易方达科讯混合型证券投资基金

【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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	易方达科讯混合
基金主代码	110029
交易代码	110029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年12月18日
报告期末基金份额总额	5,663,132,616.63份
投资目标	根据市场环境变化,综合运用多种投资策略,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金综合运用多种投资策略,把握多种投资机会。股票投资策略方面,一般情况下以优势企业策略和成长策略为主,辅以行业周期策略、绝对价值策略、突发事件/收购兼并策略以及新兴技术策略。在特定的市场情况下,后四种策略中一种或多种的资金容量较大、不确定性较小、收益预期较高时,也可成为主策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合基金,理论上其风险收益水平高于债券基金和货币市场基金,低于股票基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

注:2015年7月25日,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,本基金变更基金类别开由"易方达科讯股票型证券投资基金"更名为"易方达科讯混合型证券投资基金"。

§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	153,164,672.23
2.本期利润	-3,810,122,518.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6366
4.期末基金资产净值	7,451,644,541.32
5.期末基金份额净值	1.3158

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人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. 本基金已于2008年1月4日对原基金科讯退市时的基金份额进行了拆分,基金拆分比例为1:2.825206742。

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	-31.47%	4.68%	-22.45%	2.68%	-9.02%	2.00%

3.2.2自基金转型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

易方达科讯混合型证券投资基金

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

(2007年12月18日至2015年9月30日)

注:1.本基金由原基金科讯于2007年12月18日转型而来。

2.自基金转型至报告期末,基金份额净值增长率为56.45%,同期业绩比较基准收益率为-24.95%。

§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		
宋昆	本基金的基金经理、易方达新兴成长混合型证券投资基金的基金经理、易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、公募基金投资部总经理	2010-09-11	-	9年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、公募基金投资部总经理助理、公募基金投资部副总经理。

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

截至报告期末,本基金份额净值为1.3158元,本报告期份额净值增长率为-31.47%,同期业绩比较基准收益率为-22.45%。

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

市场经过自6月份以来的剧烈下跌,前期因大幅上涨而形成的估值泡沫问题已得到了很大程度的消化,目前A股的整体市盈率已经有明显下降。与此同时,由于经济下行压力加大,预计中央政府会继续实施针对部分领域的财政刺激,同时保持较为宽松的货币环境。综合上述宏观经济局面、财政货币政策以及市场估值环境,我们认为可以逐步挑选出一批具备高投资性价比的优秀股票标的。但需留意的是,经济下行给企业经营带来了较大压力,三季报上市公司业绩低于预期的概率较大,后续需要避免业绩"地雷"。

放眼中长期,能使中国经济进一步恢复活力的依然是不断崛起的新兴产业。随着人类走进移动互联、云计算时代,机器人为代表的人工智能将在制造业中承担举足轻重的作用。从繁重的生产中解放出来的人类,对于自身的需求必将更加重视,娱乐、医疗、环保、教育、体育产业必将迎来黄金发展时期。其中,互联网的垂直应用领域,将迅速而深刻地改变社会生活,值得我们高度关注。

最后,衷心感谢持有人对本基金的信任和支持,我们将努力工作,力争回报大家的信任。

§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	6,190,213,189.90	82.72
	其中:股票	6,190,213,189.90	82.72
2	固定收益投资	500,141,861.64	6.68
	其中:债券	500,141,861.64	6.68
	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	759,847,709.76	10.15
7	其他资产	33,392,186.52	0.45
8	合计	7,483,594,947.82	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	1,830,000.00	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,935,846,672.33	25.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,482,400.00	0.05
E	建筑业	2,195,600.00	0.03
F	批发和零售业	4,172,200.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,870,000.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,817,844,547.43	37.82
J	金融业	5,923,327.41	0.08
K	房地产业	65,781,646.65	0.88
L	租赁和商务服务业	49,486,000.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	389,366,000.00	5.23
N	水利、环境和公共设施管理业	68,905,308.08	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	813,912,956.66	10.92
R	文化、体育和娱乐业	28,956,531.34	0.39
S	综合	640,000.00	0.01
	合计	6,190,213,189.90	83.07

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	002030	达安基因	23,000,000	782,460,000.00	10.50
2	002153	石基信息	7,600,000	635,208,000.00	8.52
3	300059	东方财富	12,000,000	431,760,000.00	5.79
4	600763	通策医疗	4,403,570	427,278,397.10	5.73
5	600645	中源协和	7,300,000	389,163,000.00	5.22
6	300007	汉威电子	6,666,521	295,126,884.67	3.96
7	300369	绿盟科技	8,166,450	276,026,010.00	3.70
8	300244	迪安诊断	3,600,000	249,444,000.00	3.35
9	600446	金证股份	8,400,000	213,444,000.00	2.86
10	300431	暴风科技	3,000,000	174,330,000.00	2.34

注:本报告期末本基金投资达安基因(002030)占基金资产净值超过10%,属于被动超标。

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	499,930,000.00	6.71
	其中:政策性金融债	499,930,000.00	6.71
4	企业债券	101.00	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	211,760.64	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	500,141,861.64	6.71

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	150416	15农发16	3,000,000	300,090,000.00	4.03
2	150311	15进出11	2,000,000	199,840,000.00	2.68
3	128009	歌尔转债	1,638	211,760.64	0.00
4	112118	12金螳01	1	101.00	0.00

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	5,571,219.92
2	应收证券清算款	11,739,076.22
3	应收股利	-
4	应收利息	3,677,755.05
5	应收申购款	12,404,135.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,392,186.52

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	128009	歌尔转债	211,760.64	0.00

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002030	达安基因	782,460,000.00	10.50	重大事项停牌
2	600763	通策医疗	427,278,397.10	5.73	重大事项停牌
3	600645	中源协和	389,163,000.00	5.22	重大事项停牌
4	600446	金证股份	213,444,000.00	2.86	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,974,898,998.37
报告期基金总申购份额	3,336,603,365.37
减:报告期基金总赎回份额	3,648,369,747.11
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	5,663,132,616.63

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	72,448,816.90
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	72,448,816.90
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.28

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《关于核准科讯证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2007]330号);

2.《易方达科讯混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达科讯混合型证券投资基金托管协议》;

4.中国证监会《关于同意科汇、科讯、科翔证券投资基金上市、扩募和续期的批复》(证监基金字[2001]11号文);

5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

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

易方达龙宝货币市场基金

【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:华夏银行股份有限公司
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。

基金托管人华夏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	易方达龙宝货币
基金主代码	000789
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月12日
报告期末基金份额总额	786,756,209.39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	本基金将对基金资产组合进行积极管理,在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,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七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,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	华夏银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	易方达龙宝货币A	易方达龙宝货币B
下属分级基金的交易代码	000789	000790
报告期末下属分级基金的份额总额	738,570,774.46份	48,185,434.93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)	
	易方达龙宝货币A	易方达龙宝货币B
1.本期已实现收益	5,492,242.53	480,219.95
2.本期利润	5,492,242.53	480,219.95
3.期末基金资产净值	738,570,774.46	48,185,434.93

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

易方达龙宝货币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	0.8012%	0.0050%	0.3456%	0.0000%	0.4556%	0.0050%

易方达龙宝货币B

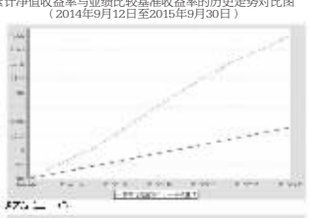
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8624%	0.0050%	0.3456%	0.0000%	0.5168%	0.0050%

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

易方达龙宝货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年9月12日至2015年9月30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,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为4.0523%,B类基金份额净值收益率为4.3130%,同期业绩比较基准收益率为1.4504%。

§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		
石大修	本基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达财富快钱货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理	2014-09-12	-	6年	硕士研究生,曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。
梁莹	本基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达财富快钱货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理	2015-03-17	-	5年	硕士研究生,曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员、易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益基金经理助理。

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

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取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,提高了间业存单的配置比例,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0.8012%;B类基金份额净值收益率为0.8624%;同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

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。从货币基金可投资产之未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抬眼表现。

本基金将坚持货币基金作为流动性管理工具的定位,继续保持投资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、同业存单、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	固定收益投资	498,580,699.22	57.09
	其中:债券	498,580,699.22	57.09
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	342,268,394.03	39.19
4	其他资产	32,462,509.44	3.72
5	合计	873,311,602.69	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	12.61
	其中:买断式回购融资	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	85,495,511.76	10.87
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	95
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	85

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金投资组合平均剩余期限无超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	26.98	10.87
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	25.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	39.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	15.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.88	10.87

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	摊余成本(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	40,037,872.98	5.09
	其中:政策性金融债	40,037,872.98	5.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	360,204,728.02	45.78
6	中期票据	-	-
7	同业存单	98,338,098.22	12.50
8	其他	-	-
9	合计	498,580,699.22	63.37
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111517166	15光大CD166	700,000	68,838,737.35	8.75
2	080419	08农发19	400,000	40,037,872.98	5.09
3	011599158	15鲁黄金SCP001	400,000	40,036,477.43	5.09
4	041466027	14杭交投CP002	300,000	30,029,754.38	3.82
5	111591783	15宁波银行CD104	300,000	29,499,360.87	3.75
6	041553017	15兖州煤业CP001	200,000	20,116,952.09	2.56
7	041562003	15沪世茂CP001	200,000	20,093,262.98	2.55
8	011574001	15陕煤化SCP001	200,000	20,037,528.08	2.55
9	041560030	15阔稀土CP001	200,000	20,026,516.26	2.55
10	041559019	15永煤控CP001	200,000	20,021,051.75	2.54

5.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	61次
报告期内偏离度的最高值	0.4420%
报告期内偏离度的最低值	0.2141%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3697%

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。

5.8投资组合报告附注

5.8.1基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下:

(1)基金持有的债券(包括票据)购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入,每日计提收益;

(2)基金持有的回购以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入;

(3)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.8.2本基金本报告期内不存在剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3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。

5.8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	10,032,722.13
4	应收申购款	22,424,787.31
5	其他应收款	5,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	32,462,509.44

5.8.5投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金管理人旗下个公司易方达资产管理有限公司于本报告期末持有易方达龙宝货币市场基金A类的基金份额为2,007,087.34份。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达龙宝货币A	易方达龙宝货币B
报告期期初基金份额总额	842,469,663.18	11,650,864.93
本报告期基金总申购份额	1,909,700,262.16	139,385,642.95
本报告期基金总赎回份额	2,013,599,150.88	102,851,072.95
报告期期末基金份额总额	738,570,774.46	48,185,434.93

§7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.中国证监会注册易方达龙宝货币市场基金募集的文件;

2.《易方达龙宝货币市场基金基金合同》;

3.《易方达龙宝货币市场基金托管协议》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

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

易方达平稳增长证券投资基金

【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