

易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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：中国建设银行股份有限公司
报告截止日期：二〇一六年一月二十二日

81 重要提示
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在投资本基金前应仔细阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件。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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在投资本基金前应仔细阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件。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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在投资本基金前应仔细阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件。

基金简称	易方达纯债1年定期开放债券
基金代码	000111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月30日
报告期末基金份额总额	896,883,243.66元
投资目标	本基金投资于具有良好流动性的固定收益类资产，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下的投资策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。本基金采取自上而下的投资策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币型基金。
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
下属分级基金名称	易方达纯债1年定期开放债券A
下属分级基金代码	000111
报告期末下属分级基金的资产总额	801,927,014.74元

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期末	2015年10月1日-2015年12月31日	单位:人民币元			
1.本期利润总额	16,407,484.73	1,863,314.74				
2.本期净利润	18,298,486.78	2,085,172.17				
3.归属于母基金的本期利润	18,298,486.78	2,085,172.17				
4.期末基金资产净值	917,910,519.50	108,409,408.35				
5.期末基金份额净值	1.135	1.138				
注:1.上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可能会低于上述指标。 注:2.上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可能会低于上述指标。						
3.2 基金净值表现						
3.2.1 报告期内基金份额净值及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
易方达纯债1年定期开放债券A						
阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	2.05%	0.06%	0.65%	0.01%	1.40%	0.04%
易方达纯债1年定期开放债券C						
阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	1.97%	0.06%	0.65%	0.01%	1.32%	0.05%
3.2.2 自基金合同生效以来本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						
易方达纯债1年定期开放债券A						
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率③	①-③			
过去三个月	1.97%	0.65%	1.32%			
易方达纯债1年定期开放债券C						
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率③	①-③			
过去三个月	1.97%	0.65%	1.32%			

3.3 基金投资组合分析

3.3.1 报告期末按行业分类的股票投资组合		
行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1. 医药生物	109,740,000.00	10.70
2. 金融行业	20,330,000.00	1.98
3. 公用事业	20,330,000.00	1.98
4. 食品饮料	1,044,551,568.22	101.81
5. 企业短期债券	341,229,000.00	33.26
6. 中期票据	296,238,000.00	28.87
7. 其他资产	-	-
8. 持有待售资产	-	-
9. 其他	-	-
10. 合计	1,812,088,568.22	176.63

3.3.2 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	011599102	15国债03	700,000	70,500,000.00	6.87
2	112091	11国债01	631,091	64,828,723.30	6.32
3	011564015	15国债02	500,000	51,480,000.00	5.02
4	112823	11国债03	500,000	50,445,000.00	4.92
5	011532005	15国债02	500,000	50,375,000.00	4.91

3.3.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.3.4 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

本基金本报告期末持有贵金属。

3.3.5 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权证投资明细

本基金本报告期末持有权证。

3.3.6 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持有股指期货。

3.3.7 报告期末本基金投资的国债期货情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

3.3.8 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

3.3.9 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.3.10 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	011599102	15国债03	700,000	70,500,000.00	6.87
2	112091	11国债01	631,091	64,828,723.30	6.32
3	011564015	15国债02	500,000	51,480,000.00	5.02
4	112823	11国债03	500,000	50,445,000.00	4.92
5	011532005	15国债02	500,000	50,375,000.00	4.91

3.3.11 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.3.12 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

本基金本报告期末持有贵金属。

3.3.13 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

本基金本报告期末持有权证。

3.3.14 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持有股指期货。

3.3.15 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持有国债期货。

3.3.16 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

3.3.17 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.3.18 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	011599102	15国债03	700,000	70,500,000.00	6.87
2	112091	11国债01	631,091	64,828,723.30	6.32
3	011564015	15国债02	500,000	51,480,000.00	5.02
4	112823	11国债03	500,000	50,445,000.00	4.92
5	011532005	15国债02	500,000	50,375,000.00	4.91

3.3.19 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.3.20 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

本基金本报告期末持有贵金属。

3.3.21 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

本基金本报告期末持有权证。

3.3.22 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持有股指期货。

3.3.23 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持有国债期货。

3.3.24 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

3.3.25 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.3.26 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	011599102	15国债03	700,000	70,500,000.00	6.87
2	112091	11国债01	631,091	64,828,723.30	6.32
3	011564015	15国债02	500,000	51,480,000.00	5.02
4	112823	11国债03	500,000	50,445,000.00	4.92
5	011532005	15国债02	500,000	50,375,000.00	4.91

注:1.本基金合同于2015年4月23日生效,截至报告期末本基金合同尚未满一年。

易方达纯债债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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：中国建设银行股份有限公司
报告截止日期：二〇一六年一月二十二日

81 重要提示
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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在投资本基金前应仔细阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件。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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在投资本基金前应仔细阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件。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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失。投资者在投资本基金前应仔细阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件。

基金简称	易方达纯债债券
基金代码	110007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月8日
报告期末基金份额总额	7,531,345,005.43份
投资目标	本基金投资于具有良好流动性的固定收益类资产，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采取自上而下的投资策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。本基金采取自上而下的投资策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币型基金。
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
下属分级基金名称	易方达纯债债券A
下属分级基金代码	110007
报告期末下属分级基金的资产总额	3,299,147,113.75份

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期末	2015年10月1日-2015年12月31日	单位:人民币元			
1.本期利润总额	38,917,446.04	25,585,392.64				
2.本期净利润	102,091,823.38	83,964,018.98				
3.归属于母基金的本期利润	102,091,823.38	83,964,018.98				
4.期末基金资产净值	3,667,172,367.70	4,757,140,169.62				
5.期末基金份额净值	1.125	1.125				
注:1.上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可能会低于上述指标。 注:2.上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可能会低于上述指标。						
3.2 基金净值表现						
3.2.1 报告期内基金份额净值及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
易方达纯债债券A						
阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	1.02%	0.09%	1.81%	0.08%	1.21%	0.02%
易方达纯债债券C						
阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	2.96%	0.11%	1.81%	0.08%	1.15%	0.03%
3.2.2 自基金合同生效以来本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						
易方达纯债债券A						
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率③	①-③			
过去三个月	1.02%	1.81%	0.79%			
易方达纯债债券C						
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率③	①-③			
过去三个月	2.96%	1.81%	1.15%			

3.2 基金净值表现

3.2.1 报告期内基金份额净值及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
易方达纯债债券A						
阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	1.02%	0.09%	1.81%	0.08%	1.21%	0.02%
易方达纯债债券C						
阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	2.96%	0.11%	1.81%	0.08%	1.15%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来本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

易方达纯债债券A			
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率③	①-③
过去三个月	1.02%	1.81%	0.79%
易方达纯债债券C			
阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率③	①-③
过去三个月	2.96%	1.81%	1.15%

3.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1. 医药生物	109,740,000.00	10.70
2. 金融行业	20,330,000.00	1.98
3. 公用事业	20,330,000.00	1.98
4. 食品饮料	1,044,551,568.22	101.81
5. 企业短期债券	341,229,000.00	33.26
6. 中期票据	296,238,000.00	28.87
7. 其他资产	-	-
8. 持有待售资产	-	-
9. 其他	-	-
10. 合计	1,812,088,568.22	176.63

3.2.4 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	011599102	15国债03	700,000	70,500,000.00	6.87
2	112091	11国债01	631,091	64,828,723.30	6.32
3	011564015	15国债02	500,000	51,480,000.00	5.02
4	112823	11国债03	500,000	50,445,000.00	4.92
5	011532005	15国债02	500,000	50,375,000.00	4.91

3.2.5 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末持有贵金属。

3.2.7 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权证投资明细

本基金本报告期末持有权证。

3.2.8 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持有股指期货。

3.2.9 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持有国债期货。

3.2.10 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

3.2.11 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.2.12 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	011599102	15国债03	700,000	70,500,000.00	6.87
2	112091	11国债01	631,091	64,828,723.30	6.32
3	011564015	15国债02	500,000	51,480,000.00	5.02
4	112823	11国债03	500,000	50,445,000.00	4.92
5	011532005	15国债02	500,000	50,375,000.00	4.91

3.2.13 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

本基金本报告期末持有资产支持证券。

3.2.14 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

本基金本报告期末持有贵金属。

3.2.15 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

本基金本报告期末持有权证。

3.2.16 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持有股指期货。

3.2.17 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持有国债期货。

3.2.18 报告期末本基金投资的期权投资情况说明

本基金本报告期末未持有期权。

3.2.19 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末持有资产支持证券。