

# 易方达岁丰添利债券型证券投资基金

## 2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 日

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

送出日期：二〇一四年三月二十八日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 24 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 2013 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	场外：易方达岁丰添利债券（LOF）；场内：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
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
报告期末基金份额总额	814,597,604.22 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	2010 年 12 月 3 日

### 2.2 基金产品说明

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、票息率及派息频率、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。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	唐州徽
	联系电话	020-38797888	95566

电子邮箱	csc@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400 881 8088	95566
传真	020-38799488	010-66594942

## 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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	74,723,499.65	200,775,921.16	50,107,357.70
本期利润	18,663,116.04	244,148,640.73	32,814,835.11
加权平均基金份额本期利润	0.0077	0.0911	0.0122
本期基金份额净值增长率	-0.30%	9.37%	1.19%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0312	0.0169	0.0074
期末基金资产净值	789,221,921.78	2,763,648,378.71	2,699,000,436.36
期末基金份额净值	0.969	1.032	1.007

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	-2.52%	0.20%	1.37%	0.02%	-3.89%	0.18%

过去六个月	-2.81%	0.19%	2.75%	0.02%	-5.56%	0.17%
过去一年	-0.30%	0.25%	5.45%	0.02%	-5.75%	0.23%
过去三年	10.34%	0.19%	17.23%	0.02%	-6.89%	0.17%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	11.44%	0.19%	17.96%	0.02%	-6.52%	0.17%

### 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

易方达岁丰添利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

(2010 年 11 月 9 日至 2013 年 12 月 31 日)



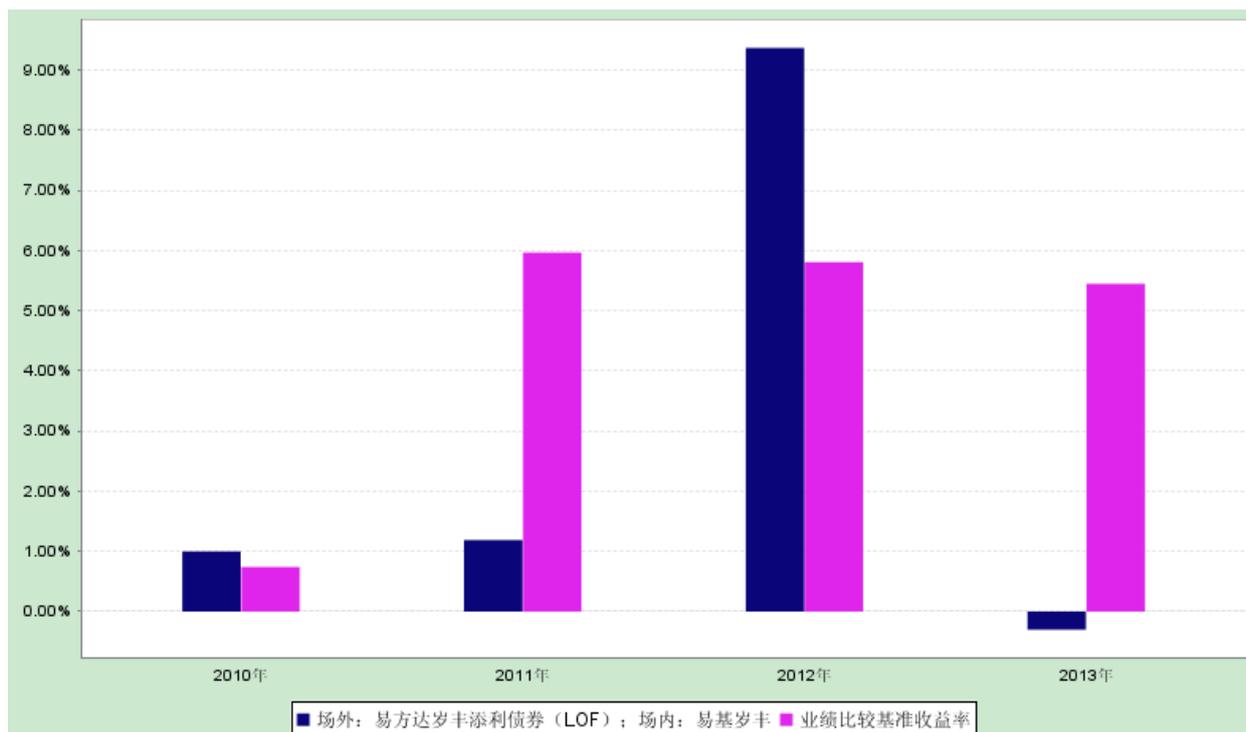
注：1. 按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十五部分（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制）的有关约定。

2. 自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 11.44%，同期业绩比较基准收益率为 17.96%。

### 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

易方达岁丰添利债券型证券投资基金

自基金合同生效以来每年净值增长率图



注：本基金合同生效日为 2010 年 11 月 9 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
2013年	0.620	166,105,126.13	-	166,105,126.13	-
2012年	0.670	179,500,698.38	-	179,500,698.38	-
2011年	0.150	40,186,721.41	-	40,186,721.41	-
合计	1.440	385,792,545.92	-	385,792,545.92	-

## § 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。截至 2013 年 12 月 31 日，公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、盈峰投资控股集团有限公司、广东省广晟资产经营有限公司和广州市广永国有资产经营有限公司。公司现有全国社保基金投资管理人、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务资格。

自成立以来，易方达基金管理有限公司秉承“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的增长”的经营理念，努力以规范的运作、良好的业绩和优质的服务，为投资者创造最佳的回报。

截至 2013 年 12 月 31 日，易方达基金管理有限公司共管理 1 只封闭式基金、54 只开放式基金。封闭式基金有科瑞证券投资基金；开放式基金有易方达平稳增长证券投资基金、易方达策略成长证券投资基金、易方达 50 指数证券投资基金、易方达积极成长证券投资基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达深证 100 交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型证券投资基金、易方达策略成长二号混合型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金、易方达科讯股票型证券投资基金、易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达中小盘股票型证券投资基金、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金、易方达科翔股票型证券投资基金、易方达行业领先企业股票型证券投资基金、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达亚洲精选股票型证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、易方达岁丰添利债券型证券投资基金、易方达医疗保健行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、易方达安心回报债券型证券投资基金、易方达资源行业股票型证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达双债增强债券型证券投资基金、易方达纯债债券型证券投资基金、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达中小板指数分级证券投资基金、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）、易方达月月理财债券型证券投资基金、易方达双月理财债券型证券投资基金、易方达天天理财货币市场基金、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金、易方达保证金收益货币市场基金、易方达信用债债券型证券投资基金、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金、易方达高等级信用债债券型证券投资基金、易方达裕丰回报债券型证券投资基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、易方达易理财货币市场基金、易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金、易方达新兴成长混合型证券投资基金、易方达黄金交易型开放式基金、易方达裕惠回报债券型证券投资基金。同时，公司还管理着多个全国社保基金、企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

#### 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		
钟鸣远	本基金的基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、固定收益总部总经理、固定收益投资部总经理	2010-11-09	-	13 年	硕士研究生，曾任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部投资经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益部研究员，新华资产管理股份有限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经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理、固定收益部总经理。
刘琦	本基金的基金经理、易方达永旭添利定期开放债	2013-04-02	-	5 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。

	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、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理				
--	---	--	--	--	--

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，钟鸣远的“任职日期”为基金合同生效之日，刘琦的“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。

3.根据 2014 年 1 月 18 日《易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理变更公告》、《易方达安心回报债券型证券投资基金基金经理变更公告》、《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金经理变更公告》、《易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理变更公告》，自 2014 年 1 月 18 日起钟鸣远不再担任易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达安心回报债券型证券投资基金、易方达岁丰添利债券型证券投资基金、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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；规范投资人员的指令下达方式，以确保同一投资人员管理的不同组合得到公平对待；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（纯被动指数基金除外）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，并经发起反向申请方的首席投资官/投资总监审批、集中交易室审核确认方可执行。

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、3日内、5日内），对我司旗下所有投资组合 2013 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、各组合与其同类资产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 17 次，其中 16 次为旗下指数基金因被动跟踪标的指数的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

2013 年，中国国内经济政策波动风险，经济增长动力一季度较好，二季度较差，三季度超预期回升，四季度缓慢回落，速度低于预期，总体增长稳定，通胀温和。期间，宏观调控政策相机抉择，一季度前期，货币信贷政策维持较为宽松的环境；两会召开前夕，出台新一轮房地产调控；两会明确释放出保持经济平稳增长，有序推进改革的信号；一季度末，有关监管当局对银行理财产品、地方融资平台进行规范整顿。二季度，政策基调稳中求进，继续调控房地产，整顿影子银行、规范债券市场，加强监管地方融资平台，抑制产能过剩行业不合理扩张。货币信贷及资金面波动加大，政策总体略有收紧。三季度政策略有倾向稳定和局部刺激经济增长，防止经济增长下滑突破下限。四季度政策积极推进改革，并在三中全会中提出超预期全面深化改革的方针政策。

本期内，资金面前松后紧，波动加大，债券市场收益率曲线上升，国债和银行间回购利率突破近十年高点。可转债和股票等权益市场，以及债券市场剧烈波动，创业板等中小市值股票大幅上涨，一般性债券与可转债双双大幅下跌。具体分季度，一季度，受宽松的货币政策和外围资本持续大量流入驱动，权益市场表现亮眼，债券市场供给受限，高息票债券也有正面表现。二季度，4 月前后，房地产调控等政策调整剧烈，市场急转而下，债券市场查整代持等事件对市场和业务操作也造成了负面影响。6 月份“钱荒”，权益资产和债券剧烈下跌。三季度，资金面的情况与上半年表现明显偏紧，债券市场继续下跌，10 年期国债收益率一度突破 4.7%，达到近十年高点，可转债市场月度间波动明显，总体下跌。进入四季度，债券市场再次出现剧烈调整，主要表现在城投债等高收益债券市场大幅下跌，利差有所扩大，可转债和股票市场也显著下跌。开放式债券型基金赎回急速增多。

本期内，基金根据对经济走势、政策以及资金面的变化判断，灵活调控组合资产配置。具体的，一季度，前期看好风险资产表现，增持可转债，并在季末进行减持，保持适度久期和杠杆水平。二季

度，组合逐步减持可转债投资，在债券市场下跌过程中增持利率型债券，拉长久期，同时持有信用债以获取持有期收益。三季度，组合大幅减持债券，增持货币市场投资工具。四季度，组合谨慎投资，维持偏低杠杆、短久期、及偏低可转债投资比例。

#### 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 0.969 元，本报告期份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为 5.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2014 年中国经济与投资环境，中国经济增长有继续下行风险，物价压力较小，宏观调控稳中求进，货币信贷政策基调稳健，总体中性，但资金面的感受总体偏紧。宏观调控政策中，稳增长需求较弱，在维持合理的经济增长率区间前提下，持续发力推进改革，且力求看到成效。中国经济中短期内，面临去杠杆压力、去产能压力，利率市场化等系列改革不可回辙，企业融资和银行拆借利率中枢抬高。国际经济方面，美国经济增长稳固，就业状况稳定好转，物价水平稳定，美联储量化宽松政策有序退出，大方向不会逆转，市场逐步消化，后续仍旧存在变数，退出速度由经济数据走势决定，预计全部退出在年底附近，而加息远远没有到来。欧元区经济继续衰退，欧洲央行预期将维持宽松政策，继续刺激经济，防范风险。总体上，国内外经济和政策仍旧较为复杂，变数较多，短期来看，国内经济增长暂时稳定，货币信贷政策中性偏紧，改革积极推进，但可能会付出一定成本，外围市场对美联储量化宽松政策退出的剧烈反应时期已经过去，投资者重新回到关注经济基本面，固定收益和权益类风险资产都存在一定机会。

经过 2013 年近一年调整、沟通和适应，金融市场对利率市场化和资金中枢抬高已经有较为明显预期和相应调整，金融资源扭曲配置有所缓解，2014 年资金面给市场紧张感将有所缓解，但并不意味着货币信贷状况将放松，经济转型是中长期的维度。通胀预期将继续受到抑制，收益率曲线过于平坦，短端相对优势仍旧较为明显，不同资质信用债利差预计继续分化。我们在债券资产投资上，将继续保持总体偏短久期及适度杠杆水平，投资一定比例协议存款等货币市场工具，获取一定持有期收益。具体品种方面，国债、金融债等利率品种因经济增长趋缓物价疲软有望获得一定交易型机会，资金利率抬高迫使市场机构投资者去杠杆，有利于协议存款投资，不利于信用利差收窄。可转债投资策略较为审慎，注意投资本金安全保护。

易方达岁丰添利基金下一阶段的操作将采取稳健的投资策略，保持适度的杠杆水平，灵活调整组合久期，同时努力把握国债、金融债、企业债、公司债，以及可转换债券在不同市场环境下的阶段性机会，力争以理想稳健的投资业绩回报基金持有人。

#### 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、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

根据相关法律法规及《易方达岁丰添利债券型证券投资基金合同》，本基金本报告期应分配利润 115,118,517.90 元，本报告期内已实施的利润分配 166,105,126.13 元，其中 2013 年 1 月 15 日（场外）、2013 年 1 月 16 日（场内）实施的利润分配 40,186,723.25 元是对 2012 年度的利润进行分配。

### § 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对易方达岁丰添利债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格

的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 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：易方达岁丰添利债券型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	317,459,866.61	7,693,777.70
结算备付金	29,302,159.50	41,548,805.09
存出保证金	711,225.98	26,782.00
交易性金融资产	677,004,754.92	4,439,405,531.22
其中：股票投资	7,814,400.00	99,764,726.52
基金投资	-	-
债券投资	663,628,754.92	4,329,640,804.70
资产支持证券投资	5,561,600.00	10,000,000.00
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	8,000,000.00	-
应收证券清算款	25,178,598.26	92,924,598.08

应收利息	18,438,361.25	68,905,721.74
应收股利	-	-
应收申购款	992.06	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,076,095,958.58	4,650,505,215.83
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2013年12月31日</b>	<b>上年度末 2012年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
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	281,798,629.25	1,831,459,486.96
应付证券清算款	-	50,066,414.33
应付赎回款	1,176,300.18	-
应付管理人报酬	493,786.27	1,614,001.56
应付托管费	141,081.79	461,143.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	186,524.23	40,659.74
应交税费	2,658,994.90	2,605,991.90
应付利息	28,165.82	219,139.34
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	390,554.36	390,000.00
负债合计	286,874,036.80	1,886,856,837.12
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	814,597,604.22	2,679,114,943.70
未分配利润	-25,375,682.44	84,533,435.01
所有者权益合计	789,221,921.78	2,763,648,378.71
负债和所有者权益总计	1,076,095,958.58	4,650,505,215.83

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.969 元，基金份额总额 814,597,604.22 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达岁丰添利债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12 月31日
一、收入	<b>92,314,208.28</b>	<b>326,170,781.32</b>

1. 利息收入	145,569,381.24	161,098,060.25
其中：存款利息收入	12,601,936.59	829,349.30
债券利息收入	129,635,314.28	160,116,274.34
资产支持证券利息收入	750,879.89	33,753.43
买入返售金融资产收入	2,581,250.48	118,683.18
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,369,276.12	121,700,001.50
其中：股票投资收益	-1,417,092.66	10,424,583.34
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,456,730.30	110,824,464.16
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	329,638.48	450,954.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-56,060,383.61	43,372,719.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	435,934.53	-
<b>减：二、费用</b>	<b>73,651,092.24</b>	<b>82,022,140.59</b>
1. 管理人报酬	17,358,371.87	19,235,173.33
2. 托管费	4,959,534.78	5,495,763.82
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	796,254.88	331,232.57
5. 利息支出	49,499,138.58	55,885,117.14
其中：卖出回购金融资产支出	49,499,138.58	55,885,117.14
6. 其他费用	1,037,792.13	1,074,853.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>18,663,116.04</b>	<b>244,148,640.73</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>18,663,116.04</b>	<b>244,148,640.73</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达岁丰添利债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1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）	2,679,114,943.70	84,533,435.01	2,763,648,378.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,663,116.04	18,663,116.04
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）	-1,864,517,339.48	37,532,892.64	-1,826,984,446.84
其中：1. 基金申购款	55,378.07	-1,097.68	54,280.39
2. 基金赎回款	-1,864,572,717.55	37,533,990.32	-1,827,038,727.23
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）	-	-166,105,126.13	-166,105,126.13
五、期末所有者权益（基金净值）	814,597,604.22	-25,375,682.44	789,221,921.78
项目	上年度可比期间		
	2012年1月1日至2012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）	2,679,114,943.70	19,885,492.66	2,699,000,436.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	244,148,640.73	244,148,640.73
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）	-	-179,500,698.38	-179,500,698.38
五、期末所有者权益（基金净值）	2,679,114,943.70	84,533,435.01	2,763,648,378.71

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

易方达岁丰添利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[2010]第 1358 号《关于核准易方达岁丰添利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《易方达岁丰添利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，《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》于 2010 年 11 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,679,114,943.70 份基金份额，其中认购资金利息折合 328,024.37 份基金份额。本基金为契约型基金，基金合同生效后三年内（含

三年)为封闭期,封闭期结束后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》和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

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
中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)	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 2013年1月1日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,358,371.87	19,235,173.33
其中: 支付销售机构的客户维护费	488,832.39	774,264.49

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

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,959,534.78	5,495,763.82

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

#### 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						
2013年1月1日至2013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
中国银行	-	110,820,183.80	-	-	282,870,000.00	121,410.02
上年度可比期间						
2012年1月1日至2012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
中国银行	-	31,150,274.43	-	-	1,377,370,000.00	539,318.46

#### 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自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自有资金投资本基金。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
广发期货有限 公司	20,001,800.00	2.46%	20,001,800.00	0.75%

注：广发期货有限公司是基金管理人股东广发证券控制的机构。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	7,459,866.61	370,733.39	7,693,777.70	319,713.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中银国际证 券有限责任 公司	04135202 2	13 正泰 CP001	分销	300,000	30,000,000.00
广发证券、中 银国际证 券有限责 任公司	1382239	13 文峰 MTN2	分销	200,000	20,000,000.00
广发证券	1382252	13 中条山 MTN1	分销	200,000	19,980,000.00
广发证券	112177	13 围海债	分销	45,000	4,500,000.00
上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	002663	普邦园林	公开发行	790,000	23,700,000.00
广发证券	300335	迪森股份	公开发行	1,180,000	16,461,000.00
广发证券	112072	12 湘鄂债	分销	200,000	20,000,000.00
广发证券	112083	11 国星债	分销	55,000	5,500,000.00
广发证券	122151	12 国电 01	分销	700,000	70,000,000.00
广发证券	122165	12 国电 03	分销	500,000	50,000,000.00
广发证券	1280076	12 芜湖建投债 01	分销	250,000	25,000,000.00
广发证券	1280128	12 渝地产债	分销	250,000	25,000,000.00
广发证券	1282527	12 鲁宏桥 MTN1	分销	200,000	20,000,000.00

注：中银国际证券有限责任公司是与中国银行存在重大利害关系的公司。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 67,899,726.05 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
130201	13 国开 01	2014-01-02	99.99	500,000	49,995,000.00
1382177	13 沙钢 MTN1	2014-01-02	93.67	200,000	18,734,000.00
合计		-	-	700,000	68,729,000.00

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 213,898,903.20 元，于 2014 年 1 月 2 日、2014 年 1 月 3 日、2014 年 1 月 6 日、2014 年 1 月 7 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 385,179,654.92 元，属于第二层级的余额为 291,825,100.00 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 2,928,674,031.22 元，第二层级 1,510,731,500.00 元，无属于第三层级的余额)。

##### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等交易不活跃情况、或属于非公开发行等情况，本基金于上述事项影响期间不将相关股票的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层级或第三层级。

##### (iv) 第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金本报告期初未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2012 年期初：同)；本基金本期净转入/(转出)第三层级 0.00 元(2012 年度：无)。

##### (2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,814,400.00	0.73
	其中：股票	7,814,400.00	0.73
2	固定收益投资	669,190,354.92	62.19
	其中：债券	663,628,754.92	61.67
	资产支持证券	5,561,600.00	0.52
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	8,000,000.00	0.74
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	346,762,026.11	32.22
6	其他各项资产	44,329,177.55	4.12
7	合计	1,076,095,958.58	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,814,400.00	0.99
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	-	-
J	金融业	-	-
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	7,814,400.00	0.99

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300335	迪森股份	440,000	7,814,400.00	0.99

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	118,398,352.08	4.28
2	600886	国投电力	53,140,311.35	1.92
3	600674	川投能源	49,055,900.52	1.78
4	601398	工商银行	16,699,713.63	0.60
5	600422	昆明制药	15,321,520.90	0.55
6	600521	华海药业	4,460,825.25	0.16

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	108,015,141.87	3.91
2	600886	国投电力	52,523,105.12	1.90
3	600674	川投能源	48,859,566.95	1.77
4	002663	普邦园林	35,436,344.47	1.28
5	600815	厦工股份	19,904,144.15	0.72
6	300335	迪森股份	18,665,083.79	0.68
7	601398	工商银行	16,784,699.45	0.61
8	002662	京威股份	15,628,977.92	0.57

9	600422	昆明制药	12,570,284.18	0.45
10	002667	鞍重股份	5,946,892.05	0.22
11	600521	华海药业	5,929,031.28	0.21

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	257,076,623.73
卖出股票收入（成交）总额	340,263,271.23

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,995,000.00	6.33
	其中：政策性金融债	49,995,000.00	6.33
4	企业债券	410,178,320.52	51.97
5	企业短期融资券	20,168,000.00	2.56
6	中期票据	104,939,000.00	13.30
7	可转债	78,348,434.40	9.93
8	其他	-	-
9	合计	663,628,754.92	84.09

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110022	同仁转债	529,260	66,125,744.40	8.38
2	130201	13 国开 01	500,000	49,995,000.00	6.33
3	122087	11 凌钢债	451,530	42,850,197.00	5.43
4	124147	13 甬东投	429,600	42,100,800.00	5.33
5	1382239	13 文峰 MTN2	400,000	38,304,000.00	4.85

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	119029	澜沧江 1	55,616	5,561,600.00	0.70

**8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 投资组合报告附注**

**8.11.1** 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。

**8.11.2** 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。

**8.11.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	711,225.98
2	应收证券清算款	25,178,598.26
3	应收股利	-
4	应收利息	18,438,361.25
5	应收申购款	992.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,329,177.55

## 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	66,125,744.40	8.38
2	110016	川投转债	3,766,800.00	0.48
3	110018	国电转债	2,743,790.00	0.35

## 8.11.5 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。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
2,313	352,182.28	686,066,663.68	84.22%	128,530,940.54	15.78%

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国石油化工集团公司企业年金计划—中国工商银行	68,104,798.00	12.29%
2	中油财务有限责任公司	48,757,600.00	8.80%
3	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金—012G—ZY001 深	41,550,800.00	7.50%
4	中国通用技术(集团)控股有限责任公司	32,091,557.00	5.79%
5	中银保险有限公司	22,715,365.00	4.10%
6	中国石油天然气集团公司企业年金计划—中国工商银行	22,359,051.00	4.04%
7	光大资管—光大—光大阳光北斗星集合资产管理计划	22,133,800.00	3.99%
8	中国银行股份有限公司企业年金	20,279,200.00	3.66%

	计划—中国农业银行		
9	广发期货有限公司	20,001,800.00	3.61%
10	中国南方电网公司企业年金计划 —中国工商银行	18,743,200.00	3.38%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,988.50	0.0002%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年11月9日)基金份额总额	2,679,114,943.70
本报告期期初基金份额总额	2,679,114,943.70
本报告期基金总申购份额	55,378.07
减：本报告期基金总赎回份额	1,864,572,717.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	814,597,604.22

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2013 年 7 月 12 日发布公告，自 2013 年 7 月 12 日起聘任马骏先生担任公司副总经理；本基金管理人于 2013 年 12 月 17 日发布公告，自 2013 年 12 月 16 日起陈志民先生不再担任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

2013 年 3 月 17 日中国银行股份有限公司公告，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。

2013 年 6 月 1 日中国银行股份有限公司公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 4 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 90,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	264,585,973.00	77.76%	240,879.07	77.83%	-
平安证券	1	75,677,298.23	22.24%	68,598.26	22.17%	-

注：a) 本报告期内本基金无新增和减少交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元

的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	9,403,873,046.12	85.56%	107,236,600,000.00	85.58%	-	-
平安证券	1,586,582,428.53	14.44%	18,072,576,000.00	14.42%	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一四年三月二十八日