

易方达增强回报债券型证券投资基金

2013第四季度报告

2013年12月31日

基金管理人:南方基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十一日

§1重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员不承担任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的真实性、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1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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未来表现。投资人投资于本基金前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告期为2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达增强回报债券
基金代码	110007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年1月10日
报告期末基金的份额总额	3,534,208,473.97份
投资目标	通过主动投资于债券品种，力争为基金份额持有人创造较高的票息收益和总回报，实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中债总指数(全价)
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
下属分级基金的名称	易方达增强回报债券A
下属分级基金的交易代码	110007
报告期末分级基金的份额总额	1,847,386,631.27份
报告期末分级基金的份额净值	1,714,742,842.10份

§3 主要财务指标

	单位:人民币元
主要财务指标	报告期(2013年10月1日-2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-9,430,473.27
2.本期利润	-60,334,761.26
3.本期可供分配的利润	-6,029.00
4.期末基金资产净值	1,987,335,261.26
5.期末基金净值	1,088

注:1.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期利润减去本期公允价值变动损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

3.2.2 基金净值增长情况

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	-2.32%	0.11%	-2.35%	0.14%	0.61%	-0.03%
易方达增强回报债券						
阶段	净值增长率①	波动率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	-2.65%	0.12%	-3.3%	0.18%	0.48%	-0.02%

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

注:1.所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本期利润为本期已实现收益加上本期利润减去本期公允价值变动损益后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

3.2.3 主要财务指标

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较
1	601633	易方达增强回报债券	400,000	16,468,000.00 元 / 1,088

序号	报告期末基金资产净值	报告期净值增长率	报告期净值增长率标准差	报告期净值增长率与业绩比较基准收益率的比较

<tbl_r cells="5" ix="2" max