

## 易方达纯债债券型证券投资基金

## [2012]第四季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司  
基金托管人:招商银行股份有限公司  
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监事会在报告中存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012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,确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 易方达纯债债券型证券投资基金

基金运作方式 约定期开放式

基金合同生效日 2012年5月3日

报告期末基金份额总额 4,384,692,966.86份

基金管理人易方达基金管理有限公司

基金托管人招商银行股份有限公司

投资目标 本基金为纯债基金,基金管理人主要通过分析影响债券市场的各类要素,对债券进行久期管理,期限结构、类属品种进行有效配置,力争为投资者提供长期稳定的回报。

投资策略 本基金通过分析影响债券市场价格的各类要素,对固定收益资产的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,力争为投资者提供长期稳定的回报。

业绩比较基准 本基金通过分析影响债券市场价格的各类要素,对固定收益资产的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,力争为投资者提供长期稳定的回报。

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水平低于混合型基金、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 招商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 易方达纯债债券A类

易方达纯债债券C类

报告期末下属分级基金的份额总额 11,00037 110038

1,589,788,743.58份 1,794,904,223.88份

§ 3 主要财务数据和净值表现

(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)

易方达纯债债券A类 易方达纯债债券C类

1.本期已实现收益 34,654,123.41 17,894,464.24

2.本期利润 44,097,913.18 23,299,277.13

3.加权平均基金份额本期利润 0.0154 0.0144

4.期末基金资产净值 2,674,094,298.74 1,848,396,914.67

5.期末基金份额净值 1.033 1.030

6.期末可供分配基金份额利润 0.4894 0.4894

7.期末基金份额净值增长率 1.40% 1.37%

8.期末基金份额净值增长率标准差 0.02% 0.02%

9.期末基金资产净值与同期业绩比较基准收益率的差额 -0.04% 0.04%

10.期末基金份额净值 1.037 1.036

11.本期基金份额变动情况 1.48% 0.05%

12.期末基金份额总额 1.48% -0.13% 0.02% 1.61% 0.03%

3.2.1 本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

1.易方达纯债债券A类:

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差

① 1.48% 0.05% 1.40% 0.02%

② -0.13% 0.02% 1.61% 0.03%

过去三个月 1.48% 0.05% 1.40% 0.02%

3.2.2 日基金额变动率以本期公募基金净值增长率减去同期业绩比较基准收益率的差额表示。

3.2.3 本基金历史净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年5月3日至2012年12月31日)

1.易方达纯债债券A类:

阶段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差

① 1.48% 0.05% 1.40% 0.02%

② -0.13% 0.02% 1.61% 0.03%

过去三个月 1.48% 0.05% 1.40% 0.02%

3.2.4 本基金历史净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年5月3日至2012年12月31日)

注:1.本基金合同于2012年5月3日生效,截至报告期末本基金尚未满一年。  
2.基金分类关于基金投资比例的约定。

④)固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%;现金或到期日在一年内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;

⑤)本基金持有的各类资产的比例不超过一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;

⑥)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑦)本基金投资于同一企业发行的中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑧)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑨)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑩)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑪)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑫)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑬)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑭)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑮)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑯)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑰)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑱)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑲)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

⑳)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉑)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉒)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉓)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉔)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉕)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉖)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉗)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉘)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉙)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉚)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉛)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉜)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉝)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉞)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉟)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;

㉟)本基金投资于同一企业发行的短期融资券、中期票据、资产支持证券、企业债、公司债等信用类债券的比例,不得超过该债券的10%;</p