易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金

2015 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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:二〇一六年三月二十五日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2016年3月22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2015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	易方达永旭定期开放债券
场内简称	易基永旭
基金主代码	161117
交易代码	161117
基金运作方式	契约型开放式,本基金合同生效后,每封闭运作两年,集中开放一次申购和赎回
基金合同生效日	2012年6月19日
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
报告期末基金份额总额	667,757,932.48份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年7月18日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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	本基金在封闭期与开放期将采取不同的投资策略,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。 封闭期内,在遵循债券组合久期与封闭期适当匹配的基础上,本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策的分析,预测未来的市场利率、信用利差水平、利率期限结构的变化,并据此对债券组合进行调整,力争提高债券组合的总投资收益。 开放期内,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	两年期银行定期存款收益率(税前)+0.5%
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	洪澜
	联系电话	020-85102688	010—66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-85104666	010-66105798

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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	74,436,925.64	57,868,440.97	93,960,363.73
本期利润	94,837,721.59	127,634,785.51	33,205,765.39
加权平均基金份额本期利润	0.1420	0.1145	0.0197
本期基金份额净值增长率	14.13%	13.42%	1.88%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0330	0.0326	-0.0173
期末基金资产净值	735,306,774.38	714,590,181.32	1,656,228,098.55
期末基金份额净值	1.101	1.070	0.983

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 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	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	2.60%	0.08%	1.07%	0.01%	1.53%	0.07%
过去六个月	7.25%	0.07%	2.14%	0.01%	5.11%	0.06%
过去一年	14.13%	0.09%	4.25%	0.01%	9.88%	0.08%
过去三年	31.87%	0.11%	13.29%	0.01%	18.58%	0.10%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	36.77%	0.11%	15.75%	0.01%	21.02%	0.10%

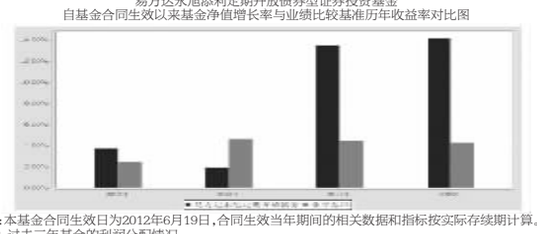
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达永旭添利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
(2012年6月19日至2015年12月31日)

注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为36.77%,同期业绩比较基准收益率为15.75%。

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

易方达永旭添利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



注:本基金合同生效日为2012年6月19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

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
2015年	1.110	74,121,128.53	-	74,121,128.53	-
2014年	0.440	29,381,349.37	-	29,381,349.37	-
2013年	0.660	111,230,603.55	-	111,230,603.55	-
合计	2.210	214,733,081.45	-	214,733,081.45	-

§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,易方达基金管理有限公司成立于2001年4月17日,注册资本1.2亿元,旗下设有北京、广州、上海、成都、南京、大连分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“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,易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005年8月,易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007年12月,易方达获得合格境内机构投资者(QDII)资格。2008年2月,易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2015年12月31日,易方达旗下共管理88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8269.58亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理(自2013年07月30日至2015年03月13日)、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理(自2013年04月22日至2015年03月13日)、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、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益研究部总经理	2013-04-22	2015-03-14	9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、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)基金经理。
刘琦	本基金的基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理(自2013年04月22日至2015年01月09日)、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理(自2013年04月02日至2015年06月12日)	2013-04-22	2015-03-14	7年	博士研究生,曾任嘉实基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理,嘉实国际资产管理有限公司助理副总裁,易方达基金管理有限公司固定收益投资部投资经理。
李一硕	本基金的基金经理、易方达纯债1年定期开放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助理、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助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理助理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理	2014-07-12	-	7年	硕士研究生,曾任瑞银证券有限公司研究员,中国国际金融有限公司研究员,易方达基金管理有限公司研究员。

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 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,贯穿投资授权、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进行提示,并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2015年度的同向交易价差情况进行了分析,包括旗下各大类资产组合之间(即公募、社保、年金、专户四大类业务之间)的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 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。

本报告期内,本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11次,其中8次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而和其他组合发生反向交易,3次为不同基金经理管理的组合间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。

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

2015年债券市场走势整体延续了2014年的牛市行情,在流动性宽裕的局面下,债券资产是各类投资者较为偏好的品种。全年看收益率呈现明显的下行态势,不过中间也出现过数次调整。

年初至春节期间,随着资金面较去年未逐渐宽松以及经济基本面仍然维持在偏弱水平,收益率整体稳步持续走低。春节后债市资金面开始趋于紧张,叠加降息后市场获利盘兑现的行为比较集中,且财政部批复地方政府债务置换额度带来利率债供给上升的预期,债券市场收益率一度有所回升。进入4月后,在宽松流动性的推动下收益率重新开始下行,同时央行降准政策释放的资金规模可观,带动银行间回购利率迅速下行,各期限债券收益率也明显回落。但5月中旬以后,投资者对于未来经济复苏的预期有所增加,打新策略得益于其稳定的回报也显著分流了债券市场需求。5月及6月虽然央行两次宣布降息,但对债券市场带来的利好影响均非常有限。

三季度央行货币政策继续维持宽松态度,宏观经济基本面也出现恶化,债市收益率在波动中下行,且中长端品种下行幅度相对更加明显,收益率曲线呈现牛市平坦化变动。四季度初工业增加值及投资数据仍低于预期,投资者对于货币政策的宽松预期继续升温。不过11月初几个因素导致债券市场出现一波回调。美联储10月议息会议暗示年底有可能加息,市场对美国加息预期突然上升,全球债券收益率一度明显上扬,国内债券市场同样抛压加剧,不过此轮债券市场调整的幅度较为有限。进入12月后,虽然经济数据中开始出现了部分积极信号,但随着配置需求持续释放,债市收益率快速走低。

操作上,组合保持高杠杆运作的思路,得益于融资成本处于低位以及市场收益率持续下行,全年组合净值显著增长。

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1.101元,本报告期份额净值增长率为14.13%,同期业绩比较基准收益率为4.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着2015年末债券市场走出一波超预期的行情,债券收益率可能已经较为充分的反映了未来一段时间内货币政策的宽松预期。2016年初长端债券的绝对收益率已经与08年末至09年初的历史阶段性低点较为接近,各类中高评级信用债的信用利差也已经降低至约四分之一分位数的历史偏低水平。同时各类收益率曲线的期限利差同样处于偏窄的区间内。

我们比较关注未来可能影响债券市场的几个因素。首先仍然是央行货币宽松政策可能低于市场预期的风险。虽然我们认为央行货币政策仍处于宽松周期内,但其政策出台的节奏及力度较难预期,往往滞后于经济和通胀下滑的走势。实际上,自去年10月下旬的“双降”以来,央行在货币政策上释放的积极信号已经比较有限,尤其是2016年初以来,尽管银行间市场流动性持续紧张,但市场机构预期的降准政策迟迟没有兑现。其次,持续的财政政策刺激对实体经济的效果可能逐步会有所体现,尤其是2016年政府将加大相关政策力度,包括扩大赤字率、增加政策性银行贷款及发行专项建设债券等手段。最后,虽然供给侧结构性改革仍然是政策的主要着力点,但预计去产能进程中带来的负面冲击很可能相对温和,且政府对经济托底意愿仍然强烈。

总体而言,2016年债券市场波动性很可能有所加剧,我们将维持谨慎乐观的策略方向,避免进行过于极端的配置操作。当然,在当前的经济形势下,宏观经济增速难以出现明显回升的迹象,央行很可能仍将维持宽松的货币政策取向,保持社会流动性的整体充裕,债券市场的风险总体而言仍比较可控。

信用市场方面,高评级品种流动性溢价将维持在偏低水平,但中低评级板块信用风险释放的进程则可能刚刚开始,未来可能会有更多信用风险事件出现,对此必须保持高度的警惕,在配置上提前防范。

本组合将基本延续高杠杆、高静态收益率的投资策略。未来我们仍将把防范信用风险置于首位,关注信用资质可能下沉的持仓个券,并及时作出调整。

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及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所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

根据相关法律法规及《易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金合同》,本报告期内已实施的利润分配为74,121,128.53元,其中2015年1月19日(场外)、2015年1月20日(场内)实施的利润分配18,029,464.21元是对2014年度的利润进行分配。本报告期末应分配尚未实施的利润分配为17,645,869.63元;本基金已于2016年1月15日(场外)、2016年1月18日(场内)进行了利润分配,每10份基金份额派发红利0.27元,总分配金额为18,029,464.21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

本报告期内,本基金托管人在对易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了4次利润分配,分配金额为74,121,128.53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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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2015年12月31日的资产负债表、2015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:易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	16,592,634.67	3,543,636.14
结算备付金	59,296,679.71	57,749,908.88
存出保证金	15,853.57	46,530.59
交易性金融资产	1,437,955,666.55	1,431,479,666.71
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,437,955,666.55	1,431,479,666.71
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	977,834.41	6,527,298.85
应收利息	32,376,710.42	33,563,956.28
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	37,500.00	37,500.00
资产总计	1,547,252,879.33	1,532,948,497.45
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 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	796,839,019.74	814,199,147.55
应付证券清算款	15,091,971.80	2,826,856.32
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	433,416.57	424,584.89
应付托管费	123,833.32	121,309.99
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	29,884.48	15,022.08
应交税费	2,932.20	2,932.20
应付利息	62,046.84	378,463.10
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	363,000.00	390,000.00
负债合计	811,946,104.95	818,358,316.13
所有者权益:		
实收基金	667,757,932.48	667,757,932.48
未分配利润	67,548,841.90	46,832,248.84
所有者权益合计	735,306,774.38	714,590,181.32
负债和所有者权益总计	1,547,252,879.33	1,532,948,497.45

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.101元,基金份额总额667,757,932.48份。

7.2 利润表

会计主体:易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	116,729,697.46	166,587,937.29
1.利息收入	84,130,834.65	111,572,399.25
其中:存款利息收入	877,982.56	12,507,878.78
债券利息收入	83,252,852.09	98,224,315.86
资产支持证券利息收入	-	408,780.82
买入返售金融资产收入	-	431,423.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	12,198,066.86	-15,283,347.77
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	12,198,066.86	-15,118,832.70
资产支持证券投资收益	-	-164,515.07
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)	20,400,795.95	69,766,344.54
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	532,541.27
减:二、费用	21,891,975.87	38,953,151.78
1. 管理人报酬	5,035,184.67	8,034,464.36
2. 托管费	1,438,624.21	2,295,561.23
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	22,298.95	39,848.15
5. 利息支出	14,912,490.14	28,063,100.82
其中:卖出回购金融资产支出	14,912,490.14	28,063,100.82
6. 其他费用	483,377.90	520,177.22
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	94,837,721.59	127,634,785.51
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	94,837,721.59	127,634,785.51

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	667,757,932.48	46,832,248.84	714,590,181.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	94,837,721.59	94,837,721.59
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-74,121,128.53	-74,121,128.53
五、期末所有者权益(基金净值)	667,757,932.48	67,548,841.90	735,306,774.38
项目	上年度可比期间 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)	1,685,312,169.47	-29,084,070.92	1,656,228,098.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	127,634,785.51	127,634,785.51
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)	-1,017,554,236.99	-22,337,116.38	-1,039,891,353.37
其中:1.基金申购款	600,053,215.47	26,986,823.02	627,040,038.49
2.基金赎回款	-1,617,607,452.46	-49,323,939.40	-1,666,931,391.86
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)	-	-29,381,349.37	-29,381,349.37
五、期末所有者权益(基金净值)	667,757,932.48	46,832,248.84	714,590,181.32

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:刘晓艳 ,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

易方达永旭添利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[2012]第323号《关于核准易方达永旭添利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《易方达永旭添利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,《易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2012年6月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,685,312,169.47份基金份额,其中认购资金利息折合637,503.20份基金份额。本基金为契约型、开放式基金,本基金自基金合同生效后,每封闭运作两年,集中开放一次申购和赎回。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》、《易方达永旭添利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

除下述事项外,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。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期起对在银行间市场的债券(不含可转换债券)按照中央国债登记结算有限责任公司根据《中证资产投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.2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,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	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
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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,035,184.67	8,034,464.36
其中:支付销售机构的客户维护费	37,793.74	89,528.81

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.7%÷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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,438,624.21	2,295,561.23

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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,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

单位:人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	49,986,671.92	118,800,458.08	-	-	-	-

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

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
报告期初持有的基金份额	192,677,263.97	-
报告期间申购/买入总份额	-	192,677,263.97
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-