易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金

2014 年度报告摘要

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
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。

基金托管人中国建设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	易方达纯债1年定期开放债券	
基金主代码	000111	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年7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	
报告期末基金份额总额	782,271,150.05份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达纯债1年定期开放债券A	易方达纯债1年定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000111	000112
报告期末下属分级基金的份额总额	543,396,759.97份	238,874,390.08份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资目标是在追求本金安全的基础上,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。封闭期内,在投资组合平均久期与封闭运作期适当匹配的基础上,本基金将密切关注宏观经济走势,采取自上而下分析方法,预测未来利率走势和收益率曲线变动情况,确定资产的最优配置比例及久期配置策略。对于信用类固定收益品种,本基金在进行信用风险评估后,积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资,并采取分散化投资策略。开放运作期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期银行定期整存整取存款利率(税后)+1%
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理论上低于股票型基金、混合型基金,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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	田曹
	联系电话	020-38797888	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-38799488	010-66275853

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7月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	易方达纯债1年定期开放债券A	易方达纯债1年定期开放债券C		易方达纯债1年定期开放债券A	易方达纯债1年定期开放债券C
本期已实现收益	48,752,556.96	17,916,054.50		17,528,823.32	5,967,706.12
本期利润	63,534,604.78	23,247,217.54		3,197,053.19	649,951.60
加权平均基金份额本期利润	0.0874	0.0839		0.0036	0.0020
本期基金份额净值增长率	8.85%	8.55%		0.40%	0.20%
3.1.2期末数据和指标	2014年末			2013年末	
	易方达纯债1年定期开放债券A	易方达纯债1年定期开放债券C		易方达纯债1年定期开放债券A	易方达纯债1年定期开放债券C
期末可供分配基金份额利润	0.0390	0.0367		0.0036	0.0020
期末基金资产净值	565,659,442.57	248,100,776.06		885,611,398.55	328,273,520.18
期末基金份额净值	1.041	1.039		1.004	1.002

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.本基金合同于2013年7月30日生效,合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

易方达纯债1年定期开放债券A

3.1.1期间数据和指标	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	1.96%	0.14%	0.99%	0.01%	0.97%	0.13%
过去六个月	3.99%	0.10%	2.02%	0.01%	1.97%	0.09%
过去一年	8.85%	0.08%	4.03%	0.01%	4.82%	0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	9.29%	0.08%	5.75%	0.01%	3.54%	0.07%

易方达纯债1年定期开放债券C

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	1.96%	0.13%	0.99%	0.01%	0.97%	0.12%
过去六个月	3.79%	0.10%	2.02%	0.01%	1.77%	0.09%
过去一年	8.55%	0.08%	4.03%	0.01%	4.52%	0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.77%	0.08%	5.75%	0.01%	3.02%	0.07%

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

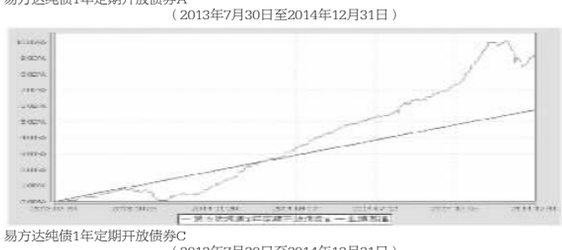
易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金

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

(2013年7月30日至2014年12月31日)

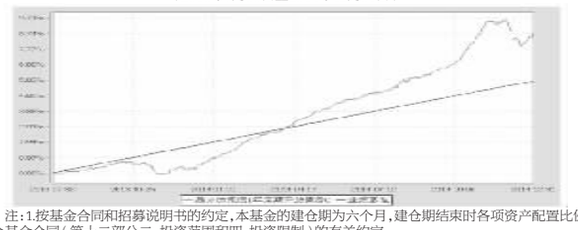
易方达纯债1年定期开放债券A

(2013年7月30日至2014年12月31日)



易方达纯债1年定期开放债券C

(2013年7月30日至2014年12月31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(第十二部分二、投资范围和四、投资限制)的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为9.29%,C类基金份额净值增长率为8.77%,同期业绩比较基准收益率为5.75%。

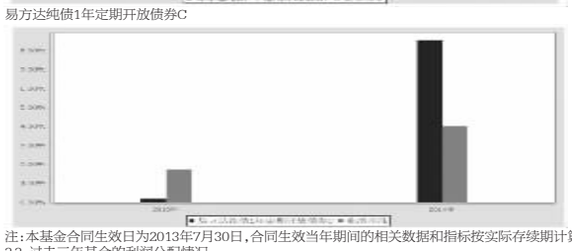
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达纯债1年定期开放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

易方达纯债1年定期开放债券A

易方达纯债1年定期开放债券C



注:本基金合同生效日为2013年7月30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

1、易方达纯债1年定期开放债券A

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	0.500	42,607,487.38	-	42,607,487.38	-
2013年7月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	-	-	-	-	-
合计	0.500	42,607,487.38	-	42,607,487.38	-

2、易方达纯债1年定期开放债券C

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	0.470	14,068,081.67	-	14,068,081.67	-
2013年7月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	-	-	-	-	-
合计	0.470	14,068,081.67	-	14,068,081.67	-

§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

单位:人民币元

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		
胡剑	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、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理(自2012年11月8日至2014年3月28日)、固定收益总部总经理助理	2013-07-30	-	8年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼任债券研究员、固定收益研究部负责人。

注:1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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。

3.根据2015年3月14日《易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告》,自2015年3月14日起胡剑先生不再担任本基金的基金经理,由李一硕先生任本基金的基金经理。

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

走过2014年,我国债券市场经历了很多新的变化。年初开始,央行货币政策较2013年下半年就已经开始出现了微妙转向,随后定向降准、SLO、SLF及MLF等各类货币政策工具陆续出台。在意图降低社会融资成本的大背景下,央行向市场释放流动性的货币政策思路贯穿全年。11月存贷款基准利率的下调更是出乎市场意料。全年来看,银行间市场资金面总体维持在相对宽松的局面。

央行的货币政策转向的背后是宏观经济基本面的疲弱走势。去年以来,工业增加值及投资数据均反映出我国经济内生性收缩的趋势在不断形成,通胀水平也逐步回落。而与此同时,政府对于经济增速下滑的容忍度也在增加,经济刺激政策出台的力度较此前有所下降。

此外,在经过2013年下半年的剧烈调整后,2014年初债券市场的整体收益率水平也达到了非常具备吸引力的水平。在此基础上,资金面及经济基本面带来的有利因素持续释放,共同带动我国债券市场迎来了一波幅度显著的上涨行情。虽然12月受流动性趋紧、股市分流资金及中证登新规影响,市场情绪一度扭转,但全年整体来看,收益率下行幅度如此之大,是投资者在年初难以预期的。

操作上,开放申购赎回期前组合平均久期自然下降。三季度再次进入封闭期后组合的杠杆水平有所上升,组合持仓债券的平均久期也提高至与封闭期大体匹配的水平。在整体较为有利的市场环境下,2014年组合净值保持了稳健增长的态势。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.041元,本报告期份额净值增长率为8.85%;C类基金份额净值为1.039元,本报告期份额净值增长率为8.55%;同期业绩比较基准收益率为4.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对宏观经济走势的分析仍然是我们对债券市场做出中长期判断的基础,尤其是目前经济内生性的疲弱可能仍是最值得关注的核心问题。去年下半年以来工业增加值的回落以及投资增速的下滑都反映了这种趋势仍然在持续。在没有更加宽松的政策推动下,我们似乎很难看到经济回升的动力。需求下滑的一个后果是去年四季度以来通胀水平逐步回落,未来出现通缩风险的可能性有所上升。而在当前的低通胀环境下,偏高的真实利率水平是抑制融资需求的一个关键因素,后续央行仍可能继续释放宽松的政策信号,1月份重启逆回购就是一种体现。总体上而言,在经济下行周期延续的情景下,我们认为偏长的久期配置是较优的策略选择。

当然,这一判断存在诸多变数。首先是央行货币政策节奏上的不确定性。近期政府的表态更多反映出全面性货币宽松政策出台的可能性在下降,而考虑到宽松政策更可能使得资金流入股票市场而非实体经济,央行在政策选择上也可能将偏于谨慎。此外,资金面的波动也将更难以预料,不排除个别时点上流动性紧张的局面再度出现。另一方面,如果宽信用政策的效果逐渐体现,则融资数据可能将会有所反弹,从而提振市场对于经济复苏的预期,这一情景在历史上曾经出现。因此,虽然我们对债券市场的总体趋势偏向乐观,但也认为市场波动性会加大,没有必要采取过于极端的配置策略。

信用债估值方面,目前中高评级信用利差处于中性偏高的水平,继续扩大的空间比较有限。如果资金面保持稳定,信用利差存在收窄的可能性。但我们仍然比较担心低评级债券信用风险上升的可能性,经济疲弱环境下企业微观层面的偿债压力依然不可忽视。城投债的投资思路也将出现新的变化,现阶段对于纳入地方政府性债务确权率的甄别变得至关重要。

总体而言,我们认为今年债券市场收益率仍存在下行空间,但不确定性的上升将对择时操作带来较大的考验。在收益率上行风险有限的前提下,组合将基本延续高杠杆、高静态收益率的投资策略。同时,保持组合持仓债券平均久期与剩余封闭期大体匹配。信用债配置上,我们将对信用债个券的资质密切跟踪。

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

易方达纯债1年定期开放债券A:本报告期内已实施利润分配42,607,487.38元。

易方达纯债1年定期开放债券C:本报告期内已实施利润分配14,068,081.67元。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为A类42,607,487.38元,B类14,068,081.67元。

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

本托管人复核审查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。

§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:易方达纯债1年定期开放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

姓名	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	1,123,784.36	
结算备付金	49,383,429.45	
存出保证金	44,984.43	
交易性金融资产	1,428,708,292.76	
其中:股票投资	-	
基金投资	-	
债券投资	1,428,708,292.76	
资产支持证券投资	-	
贵金属投资	-	
衍生金融资产	-	
买入返售金融资产	-	
应收证券清算款	2,619,487.18	
应收利息	25,814,947.28	
应收股利	-	
应收申购款	-	
递延所得税资产	-	
其他资产	-	
资产总计	1,507,694,925.46	
负债和所有者权益	本期末 2014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	690,323,747.51	
应付证券清算款	2,097,604.87	
应付赎回款	-	
应付管理人报酬	414,112.04	
应付托管费	138,037.34	
应付销售服务费	84,180.45	
应付交易费用	20,941.72	
应交税费	-	
应付利息	466,082.90	
应付利润	-	
递延所得税负债	-	
其他负债	390,000.00	
负债合计	693,934,706.83	
所有者权益:		
实收基金	782,271,150.05	
未分配利润	31,489,068.58	
所有者权益合计	813,760,218.63	
负债和所有者权益总计	1,507,694,925.46	

注:1.本基金合同生效日为2013年7月30日,2013年度实际报告期间为2013年7月30日至2013年12月31日。

2.报告截止日2014年12月31日,A类基金份额净值1.041元,C类基金份额净值1.039元;基金份额总额782,271,150.05份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额543,396,759.97份,C类基金份额总额238,874,390.08份。

7.2 利润表

会计主体:易方达纯债1年定期开放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

姓名	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年7月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入		127,277,891.71
1.利息收入		101,469,598.92
其中:存款利息收入		13,969,221.31
债券利息收入		87,429,899.54
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		70,478.07
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		4,659,628.41
其中:股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		4,659,628.41
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		20,113,210.86
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,035,453.52
减:二、费用		40,496,069.39
1.管理人报酬		6,204,986.73
2.托管费		2,068,328.89
3.销售服务费		1,138,385.87
4.交易费用		41,476.56
5.利息支出		30,569,080.88
其中:卖出回购金融资产支出		30,569,080.88
6.其他费用		473,810.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		86,781,822.32
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		86,781,822.32

注:本基金合同生效日为2013年7月30日,2013年度实际报告期间为2013年7月30日至2013年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达纯债1年定期开放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)	1,210,059,740.76	3,825,177.97	1,213,884,918.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	86,781,822.32	86,781,822.32
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)	-427,788,590.71	-2,442,362.66	-430,230,953.37
其中:1.基金申购款	982,748,652.94	8,296,537.11	991,045,190.05
2.基金赎回款	-1,410,537,243.65	-10,738,899.77	-1,421,276,143.42
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)	-	-56,675,569.05	-56,675,569.05
五、期末所有者权益(基金净值)	782,271,150.05	31,489,068.58	813,760,218.63
项目	上年度可比期间 2013年7月30日(基金合同生效日)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)	1,213,394,532.17	-	1,213,394,532.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,847,004.79	3,847,004.79
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)	-3,334,791.41	-21,826.82	-3,356,618.23
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-3,334,791.41	-21,826.82	-3,356,618.23
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,210,059,740.76	3,825,177.97	1,213,884,918.73

注:本基金合同生效日为2013年7月30日,2013年度实际报告期间为2013年7月30日至2013年12月31日。

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

易方达纯债1年定期开放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[2013]270号《关于核准易方达纯债1年定期开放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《易方达纯债1年定期开放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,《易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年7月30日生效,基金合同生效日的基金份额总数为1,213,394,532.17份基金份额,其中认购资金利息折合178,289.79份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》、《易方达纯债1年定期开放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

项目	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")	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7月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,204,986.73	3,078,211.68
其中:支付销售机构的客户维护费	2,914,912.98	1,628,485.56

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.6%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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7月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,068,328.89	1,026,070.57

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达纯债1年定期开放债券A	易方达纯债1年定期开放债券C	合计
易方达基金管理有限公司	-	30,466.73	30,466.73
中国建设银行	-	1,048,863.53	1,048,863.53
广发证券	-	111.08	111.08
合计	-	1,079,441.34	1,079,441.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年7月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达纯债1年定期开放债券A	易方达纯债1年定期开放债券C	合计
易方达基金管理有限公司	-	13,768.48	13,768.48
中国建设银行	-	508,209.11	508,209.11
广发证券	-	42.38	42.38
合计	-	522,019.97	522,019.97

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.4%。

本基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.4%÷当年天数

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

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

易方达纯债1年定期开