易方达双债增强债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达双债增强债券	
基金主代码	110035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年12月1日	
报告期末基金份额总额	4,406,313,205.93份	
投资目标	本基金主要投资于信用债、可转债等固定收益品种,通过积极主动的投资管理,力争为投资者提供持续稳定的回报。	
投资策略	本基金根据对基本面因素的分析,以及对不同资产的风险收益特征及相关关系进行研究,确定大类资产配置比例;通过对信贷水平、信用利差水平、信用债市场供求关系等因素进行分析,进行信用债投资;通过对转股溢价率、融券波动率、对应正股的市场走势、供求关系等因素进行分析,投资可转债;综合考虑组合收益、利率风险以及流动性,投资于利率品种;综合考虑新股估值水平、中签率、上市后的平均涨幅等因素,决定新股申购投资。	
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率*40%+天相可转债指数收益率*40%+中债国债总全价指数收益率*20%	
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	
下属分级基金的基金简称	易方达双债增强债券A	易方达双债增强债券C
下属分级基金的交易代码	110035	110036
报告期末下属分级基金的份额总额	4,280,856,080.42份	125,457,125.51份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)	
	易方达双债增强债券A	易方达双债增强债券C
1.本期已实现收益	78,094,317.84	3,696,916.21
2.本期利润	131,047,535.56	5,652,872.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0303	0.0229
4.期末基金资产净值	5,108,968,636.16	147,106,862.33
5.期末基金份额净值	1.193	1.173

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本报告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

易方达双债增强债券A

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	2.49%	0.08%	-8.32%	1.67%	10.81%	-1.59%

易方达双债增强债券C

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	2.53%	0.08%	-8.32%	1.67%	10.85%	-1.59%

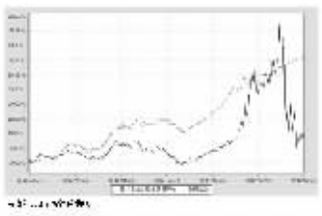
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

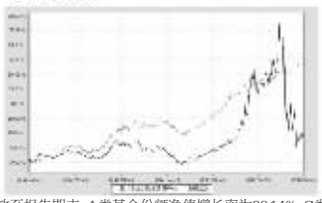
易方达双债增强债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011年12月1日至2015年9月30日)

易方达双债增强债券A





注:自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为36.14%,C类基金份额净值增长率为34.06%,同期业绩比较基准收益率为9.15%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张磊	本基金的基金经理、易方达高级信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒久添利1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理	2011-12-01	-	9年	硕士研究生,曾任泰康人寿保险公司资产管理中心固定收益部研究员、投资经理,新华资产管理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投资经理。

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。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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2次,其中1次为指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易;1次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,房地产开发投资增速持续下滑至3.5%的低位,这是2009年5月以来的最低水平。去年四季度以来地产市场出现回暖,但是需求主要体现在一线城市,而一线城市的地产投资占全国的比例有限;同时开发商在三四线城市仍积累了大量库存有待消化,对新项目的投资保持谨慎。发改委审批大量基建项目,希望通过基建投资对地产投资下滑的影响进行对冲,但仍难以扭转固定资产投资增速回落的趋势,其同比增速已经下降至10.8%,进入近15年以来的低位区间。进出口同比出现负增长,相对而言进口弱于出口,显示内需仍弱于外需,呈现衰退性顺差;同时社会零售消费同比增速也已经下降至06年以来的低位。需求处于弱势,政府主导的基建投资也难以扭转投资下滑的趋势,宏观经济整体疲弱。工业增加值维持在6%左右的低位,PM1则回落至50%以内。货币信贷出现一定回升,但中长期信贷中70%为居民户,企业整体再投资信心不足。受食品价格反弹影响,CPI出现小幅回升;而PPI同比降幅继续扩大。

债券市场整体上涨。7月份,受到股票市场大幅调整影响,投资者风险偏好下降;IPO的暂停,也导致部分打新资金向债券市场回流。同时,宏观经济基本面表现不佳,股票市场情绪低迷,央行的货币政策继续维持宽松。投资者资产配置行为的改变,债券市场边际上需求大幅增加而供给有限,使债券市场收益率趋势性下行,中短期信用债领涨,并带动中长端利率上涨,信用利差大幅压缩。

本基金在三季度季度的债券投资继续维持相对较低的久期和适度杠杆,对持仓品种进行微调,以获取持有期收益为主要目标,维持组合流动性,并关注信用风险。

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1.193元,本报告期份额净值增长率为2.49%;C类基金份额净值为1.173元,本报告期份额净值增长率为2.53%;同期业绩比较基准收益率为-8.32%。

4.4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济的弱势格局,短期内难以扭转。基建投资的扩张,难以对冲内需快速回落的冲击,仅能延缓经济增速回落的速度,但是无法扭转整体的趋势。从近期货币政策的取向看,中央对于经济的状况较为担忧,也倾向于采取一些较为积极的政策。预计未来央行仍将维持稳中有松的货币政策;资金面将持续维持相对宽松的局面。而投资者风险偏好的下降,导致大类资产配置行为的变化,使得供需格局整体有利于债券市场。预计未来债券市场仍有上涨的空间,而风险相对可控。

同时我们也注意到,利率大幅下行之后,债券市场本身的风险也有所累积;如果未来股票市场出现反弹和IPO的重启,可能会导致市场资金的回流;人民币的贬值预期,也会对资金面带来一定不确定性。我们会持续关注这些风险因素的变化和对市场或有的影响。

我们将继续维持适度的杠杆水平和久期,并根据市场情况调整持仓结构,选择有利配置时点,以获取持有期回报为主要目标。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	5,564,740,040.90	96.98
	其中:债券	5,564,740,040.90	96.98
	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	34,082,529.67	0.59
7	其他资产	139,358,813.34	2.43
8	合计	5,738,181,383.91	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	355,012,000.00	6.75
	其中:政策性金融债	355,012,000.00	6.75
4	企业债券	1,128,765,008.90	21.48
5	企业短期融资券	323,230,000.00	6.15
6	中期票据	3,755,739,500.00	71.46
7	可转债	1,993,532.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,564,740,040.90	105.87

5.5 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	101453021	14粤城建MTN001	2,500,000	264,375,000.00	5.03
2	1480580	14大连融达债	1,800,000	187,884,000.00	3.57
3	101455035	14中建材MTN002	1,800,000	185,688,000.00	3.53
4	150215	15国开15	1,800,000	179,964,000.00	3.42
5	101554001	15中金集MTN001	1,500,000	154,335,000.00	2.94

5.6 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。

5.7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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,875.15
2	应收证券清算款	14,918,601.22
3	应收股利	-
4	应收利息	124,244,346.55
5	应收申购款	188,990.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	139,358,813.34

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达双债增强债券A	易方达双债增强债券C
报告期期初基金份额总额	4,765,210,683.60	27,953,614.02
报告期基金总申购份额	58,041,247.85	331,891,097.89
减:报告期基金总赎回份额	542,395,851.03	234,387,586.40
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	4,280,856,080.42	125,457,125.51

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达双债增强债券型证券投资基金募集的文件;

2.《易方达双债增强债券型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《易方达双债增强债券型证券投资基金托管协议》;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一五年十月二十四日

易方达岁丰添利债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	93,901,955.22份
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、票息率及票息频率、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(含增发股)发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析,预测新股(含增发股)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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	1,091,829.39
2.本期利润	157,673.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0017
4.期末基金资产净值	154,854,034.74
5.期末基金份额净值	1.649

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本报告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

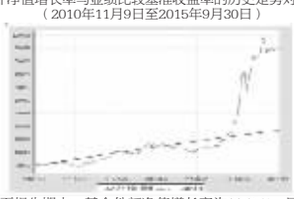
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.18%	0.31%	1.10%	0.01%	-0.92%	0.30%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年11月9日至2015年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为89.65%,同期业绩比较基准收益率为26.94%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张磊	本基金的基金经理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理、易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒久添利1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理	2015-06-13	-	9年	硕士研究生,曾任泰康人寿保险公司资产管理中心固定收益部研究员、投资经理,新华资产管理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投资经理。

注:1.此处的"任职日期"和"离任日期"分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

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。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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2次,其中1次为指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易;1次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,国内经济增速继续下行。8月工业生产增速显著下行,下滑速度比7月还要快。但零售和投资数据则在7月大幅下滑的基础上有所企稳,8月零售数据显示需求水平虽较为低迷但已经企稳,投资数据也有所企稳但力度依然较弱,8月CPI略超预期,但结构上主要受食品价格影响,非食品通胀压力继续缓解。中上游价格通缩进一步加剧,这反映经济仍较为疲弱,与进口数据的变化一致。8月11日人民币汇率中间价调整机制出现变化,参考上日银行间外汇市场收盘汇率,人民币汇率随后出现了连续的贬值。两周后中国人民银行宣布降低存贷款基准利率25bp,并放开一年期以上定期存款的利率浮动上限,同时降低法定存款准备金率0.5%。人民币汇率中间价调整机制的变化意味着人民币汇率形成机制在最终走向市场化浮动的道路上迈出了决定性的一步;而降准降息则直接有利于市场恢复对中国经济增长的信心。尽管人民币汇率波动加大,短期内贬值压力有所加剧,但是中期贬值预期仍源决于经济增长的态势,央行的操作则表明了其保障国内经济的决心。总体而言三季度国内货币市场延续了二季度以来宽松的态势,货币市场工具的利率水平维持平稳。

报告期内本基金以短期融资券、存款为主要配置资产,提高了同业存单的配置比例,保持了较高的组合平均剩余期限,并维持了组合较高的杠杆率。在保持一定流动性的同时为投资者提供了较高的投资收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A类基金份额净值收益率为0.8028%;B类基金份额净值收益率为0.8640%;R类基金份额净值收益率为0.8665%;同期业绩比较基准收益率为0.0895%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,经济下行压力依然存在。我们认为货币政策的取向主要取决于经济状况,在2015年全年GDP增速7%、CPI增速3%的政策目标下,实施宽松的货币政策仍是保证经济平稳增长的必要条件。基于这样的判断,货币类基金四季度在策略上保持中性偏长久期、使用杠杆进行套息交易是提升收益较好的投资策略;但考虑到目前无风险利率水平已经处于低位,而由于美联储加息预期缓解、汇率走稳、五中全会临近等多重因素叠加,国内市场投资者的风险偏好开始探底并逐渐修复,这种风险偏好的改变会分流一部分货币市场的资金进入股市,从而使货币类基金面临一定的流动性风险,因此保持大量短期资金到期是较为安全的投资选择。从货币基金可投资资产来来的收益率走势来看,流动性宽裕将决定短期债券、存款、存单的收益率在低位徘徊,因此货币类基金的投资收益率在四季度很难有抢眼表现。

本基金将坚持货币基金作为流动性管理工具的定位,继续保持投组合较好的流动性和合适的剩余期限。基金投资类属配置将以同业存款、逆回购、金融债和信用相对较好的短期融资券为主,追求相对稳定的投资收益。基金管理人始终将基金资产安全和基金收益稳定的重要性置于高收益的追求之上,坚持规范运作、审慎投资,勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,734,247.70	2.18
	其中:股票	3,734,247.70	2.18
2	固定收益投资	155,043,448.07	90.63
	其中:债券	155,043,448.07	90.63
	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	1,825,953.35	1.07
7	其他资产	10,462,738.57	6.12
8	合计	171,066,387.69	100.00

5.2 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	748,300.00	0.48
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	450,947.70	0.29
J	金融业	2,535,000.00	1.64
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	3,734,247.70	2.41

5.3 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	600016	民生银行	300,000	2,535,000.00	1.64
2	002408	齐翔腾达	70,000	748,300.00	0.48
3	601929	吉视传媒	41,562	450,947.70	0.29

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,038,000.00	6.48
	其中:政策性金融债	10,038,000.00	6.48
4	企业债券	101,496,144.07	65.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,327,000.00	19.58
7	可转债	13,183,304.00	8.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	155,043,448.07	100.12

5.5 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	1382186	13满世煤MTN1	300,000	30,327,000.00	19.58
2	124318	13滨城投	135,000	13,992,750.00	9.04
3	1280363	12盐城东方债	100,000	10,563,000.00	6.82
4	1380162	13金霞债	100,000	10,380,000.00	6.70
5	122366	14武钢债	100,000	10,185,000.00	6.58

5.6 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。

5.7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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	143,713.20
2	应收证券清算款	6,400,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,754,045.66
5	应收申购款	164,979.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,462,738.57

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	2,623,000.00	1.69
2	128009	歌尔转债	1,939,200.00	1.25

5.11.5报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	97,797,813.18
报告期基金总申购份额	8,267,579.73
减:报告期基金总赎回份额	12,163,437.69
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	93,901,955.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集的文件;

2.《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达岁丰添利债券型证券投资基金托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一五年十月二十四日

易方达天天理财货币市场基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达天天理财货币		
基金主代码	000009		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年3月4日		
报告期末基金份额总额	38,302,745,979.80份		
投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。		
业绩比较基准	中国人民银行公布的活期存款基准利率的税后收益率,即活期存款基准利率×(1-利息税税率)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R
下属分级基金的交易代码	000009	000010	000013
报告期末下属分级基金的份额总额	27,672,538,523.60份	7,521,024,564.56份	3,109,182,891.64份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)		
	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R
1.本期已实现收益	235,067,274.88	52,224,524.10	24,681,387.69
2.本期利润	235,067,274.88	52,224,524.10	24,681,387.69
3.期末基金资产净值	27,672,538,523.60	7,521,024,564.56	3,109,182,891.64

注:1.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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达天天理财货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8028%	0.0021%	0.0895%	0.0000%	0.7133%	0.0021%

易方达天天理财货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8640%	0.0021%	0.0895%	0.0000%	0.7745%	0.0021%

易方达天天理财货币R

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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