

# 易方达安心回馈混合型证券投资基金

## 2015 年年度报告

2015 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 重要提示及目录

### 1.1 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 5 月 29 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6	审计报告	16
6.1	管理层对财务报表的责任	16
6.2	注册会计师的责任	16
6.3	审计意见	16
§ 7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4	报表附注	21
§ 8	投资组合报告	41
8.1	期末基金资产组合情况	41
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	42
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	43
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	45
8.6	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	45

8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	46
8.8	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贵金属投资明细 .....	46
8.9	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 .....	46
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	46
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
8.12	投资组合报告附注 .....	46
§ 9	基金份额持有人信息 .....	47
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	48
§ 10	开放式基金份额变动 .....	48
§ 11	重大事件揭示 .....	48
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
11.4	基金投资策略的改变 .....	48
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	49
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
11.8	其他重大事件 .....	50
§ 12	备查文件目录 .....	51
12.1	备查文件目录 .....	51
12.2	存放地点 .....	52
12.3	查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达安心回馈混合型证券投资基金
基金简称	易方达安心回馈混合
基金主代码	001182
交易代码	001182
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 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	2,069,641,874.48 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。本基金将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率、存款利率和融资成本，判断利差空间，力争通过适当杠杆操作提高组合收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结</p>

	构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，追求股票投资组合的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times 25\%$ + 中债新综合指数收益率 $\times 70\%$ + 金融机构人民币活期存款基准利率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期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。

### 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	洪渊
	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
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	姜建清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40 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 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	30,757,875.36
本期利润	76,142,756.24
加权平均基金份额本期利润	0.0246
本期加权平均净值利润率	2.44%
本期基金份额净值增长率	5.60%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	69,107,336.91
期末可供分配基金份额利润	0.0334
期末基金资产净值	2,186,251,568.90
期末基金份额净值	1.056
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	5.60%

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.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4.本基金合同于 2015 年 5 月 29 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

#### 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	4.35%	0.13%	6.05%	0.41%	-1.70%	-0.28%
过去六个月	5.39%	0.13%	-0.32%	0.67%	5.71%	-0.54%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-

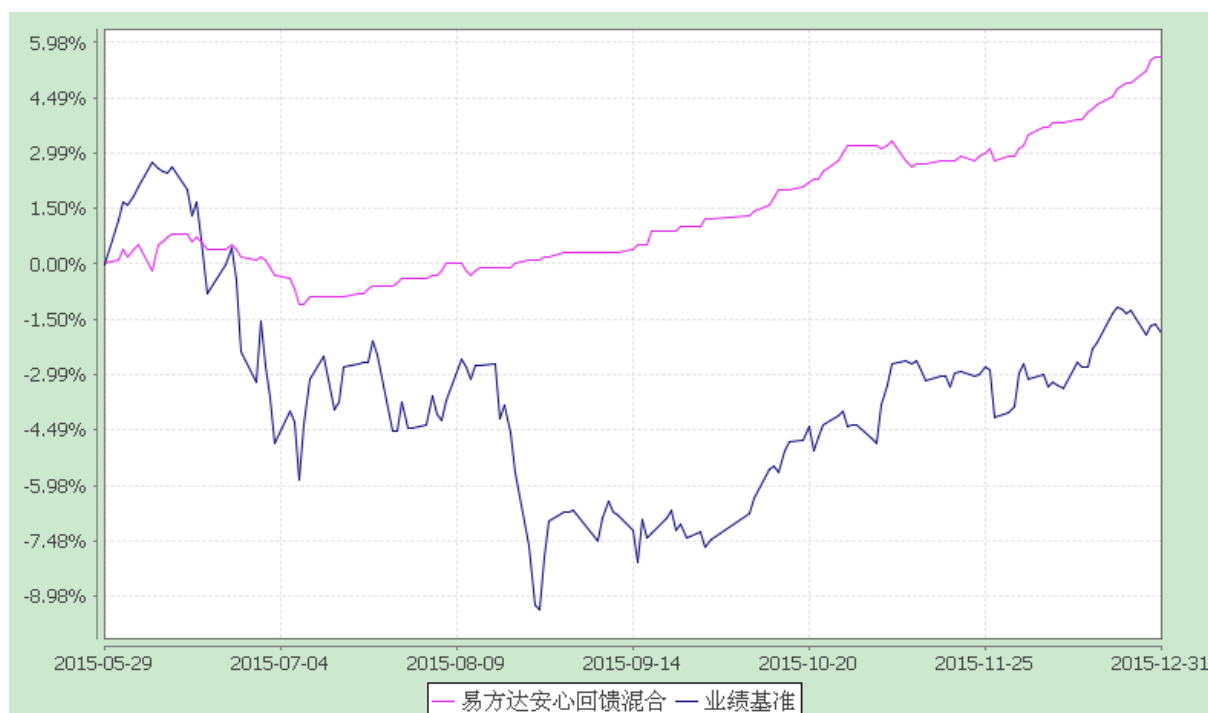
自基金合同生效起至今	5.60%	0.15%	-1.87%	0.70%	7.47%	-0.55%
------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

### 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

易方达安心回馈混合型证券投资基金

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

(2015 年 5 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日)



注：1.本基金合同于 2015 年 5 月 29 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.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。

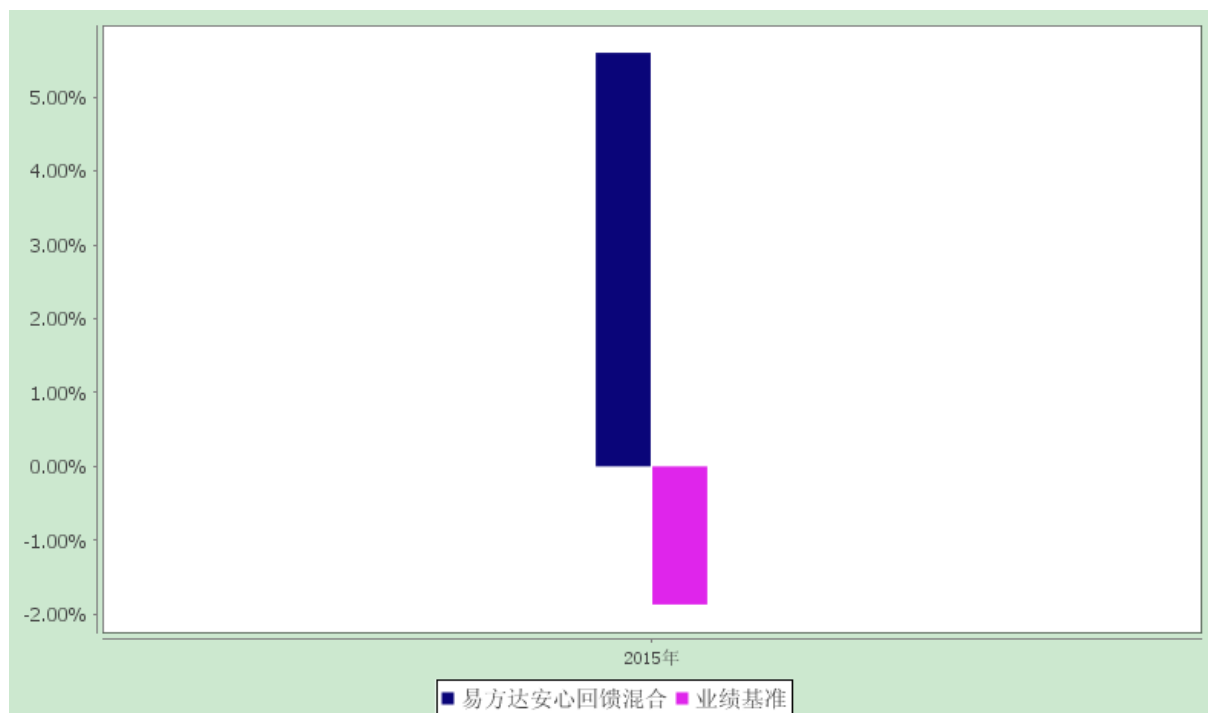
3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 5.60%，同期业绩比较基准收益率为 -1.87%。

### 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

易方达安心回馈混合型证券投资基金

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 2015 年 5 月 29 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

本基金自基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 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		
张清华	本基金的基金经理、易方达瑞选灵活配置混合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、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合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、固定收益基金投资部总经理	2015-05-29	-	8 年	硕士研究生，曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员、易方达基金管理有限公司投资经理。
林森	本基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2015 年 6 月 11 日至 2015 年 11 月 27 日）、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2015-11-28	-	5 年	硕士研究生，曾任道富银行风险管理部风险管理经理、外汇利率交易部利率交易员，太平洋资产管理公司基金管理部基金经理、易方达基金管理有限公司投资经理。
张雅君	本基金的基金经理助理、易方达中债 3-5 年期国债指数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、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理、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、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达投资级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、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理	2015-06-11	-	6 年	硕士研究生，曾任海通证券股份有限公司项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员、固定收益研究员。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，张清华的“任职日期”为基金合同生效之日，林森、张雅君的“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；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 年国内经济总体处于缓慢探底的势态，反映在经济数据上：全年国内生产总值按可比价格计算比上年增长 6.9%，全年全国规模以上工业增加值按可比价格计算比上年增长 6.1%，2015 年全年固定资产投资增速继续回落，相比上年名义增长 10.0%，扣除价格因素实际增长 12.0%，实际增速比上年回落 2.9 个百分点。全年社会消费品零售总额比上年名义增长 10.7%，扣除价格因素实际增长 10.6%。全年进出口总额比上年下降 7.0%，其中出口总额下降 1.8%，进口总额下降 13.2%。全年居民消费价格比上年上涨 1.4%。工业生产者出厂价格比上年下降 5.2%。全年货币信贷平稳增长，M2 年末余额比上年末增长 13.3%。然而，我们也注意到经济中的一些亮点，国内产业结构继续优化、区域结构协调性增强以及节能降耗继续取得进展。体现在数据上，工业领域的新产业增长较快，全年高技术产业增加值比上年增长 10.2%，占规模以上工业比重为 11.8%，比上年提高 1.2 个百分点。2015 年是经济发展进入新常态的一年，也是金融领域的改革继续深入推进的一年。这一年利率市场化改革基本完成、在中国人民银行完善人民币中间价报价机制后人民币成功地加入 SDR，新股发行注册制也有望在不久的将来启动。2015 年也是资本市场剧烈动荡的一年，波澜壮阔的 A 股牛市戛然而止、人民币汇率贬值预期增加、外汇储备开始下降。中国人民银行在 2015 年 5 次下调金融机构人民币贷款和存款基准利率、5 次下调金融机构人民币存款准备金率，在宽松的货币政策下，国内债券市场延续了牛市的格局。尽管收益率曲线平坦化下行，但过剩产能行业信用利差伴随着债券违约

事件而有所扩大。本基金把握住了 15 年债券收益率整体下行的行情，适当的运用了杠杆，利用较长的有效久期，获得了较高的收益。同时本基金也积极参与新股申购，新股的上涨也进一步增厚了组合回报。

#### 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 1.056 元，本报告期份额净值增长率为 5.60%，同期业绩比较基准收益率为-1.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对 2016 年的债券市场持谨慎乐观态度。我们判断央行在今年的工作重心是人民币汇率的稳定，因此将维持稳健的货币政策，也就是“为结构性改革营造适宜的货币金融环境，降低融资成本，既要防止顺周期紧缩，也绝不要随便放水，而是针对金融市场的变化进行预调微调，保持流动性合理充裕和社会融资总量适度增长。”基于我们对货币政策的理解，央行维护回购利率走廊的上限是一个大概率事件，而降息降准的频率和力度则会低于 2015 年，因此，债券市场较为确定的机会在于中端和短端的息差套利，长端的风险则相对较高。资本市场价格的波动往往来自于现实和预期的差距，目前市场对中国经济走向的预期较为悲观。虽然部分行业在短期内存在去产能、去杠杆的压力，但我们也对中国经济转型的成功充满了信心。我们既看到在困境中挣扎的过剩产能行业，也看到了欣欣向荣蓬勃发展的服务业。资本市场经历了危机之后，我们看到全行业包括监管机构都在进行深刻的反思。在一些短期措施之后，中国资本市场仍在坚定不移的走市场化的道路。无论是金融机构还是监管者都在风雨之后变得更加成熟。从历史上看，过去 30 年，看空中国的投资者仅有的收益是稿费，而理性看多与价值投资则为投资者带来了实实在在的回报。

综上所述，本基金未来将以中高等级、中短久期的信用债为主要配置品种，积极运用杠杆策略，获取持有期收益。我们将继续积极参与新股发行，在风险可控的情况下参与权益市场，增厚持有人的收益。

基金管理人将坚持规范运作、审慎投资，勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、防控内幕交易等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内

控环境。

(2) 严守合规底线、管好合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育及考试谈话，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易和市场操纵等违法违规行为，完善利益冲突管理相关制度机制。

(3) 坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具、新投资策略的推出和应用，重点加强对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保了旗下基金资产严格按照法律法规和基金合同的要求稳健、规范运作。

(4) 对投资交易、销售宣传、人员规范及个人投资申报、运营维稳、反洗钱、客户服务、IT 治理等方面开展了一系列专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

(6) 督促落实销售适当性管理制度，推动完善客户投诉处理机制流程。

(7) 深入贯彻风险为本的监管精神，加强公司洗钱风险管理体系建设，建立优化客户、产品、业务的洗钱风险识别和洗钱风险自评估工作机制，探索实施符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，开展反洗钱系统开发测试、宣传培训、内部审计、信息报送、问题调研与意见反馈等各项工作。

(8) 紧跟法规变化和业务发展，认真做好公司及旗下各基金的各项信息披露工作，力求信息披露真实、完整、准确、及时、简明易懂。

(9) 不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，使合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性得到提升。

2015 年，公司按计划继续开展了 ISAE3402（《鉴证业务国际准则第 3402 号》）认证项目；同时，公司顺利通过了 GIPS（全球投资业绩标准）认证。通过开展上述外部审计鉴证及认证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升公司核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

### § 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，本基金托管人在对易方达安心回馈混合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，易方达安心回馈混合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安心回馈混合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。

#### 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安心回馈混合型证券投资基金 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

普华永道中天审字(2016)第 21037 号

易方达安心回馈混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的易方达安心回馈混合型证券投资基金的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述易方达安心回馈混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达安心回馈混合型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。



陈玲 沈兆杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2016-03-18

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：易方达安心回馈混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	11,292,887.47
结算备付金		1,141,582.46
存出保证金		271,944.50
交易性金融资产	7.4.7.2	2,847,672,006.30
其中：股票投资		71,133,684.83
基金投资		-
债券投资		2,776,538,321.47
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		5,611,025.42
应收利息	7.4.7.5	61,175,057.24
应收股利		-
应收申购款		1,148,604.26
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-

<b>资产总计</b>		<b>2,928,313,107.65</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		729,243,023.63
应付证券清算款		10,119,917.87
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,576,492.16
应付托管费		437,914.49
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	322,592.59
应交税费		-
应付利息		127,598.01
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	234,000.00
<b>负债合计</b>		<b>742,061,538.75</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	2,069,641,874.48
未分配利润	7.4.7.10	116,609,694.42
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,186,251,568.90</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,928,313,107.65</b>

注：1.本基金合同生效日为 2015 年 5 月 29 日，2015 年度实际报告期间为 2015 年 5 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2. 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.056 元，基金份额总额 2,069,641,874.48 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达安心回馈混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>106,806,338.52</b>
1.利息收入		87,687,895.54
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,019,973.75
债券利息收入		79,885,834.51
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,782,087.28
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-41,128,355.90
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-85,521,544.51
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	44,303,934.52
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	89,254.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	45,384,880.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	14,861,918.00
<b>减：二、费用</b>		<b>30,663,582.28</b>
1. 管理人报酬		16,585,838.95
2. 托管费		4,607,177.49

3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	973,035.73
5. 利息支出		8,231,992.06
其中：卖出回购金融资产支出		8,231,992.06
6. 其他费用	7.4.7.19	265,538.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>76,142,756.24</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>76,142,756.24</b>

注：本基金合同生效日为 2015 年 5 月 29 日，2015 年度实际报告期间为 2015 年 5 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达安心回馈混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）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）	207,386,846.12	-	207,386,846.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	76,142,756.24	76,142,756.24
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）	1,862,255,028.36	40,466,938.18	1,902,721,966.54
其中：1.基金申购款	5,751,404,357.55	46,166,312.45	5,797,570,670.00

2.基金赎回款	-3,889,149,329.19	-5,699,374.27	-3,894,848,703.46
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,069,641,874.48	116,609,694.42	2,186,251,568.90

注：本基金合同生效日为 2015 年 5 月 29 日，2015 年度实际报告期间为 2015 年 5 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

易方达安心回馈混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015] 433 号《关于准予易方达安心回馈混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，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《易方达安心回馈混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达安心回馈混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 207,386,846.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,209.45 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2015 年 5 月 25 日至 2015 年 5 月 27 日，募集金额总额为人民币 207,386,846.12 元，其中：有效净认购金额为人民币 207,370,636.67 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 16,209.45 元，经安永华明（2015）验字第 60468000\_G17 号验资报告予以审验。

### 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》、《易方达安心回馈混合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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原



则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)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会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	11,292,887.47
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	11,292,887.47

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		61,428,742.81	71,133,684.83	9,704,942.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	100,888,679.89	103,176,321.47	2,287,641.58
	银行间市场	2,639,969,702.72	2,673,362,000.00	33,392,297.28
	合计	2,740,858,382.61	2,776,538,321.47	35,679,938.86
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,802,287,125.42	2,847,672,006.30	45,384,880.88

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
	应收活期存款利息
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	513.70

应收债券利息	61,127,288.64
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	122.30
合计	61,175,057.24

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	244,654.72
银行间市场应付交易费用	77,937.87
合计	322,592.59

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	234,000.00
合计	234,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	207,386,846.12	207,386,846.12
本期申购	5,751,404,357.55	5,751,404,357.55

本期赎回（以“-”号填列）	-3,889,149,329.19	-3,889,149,329.19
本期末	2,069,641,874.48	2,069,641,874.48

注：1.本基金合同于 2015 年 5 月 29 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 207,386,846.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,209.45 份基金份额。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	30,757,875.36	45,384,880.88	76,142,756.24
本期基金份额交易产生的变动数	38,349,461.55	2,117,476.63	40,466,938.18
其中：基金申购款	4,614,980.11	41,551,332.34	46,166,312.45
基金赎回款	33,734,481.44	-39,433,855.71	-5,699,374.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,107,336.91	47,502,357.51	116,609,694.42

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,420,897.77
定期存款利息收入	4,500,521.10
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	96,934.43
其他	1,620.45
合计	6,019,973.75

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

	日
卖出股票成交总额	233,770,631.79
减：卖出股票成本总额	319,292,176.30
买卖股票差价收入	-85,521,544.51

#### 7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,464,847,550.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,242,128,866.68
减：应收利息总额	178,414,749.14
买卖债券差价收入	44,303,934.52

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	89,254.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	89,254.09

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
1.交易性金融资产	45,384,880.88
——股票投资	9,704,942.02
——债券投资	35,679,938.86
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	45,384,880.88

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
基金赎回费收入	14,855,719.00
其他	6,199.00
合计	14,861,918.00

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
交易所市场交易费用	869,460.73
银行间市场交易费用	103,575.00
合计	973,035.73

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	174,000.00
银行汇划费	24,938.05
银行间账户维护费	6,000.00
其他	600.00
合计	265,538.05

**7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9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、注册登记机构、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
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。

#### 7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2关联方报酬

###### 7.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,585,838.95
其中：支付销售机构的客户维护费	405.87

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.90% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

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



基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,607,177.49

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 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5月29日（基金合同生效日）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
中国工商银行	400,467,698.61	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

无。

##### 7.4.10.5 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

	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	11,292,887.47	1,420,897.77

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

#### 7.4.10.6 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 2015年5月29日（基金合同生效日）至2015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	127253	15 粤电 01	分销	500,000	50,000,000.00
广发证券	1580182	15 长沙轨道 债 02	分销	800,000	80,000,000.00

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位： 股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002778	高科石化	2015-12-28	2016-01-06	新股流通受限	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-
002781	奇信股份	2015-12-16	2016-12-22	老股转让流通受限	13.31	37.37	204,545	2,722,493.95	7,643,846.65	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-01-08	新发流通受限	99.99	99.99	6,520	651,964.27	651,964.27	-

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002465	海格通信	2015-12-30	重大事项停牌	16.69	2016-02-04	15.02	150,000	2,605,262.59	2,503,500.00	-
600654	中安消	2015-12-14	重大事项停牌	28.84	-	-	60,500	2,602,437.04	1,744,820.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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 704,243,023.63 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
011519006	15 国电 SCP006	2016-01-04	100.34	1,000,000	100,340,000.00
101555012	15 杭实投 MTN001	2016-01-04	102.38	360,000	36,856,800.00
1280177	12 锦城投债	2016-01-04	85.41	300,000	25,623,000.00
1382159	13 鞍钢 MTN1	2016-01-04	100.86	20,000	2,017,200.00
1480200	14 衢州国资债	2016-01-04	110.65	400,000	44,260,000.00
1480468	14 宏桥债 02	2016-01-04	111.73	220,000	24,580,600.00
1480472	14 浏阳城建债	2016-01-04	110.45	200,000	22,090,000.00
1580182	15 长沙轨道债 02	2016-01-04	107.39	800,000	85,912,000.00

110410	11 农发 10	2016-01-05	100.79	100,000	10,079,000.00
1182324	11 河钢 MTN3	2016-01-05	100.89	1,000,000	100,890,000.00
140210	14 国开 10	2016-01-05	111.63	100,000	11,163,000.00
1480033	14 六盘水开 投债	2016-01-05	111.29	1,300,000	144,677,000.00
1480044	14 怀化债 02	2016-01-05	115.00	225,000	25,875,000.00
150408	15 农发 08	2016-01-05	101.65	1,100,000	111,815,000.00
150415	15 农发 15	2016-01-05	103.49	100,000	10,349,000.00
合计				7,225,000	756,527,600.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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 25,000,000.00 元, 于 2016 年 1 月 4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合, 全面管理、专业分工”的思路, 将风险控制嵌入到全公司的组织架构中, 对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看, 投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控, 并根据其不同权限实施风险控制; 从岗位职能的分工上看, 基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理; 从投资管理的流程看, 已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司, 在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 93.73%。

## 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年12月31日
A-1	29,987,131.15
A-1 以下	0.00
未评级	343,819,292.16
合计	373,806,423.31

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

## 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年12月31日
AAA	349,891,167.12
AAA 以下	1,437,016,177.70
未评级	676,951,841.98
合计	2,463,859,186.80

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

## 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除 7.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

## 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

## 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,292,887.47	-	-	-	11,292,887.47
结算备付金	1,141,582.46	-	-	-	1,141,582.46
存出保证金	271,944.50	-	-	-	271,944.50
交易性金融资产	524,383,000.00	1,071,908,800.00	1,180,246,521.47	71,133,684.83	2,847,672,006.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,611,025.42	5,611,025.42
应收利息	-	-	-	61,175,057.24	61,175,057.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,148,604.26	1,148,604.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	537,089,414.43	1,071,908,800.00	1,180,246,521.47	139,068,371.75	2,928,313,107.65
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	729,243,023.63	-	-	-	729,243,023.63
应付证券清算款	-	-	-	10,119,917.87	10,119,917.87

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,576,492.16	1,576,492.16
应付托管费	-	-	-	437,914.49	437,914.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	322,592.59	322,592.59
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	127,598.01	127,598.01
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	234,000.00	234,000.00
负债总计	729,243,023.63	-	-	12,818,515.12	742,061,538.75
利率敏感度缺口	-192,153,609.20	1,071,908,800.00	1,180,246,521.47	126,249,856.63	2,186,251,568.90

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2015 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	19,826,802.09
	2.市场利率上升 25 个基点	-19,560,037.91

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	71,133,684.83	3.25
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	71,133,684.83	3.25

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)
		本期末 2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	2,915,590.95
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,915,590.95

注：股票投资部分业绩基准取上证 A 指。

#### 7.4.14 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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次的余额为 68,540,992.30 元，属于第二层次的余额为 2,779,131,014.00 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、



或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；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次还是第三层次。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），本基金于 2015 年 3 月 19 日起改为采用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》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)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。

(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	71,133,684.83	2.43
	其中：股票	71,133,684.83	2.43
2	固定收益投资	2,776,538,321.47	94.82
	其中：债券	2,776,538,321.47	94.82
	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	12,434,469.93	0.42
7	其他各项资产	68,206,631.42	2.33
8	合计	2,928,313,107.65	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	53,608,180.55	2.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,643,846.65	0.35
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	9,549,960.98	0.44
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	109,392.21	0.01
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	71,133,684.83	3.25
--	----	---------------	------

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000651	格力电器	809,900	18,101,265.00	0.83
2	002781	奇信股份	204,545	7,643,846.65	0.35
3	000959	首钢股份	1,599,904	6,527,608.32	0.30
4	002035	华帝股份	250,000	4,445,000.00	0.20
5	600498	烽火通信	145,000	4,133,950.00	0.19
6	600804	鹏博士	155,000	3,676,600.00	0.17
7	002518	科士达	100,000	3,530,000.00	0.16
8	601567	三星医疗	189,951	2,881,556.67	0.13
9	300017	网宿科技	45,800	2,747,542.00	0.13
10	002008	大族激光	100,000	2,589,000.00	0.12
11	600703	三安光电	104,994	2,549,254.32	0.12
12	002465	海格通信	150,000	2,503,500.00	0.11
13	002475	立讯精密	75,000	2,396,250.00	0.11
14	002055	得润电子	60,000	2,319,600.00	0.11
15	600654	中安消	60,500	1,744,820.00	0.08
16	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.04
17	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.02
18	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.01
19	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.01
20	002786	银宝山新	9,630	263,476.80	0.01
21	002780	三夫户外	3,566	222,304.44	0.01
22	002787	华源包装	10,011	163,880.07	0.01
23	300494	盛天网络	6,251	162,901.06	0.01
24	603299	井神股份	23,499	124,779.69	0.01
25	300492	山鼎设计	6,219	109,392.21	0.01
26	300490	华自科技	7,127	93,292.43	0.00
27	300491	通合科技	6,015	90,766.35	0.00
28	002785	万里石	12,000	70,080.00	0.00
29	002778	高科石化	5,600	47,600.00	0.00

### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	600037	歌华有线	38,551,725.04	1.76
2	002658	雪迪龙	37,775,424.71	1.73
3	600559	老白干酒	31,724,163.49	1.45
4	600617	国新能源	30,196,814.99	1.38
5	002510	天汽模	27,621,766.63	1.26
6	000498	山东路桥	19,787,127.95	0.91
7	000651	格力电器	14,989,891.51	0.69
8	603306	华懋科技	10,994,141.00	0.50
9	600654	中安消	10,990,457.24	0.50
10	002035	华帝股份	10,985,948.82	0.50
11	603099	长白山	9,919,365.00	0.45
12	002284	亚太股份	8,321,374.67	0.38
13	600703	三安光电	7,562,920.47	0.35
14	600498	烽火通信	7,542,454.70	0.34
15	601567	三星医疗	7,479,103.98	0.34
16	600804	鹏博士	7,387,468.48	0.34
17	000959	首钢股份	6,109,335.36	0.28
18	002465	海格通信	5,210,525.18	0.24
19	002475	立讯精密	5,203,476.00	0.24
20	002008	大族激光	5,065,634.64	0.23

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002658	雪迪龙	27,140,165.49	1.24
2	600617	国新能源	24,891,756.19	1.14
3	600037	歌华有线	22,140,115.36	1.01
4	600559	老白干酒	19,642,930.12	0.90
5	002510	天汽模	18,131,792.00	0.83
6	000498	山东路桥	8,697,278.38	0.40
7	002284	亚太股份	7,289,791.49	0.33
8	002035	华帝股份	7,244,291.00	0.33
9	600654	中安消	7,106,963.05	0.33
10	603306	华懋科技	5,458,388.00	0.25
11	600703	三安光电	5,358,743.86	0.25
12	601567	三星医疗	4,671,796.67	0.21
13	300152	科融环境	4,161,944.00	0.19

14	600159	大龙地产	4,147,099.00	0.19
15	000785	武汉中商	4,093,257.00	0.19
16	600498	烽火通信	3,975,571.00	0.18
17	300070	碧水源	3,776,203.00	0.17
18	603099	长白山	3,677,960.00	0.17
19	600596	新安股份	3,559,902.00	0.16
20	002631	德尔未来	3,270,242.00	0.15

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	380,720,919.11
卖出股票收入（成交）总额	233,770,631.79

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	30,039,000.00	1.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	739,560,000.00	33.83
	其中：政策性金融债	739,560,000.00	33.83
4	企业债券	1,137,645,000.00	52.04
5	企业短期融资券	260,530,000.00	11.92
6	中期票据	606,176,000.00	27.73
7	可转债（可交换债）	2,588,321.47	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,776,538,321.47	127.00

#### 8.6 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

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	1480033	14 六盘水 开投债	1,300,000	144,677,000.00	6.62
2	150408	15 农发 08	1,100,000	111,815,000.00	5.11
3	140203	14 国开 03	900,000	101,448,000.00	4.64
4	1182324	11 河钢 MTN3	1,000,000	100,890,000.00	4.61
5	011519006	15 国电 SCP006	1,000,000	100,340,000.00	4.59

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**8.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 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。

**8.10 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。

**8.11 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。

**8.12 投资组合报告附注**

8.12.1 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。

8.12.2 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。

**8.12.3 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	271,944.50
2	应收证券清算款	5,611,025.42
3	应收股利	-
4	应收利息	61,175,057.24
5	应收申购款	1,148,604.26

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,206,631.42

**8.12.4 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	110031	航信转债	1,003,663.20	0.05

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002781	奇信股份	7,643,846.65	0.35	老股转让流通受限

**§ 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
476	4,347,987.13	2,058,641,537.83	99.47%	11,000,336.65	0.53%

**9.2 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	234,266.19	0.0113%

本基金		
-----	--	--

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2015年5月29日)基金份额总额	207,386,846.12
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,751,404,357.55
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,889,149,329.19
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,069,641,874.48

注：本基金合同生效日为 2015 年 05 月 29 日。

**§ 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**

2015 年 6 月 2 日，本基金管理人完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任总经理刘晓艳。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

**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 60,000.00 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	
中信建投	1	297,842,317.18	49.31%	272,947.90	49.36%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	306,192,027.57	50.69%	279,972.24	50.64%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增长城证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司各一个交易单元，新增长江证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司各两个交易单元。

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
中信建投	-	-	665,074,000.00	4.80%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,027,241,859.49	100.00%	13,203,400,000.00	95.20%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达安心回馈混合型证券投资基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-05-30
2	易方达基金管理有限公司关于易方达安心回馈混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-06
3	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-11
4	易方达基金管理有限公司对市场上出现假冒公司客服电话进行诈骗活动的特别提示	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-11
5	易方达基金管理有限公司关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-07
6	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-09
7	易方达安心回馈混合型证券投资基金恢复申	中国证券报、上海证券	2015-07-10

	购、转换转入及定期定额投资业务的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
8	关于易方达基金管理有限公司子公司变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-08-05
9	易方达基金管理有限公司关于易方达安心回馈混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-16
10	易方达基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购、赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-24
11	易方达基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金在直销中心赎回、转换转出及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-16
12	易方达基金管理有限公司关于设立大连分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-04
13	易方达基金管理有限公司关于易方达安心回馈混合型证券投资基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-21
14	易方达基金管理有限公司易方达安心回馈混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-28
15	关于易方达基金管理有限公司北京直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-18
16	关于易方达安心回馈混合型证券投资基金、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金降低管理费率并修订基金合同及托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-31
17	易方达基金管理有限公司关于在指数熔断情况下调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-31

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达安心回馈混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达安心回馈混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达安心回馈混合型证券投资基金托管协议》；
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。

## 12.2 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。

## 12.3 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

二〇一六年三月二十五日