	22.82
6	中期票据	49,849,000.00	22.74
7	可转债	99,866,092.77	45.55
8	其他	-	-
9	合计	313,470,808.77	142.97

8.6 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	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1382186	13满世煤MTN1	300,000	29,955,000.00	13.66
2	041453109	14深航空CP001	300,000	29,922,000.00	13.65
3	110023	民生转债	157,000	21,708,390.00	9.90
4	041461027	14金元CP003	200,000	20,122,000.00	9.18
5	1382252	13中条山MTN1	200,000	19,894,000.00	9.07

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	130,625.41
2	应收证券清算款	18,037,705.97
3	应收股利	-
4	应收利息	5,205,260.98
5	应收申购款	7,253,807.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,627,400.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	110023	民生转债	21,708,390.00	9.90
2	113005	平安转债	15,402,455.40	7.02
3	127002	徐工转债	14,685,157.97	6.70
4	110020	南山转债	13,995,902.50	6.38
5	113002	工行转债	10,890,870.00	4.97
6	113006	深燃转债	4,387,336.20	2.00

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,992	74,485.87	96,774,939.21	65.22%	51,600,909.50	34.78%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国通用技术(集团)控股有限责任公司	32,091,557.00	52.20%
2	广东省粤电集团有限公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	7,732,516.00	12.58%
3	红塔烟草(集团)有限责任公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	3,639,100.00	5.92%
4	中国医药集团总公司企业年金计划-中国光大银行股份有限公司	2,700,000.00	4.39%
5	重庆市邮政公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	1,828,900.00	2.97%
6	成都农村商业银行股份有限公司企业年金计划-中国民生银行股份有限公司	1,800,000.00	2.93%
7	光大资管-民生银行-光大阳光北斗星2号集合资产管理计划	1,580,000.00	2.57%
8	太平人寿保险有限公司-投连-银保	1,090,000.00	1.77%
9	南方基金管理有限公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	1,000,000.00	1.63%
10	鲍凤仙	585,431.00	0.95%

注:本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	278.24	0.0002%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2010年11月9日)基金份额总额	2,679,114,943.70
本报告期期初基金份额总额	814,597,604.22
本报告期基金总申购份额	97,060,331.91
减:本报告期基金总赎回份额	763,282,087.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	148,375,848.71

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任中国银行股份有限公司行长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续5年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为60,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	22,686,173.33	72.05%	20,653.83	72.05%	-
平安证券	1	8,799,785.63	27.95%	8,011.41	27.95%	-

注:a) 本报告期内本基金无新增和减少交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下:

1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	2,766,519,408.67	86.28%	27,063,500,000.00	81.13%	-	-
平安证券	440,088,038.75	13.72%	6,294,727,000.00	18.87%	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

易方达基金管理有限公司
二〇一五年三月二十七日