易方达黄金主题证券投资基金（LOF）

【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：中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	易方达黄金主题（QDII-LOF-FOF）
场内简称	易基黄金
基金主代码	161116
交易代码	161116
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2011年5月6日
报告期末基金份额总额	628,774,355.19份
投资目标	本基金追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要通过对国际黄金价格中长期趋势的判断，深入研究黄金价格趋势，黄金采掘企业盈利和估值水平变化，以及考察其他品种的风险收益特征的基础上，进行黄金ETF、黄金股票类资产以及其他资产的比例配置。
业绩比较基准	以伦敦黄金市场下午定盘价计价的国际现货黄金（经汇率折算）
风险收益特征	基金管理人根据对黄金价格走势的判断，在黄金基金、黄金采掘公司股票及其他资产之间进行主动配置。本基金的表现与黄金价格相关性较高，本基金是预期收益与预期风险较高的基金品种。此外，本基金主要投资海外，存在汇率风险。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称：无
	中文名称：无
境外资产托管人	英文名称：The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文名称：香港上海汇丰银行有限公司

§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	-28,515,766.80
2.本期利润	-3,333,076.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0052
4.期末基金资产净值	394,682,865.11
5.期末基金份额净值	0.628

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。

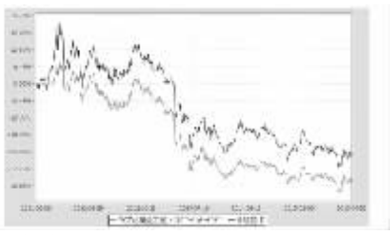
3.2 基金净值表现

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	-0.79%	0.88%	-2.42%	1.07%	1.63%	-0.19%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

易方达黄金主题证券投资基金（LOF）
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5月6日至2015年9月30日）



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2. 自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-37.20%，同期业绩比较基准收益率为-27.81%。

§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		
王超	本基金的基金经理、易方达资源行业混合型证券投资基金基金经理、易方达积极成长证券投资基金基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达蓝筹精选混合型证券投资基金基金经理、易方达风尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013-12-17	-	5年	硕士研究生，曾任上海尚雅投资管理有限公司行业研究员、易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金没有聘请境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了相应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，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

4.4.2异常交易行为的专项说明

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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度全球黄金市场在经历了前期的低波动率阶段之后，波动率开始提升，市场对黄金价格的分歧开始加大。期内黄金价格从1172美元/盎司，降至1112美元/盎司。尽管美联储未能在年中实现加息，但市场仍然预期美联储会在年内加息，导致黄金价格走势疲软。

本基金三季度维持了较高的黄金仓位，这一决策一方面取决于对黄金波动水平可能上升的认识，另一方面取决于对海外权益市场缺乏投资机会的判断。通过收缩香港和美国市场的证券投资，回避了前期市场的下行风险；尽管黄金价格略有下跌，但由于本基金配置的资产均为美元资产，得益于人民币在过去一个季度里的贬值，基金仍然取得了正收益。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.628元，本报告期份额净值增长率为-0.79%，同期业绩比较基准收益率为-2.42%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年四季度，全球宏观经济最大的焦点仍然在于美联储的加息钟声。我们对年中加息的预期一直持怀疑态度，但目前全球金融市场动荡，市场对于美联储年内是否加息的争议非常之大。基于我们的研究，我们认为美联储年内加息的概率很低，黄金价格将具备一定的投资价值。这是我们过去若干个季度以来，对黄金价格判断最为乐观的一个时间窗口。

基于这些判断，我们维持了较高的黄金头寸，并维持较高的美元资产比例。相信基金将受益于黄金价格的上涨以及美元资产的相对升值。本基金将继续力争用更主动、积极的管理方式为投资者争取更好回报。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	372,763,872.14	93.25
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	26,821,315.35	6.71
8	其他资产	155,454.40	0.04
9	合计	399,740,641.89	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR GOLD TRUST	ETF基金	开放式	World Gold Trust Services LLC	78,173,379.57	19.81
2	ETFS GOLD TRUST	ETF基金	开放式	ETF Securities USA LLC	70,328,255.45	17.82
3	JB PHYSICAL GOLD FND-A USD	ETF基金	开放式	Swiss & Global Asset Management AG	70,076,080.80	17.76
4	UBS ETF CH-GOLD USD-I	ETF基金	开放式	UBS Fund Management Switzerland AG	69,681,680.20	17.66
5	ISHARES GOLD TRUST	ETF基金	开放式	Credit Suisse Asset Management AG	68,574,814.00	17.37
6	ZKB GOLD ETF-A (USD)	ETF基金	开放式	Balfidor Fondsleitung AG	8,981,214.13	2.28
7	ISHARES GOLD CH	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	6,948,447.99	1.76

注：本基金本报告期末仅持有以上基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,683.90
5	应收申购款	150,770.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	155,454.40

5.10.4 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。

5.10.5 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	805,430,629.49
报告期基金总申购份额	143,387,576.19
减：报告期基金总赎回份额	320,043,850.49
报告期基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	628,774,355.19

§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. 中国证监会核准易方达黄金主题证券投资基金（LOF）募集的文件；
2.《易方达黄金主题证券投资基金（LOF）基金合同》；
3.《易方达黄金主题证券投资基金（LOF）托管协议》；
4. 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	易方达货币		
基金主代码	110006		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2006年2月2日		
报告期末基金份额总额	71,297,399,507.80份		
投资目标	在确保本金安全和高流动性的前提下，追求超过基准的回报。		
投资策略	在保持安全性和流动性的前提下尽可能提升组合的收益。		
业绩比较基准	税后活期存款利率(国活期存款利率×(1-利息税率))		
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E
下属分级基金的场内简称	-	-	易货币
下属分级基金的交易代码	110006	110016	511800
报告期末下属分级基金的份额总额	3,447,070,551.83份	63,633,905,090.70份	4,216,423,865.27份

注：1.易方达货币市场基金E类基金份额上市交易。

2.自2014年11月21日起，易方达货币市场基金增设E类份额类别，基金份额面值为100元，本表所列E类份额数据面值已折算为1元。

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)		
	易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E
1.本期已实现收益	24,293,136.76	560,948,523.26	12,752,041.64
2.本期利润	24,293,136.76	560,948,523.26	12,752,041.64
3.期末基金资产净值	3,447,070,551.83	63,633,905,090.70	4,216,423,865.27

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.本基金自成立起至2014年11月20日，利润分配是按月结转份额；自2014年11月21日起至今，利润分配是按日结转份额。

3.根据《关于易方达货币市场基金实施基金份额分级的公告》，本基金于2006年7月18日实施分级，分级后本基金设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额，升级后的B级基金份额从2006年7月19日起享受B级基金收益。

4.自2014年11月21日起，本基金增设E类份额类别。

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	0.5714%	0.0007%	0.0883%	0.0000%	0.4831%	0.0007%

易方达货币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	0.6323%	0.0007%	0.0883%	0.0000%	0.5440%	0.0007%

易方达货币E

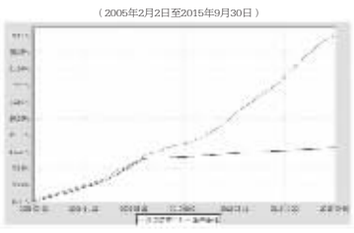
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5712%	0.0007%	0.0883%	0.0000%	0.4829%	0.0007%

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

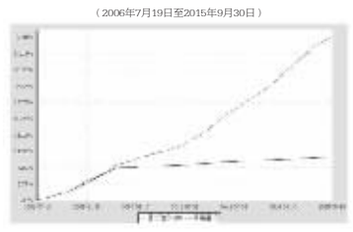
易方达货币A

（2006年2月2日至2015年9月30日）



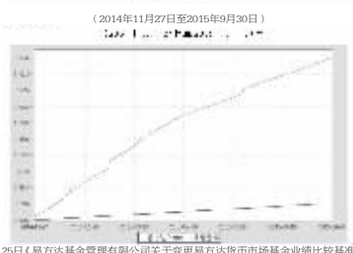
易方达货币B

（2006年7月19日至2015年9月30日）



易方达货币E

（2014年11月27日至2015年9月30日）



注：1.根据2008年12月26日《易方达基金管理有限公司关于变更易方达货币市场基金业绩比较基准的公告》，自2009年1月1日起，本基金原约定的业绩比较基准“一年期银行定期储蓄存款的税后利率：（1-利息税率）×一年期银行定期储蓄存款利率”，变更为：“税后活期存款利率(扣活期存款利息)（1-利息税率）”。

2.自2014年11月21日起，本基金增设E类份额类别，份额申购首次确认日为2014年11月27日。

3.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值收益率为39.1786%，同期业绩比较基准收益率为12.6877%；自基金分级至报告期末，B类基金份额净值收益率为73.9441%，同期业绩比较基准收益率为10.0562%；自E类基金合同生效至报告期末，E类基金份额净值收益率为29.0698%，同期业绩比较基准收益率为0.2958%。

§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		
石大悟	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、易方达龙宝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	2013-04-22	-	6年	硕士研究生，曾任南方基金管理有限公司交易管理岗交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益库基金经理助理。

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。

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，A股市场延续了前期的下跌趋势。上证综指和深证成指三季度分别下跌了28.63%和30.34%，中小板指和创业板指与市场指数跌幅相当，分别下跌了26.57%和27.14%。7月至8月，市场在政府出手救市的背景下震荡调整，但前期积累的各种形式的融资盘仍然较多，市场缺乏承接的人气和能力，持续下跌。

本期内在本基金的操作上做了小幅的调整，适当降低了仓位，但由于仓位下降仍不够显著，导致在市场下跌时基金回撤较多。另外，在投资思路上，本基金仍然坚持创新和经济结构转型的投资主线，其中部分个股阶段性回撤较多，也影响了基金整体回撤的程度。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.7710元，本报告期份额净值增长率为-30.98%，同期业绩比较基准收益率为-28.63%。

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，我们对宏观经济的预期逐步转向乐观。前期的货币政策放松将为经济托底，同时积极的财政政策会显现更大的拉动作用，这些都将进一步促进经济的改善。四季度的宏观经济大概率将出现企稳的态势。

A股市场经历了自6月份以来的大幅调整，相当数量的个股已回到合理的价值区间内，具备一定的投资价值。未来随着经济基本面的改善，A股市场仍将具备上行的潜力，但短期仍需要时间进行市场的自我修复，只有当市场恢复到一个机制正常的状态时，A股市场才会吸引更多的投资者参与。

基于对经济和证券市场的判断展望，我们认为未来一个阶段的市场将体现出较强的选股优势。市场系统性的下跌将让我们再次获得用较低成本买到优质企业的机会。在投资主线上，我们仍然坚信创新和经济结构转型是未来市场的主逻辑，将继续在新兴产业中寻找能够改变行业、改变人们生活方式的伟大企业。

§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	44,612,247,209.21	58.56
	其中：债券	44,612,247,209.21	58.56
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	456,151,124.23	0.60
	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	30,146,396,608.85	39.57
4	其他资产	972,771,477.38	1.28
5	合计	76,187,566,419.67	100.00

注：在报告期内，根据流动性管理的需要，本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

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	4.25
	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	4,651,997,600.00	6.52
	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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	136
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限无超过180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	28.03	6.52
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.20	-
2	30天（含）-60天	22.49	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）-90天	6.44	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）-180天	30.95	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天（含）-397天（含）	18.22	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.12	6.52

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	8,756,353,730.15	12.28
	其中：政策性金融债	8,066,374,301.53	11.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,733,838,039.99	27.68
6	中期票据	-	-
7	同业存单	16,122,055,439.07	22.61
8	其他	-	-
9	合计	44,612,247,209.21	62.57
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1,569,559,761.39	2.20

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	111510315	15兴业CD315	29,000,000	2,851,963,675.18	4.00
2	111517166	15光大CD166	27,300,000	2,684,710,756.68	3.77
3	111591761	15宁波银行CD102	22,000,000	2,163,503,173.88	3.03
4	111519066	15恒丰银行CD066	19,800,000	1,975,147,804.82	2.77
5	150214	15国开14	16,000,000	1,569,559,761.39	2.20
6	111509219	15浦发CD219	15,000,000	1,474,907,051.08	2.07
7	140230	14国开30	13,900,000	1,391,740,198.54	1.95
8	150202	15国开02	11,200,000	1,123,549,069.94	1.58
9	111591770	15南京银行CD093	10,000,000	983,532,951.90	1.38
10	111519048	15恒丰银行CD048	10,000,000	983,311,104.63	1.38

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	13次
报告期内偏离度的最高值	0.4555%
报告期内偏离度的最低值	0.1830%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2364%

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

本基金日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期限小于397天但剩余存续期超过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根据银监会上海监管局网站2014年10月8日发布的《中国银行业监督管理委员会上海监管局行政处罚决定书》，兴业银行股份有限公司信用卡中心因存在违法违规行为，被责令改正，并处罚款人民币三十万元。

根据银监会上海监管局网站2014年10月10日发布的《中国银行业监督管理委员会上海监管局行政处罚决定书》，上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心因存在违法违规行为，被责令改正，并处罚款人民币二十万元。

兴业银行、浦发银行核心竞争力强，且面对处罚已经做了积极改进，信用卡中心因存在违法违规行为并不影响组合持有的大额存单的偿付。

除以上银行、浦发银行之外，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	446,389,489.35
3	应收利息	475,985,221.84
4	应收申购款	50,301,641.93
5	其他应收款	80,000.00
6	待摊费用	15,124.26
7	其他	-
8	合计	972,771,477.38

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E
报告期期初基金份额总额	3,299,722,560.74	36,565,253,413.54	1,854,194,775.13
报告期基金总申购份额	13,268,412,310.70	190,137,692,310.31	2,362,288,586.72
报告期基金总赎回份额	13,121,064,319.61	163,069,040,633.15	59,496.58
报告期期末基金份额总额	3,447,070,551.83	63,633,905,090.70	4,216,423,865.27

注：A类和B类货币市场份额含因份额升降级等原因导致的强制调增份额。总赎回份额含因份额升降级等原因导致的强制调减份额。

§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.中国证监会批准易方达货币市场基金设立的文件；
2.《易方达货币市场基金基金合同》；
3.《易方达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

易方达积极成长证券投资基金

【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 基金产品概况

基金简称	易方达积极成长混合
基金主代码	110005
交易代码	110005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年9月9日
报告期末基金份额总额	2,823,690,453.16份
投资目标	本基金主要投资超速成长公司，以实现基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金采取主动投资管理模式，一方面主动地进行资产配置，以控制或规避市场的系统性风险；另一方面采取自下而上的选股策略，主要投资于利用“易方达成长公司评价体系”严格筛选的、具有良好成长性且价格合理的上市公司，其中投资的重点是“超速成长”公司的股票，以争取尽可能高的投资回报。
业绩比较基准	上证A股指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
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	-330,947,863.45
2.本期利润	-1,011,457,653.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3562
4.期末基金资产净值	2,176,946,237.92
5.期末基金份额净值	0.7710

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. 本基金于2007年2月7日进行分额拆分，分额折算比例为2.521248538，折算后基金份额净值为1.0000人民币元。

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	-30.98%	4.24%	-28.63%	3.28%	-2.35%	0.96%

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

易方达积极成长证券投资基金
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
（2004年9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374.91%，同期业绩比较基准收益率为132.80%。

§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		
王超	本基金的基金经理、易方达资源行业混合型证券投资基金基金经理、易方达黄金主题证券投资基金（L