

易方达安心回馈混合型证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 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：二〇一六年八月二十四日

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。本半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 8 月 19 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 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.....	37
7.7 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.....	38
7.8 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.....	38
7.9 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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12	投资组合报告附注	38
8	基金份额持有人信息	39
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.3	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	40
9	开放式基金份额变动	40
10	重大事件揭示	40
10.1	基金份额持有人大会决议	40
10.2	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	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4	基金投资策略的改变	41
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8	其他重大事件	42
11	备查文件目录	43
11.1	备查文件目录	43
11.2	存放地点	43
11.3	查阅方式	43

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	2,049,728,832.20 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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×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	易会满

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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 40-43 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	60,222,097.76
本期利润	43,267,031.65

加权平均基金份额本期利润	0.0209
本期加权平均净值利润率	1.96%
本期基金份额净值增长率	1.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	127,957,693.34
期末可供分配基金份额利润	0.0624
期末基金资产净值	2,208,368,984.19
期末基金份额净值	1.077
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	7.70%

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。

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

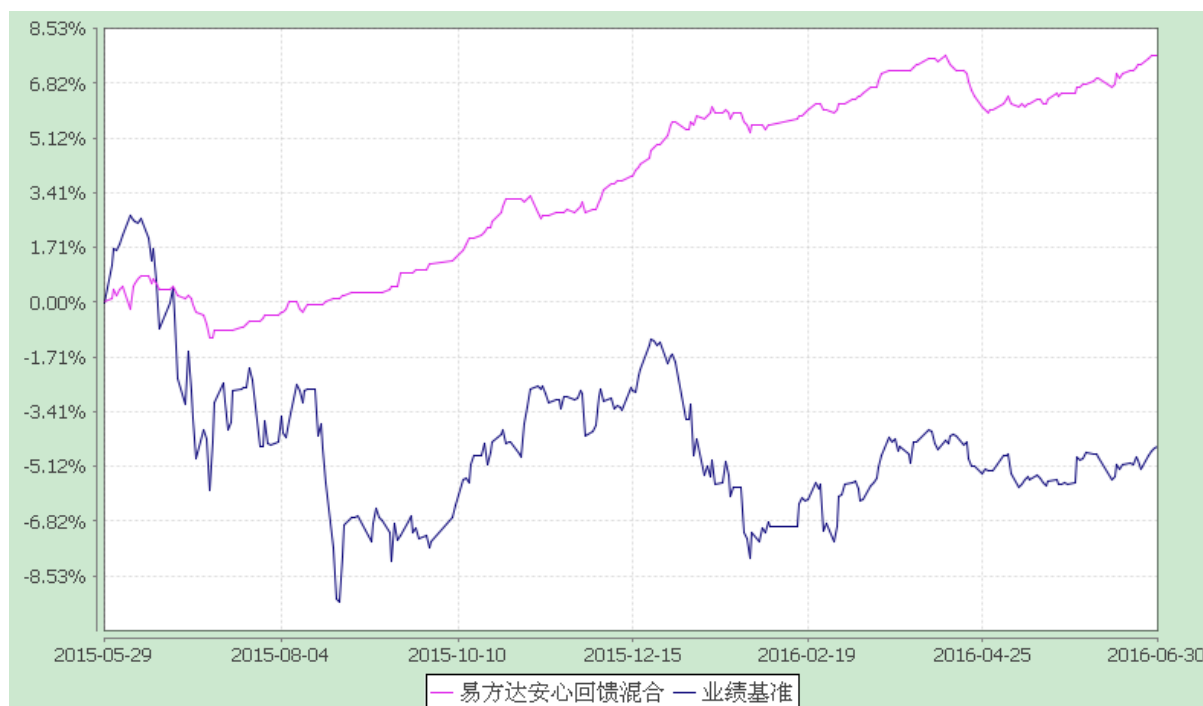
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.94%	0.11%	0.37%	0.25%	0.57%	-0.14%
过去三个月	0.28%	0.12%	-0.13%	0.26%	0.41%	-0.14%
过去六个月	1.99%	0.12%	-2.67%	0.46%	4.66%	-0.34%
过去一年	7.49%	0.12%	-2.98%	0.58%	10.47%	-0.46%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	7.70%	0.14%	-4.48%	0.60%	12.18%	-0.46%

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2016年6月30日)



注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 7.70%，同期业绩比较基准收益率为 -4.48%。

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2016年6月30日，易方达旗下共管理92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，管理公募基金总规模4056.91亿元。

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	证券从	说明

		(助理) 期限		业年限	
		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、易方达新收益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、易方达裕祥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、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新利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	-	9 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、易方达新益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助理、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	2015-11-28	-	6 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、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理助理。
张雅君	本基金的基金经理助理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基	2015-06-11	-	7 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

	金经理、易方达保本一号混合型证券投资基金的基金经理助理、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、易方达裕丰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、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理助理(自 2016 年 1 月 29 日至 2016 年 6 月 1 日)、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、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理			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。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关助理协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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 16 次，其中 13 次为指数及量化投资因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；3 次为不同基金经理管理的非指数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 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

2016 年上半年收益率并未出现明显的趋势，呈现震荡态势。一月份，市场对于供给侧改革带来经济短期阵痛形成一致预期，叠加全球股票市场波动带来的风险偏好下移，共同推动长期收益率出现显著下行。但是二月份以后，随着股票市场企稳，风险偏好逐步修复，经济中的积极信号逐步增多，市场开始出现分歧。首先是地产投资出现回升。在货币宽松和政策支持下，一线城市地产销售的好转反应为价格的快速上升，并开始向部分二线城市传导。一二月份地产的新开工和投资数据均出现较为明显的回升，引发市场对于地产投资回升的力度和持续性的关注。其次是大宗商品价格快速上升。一季度主要大宗商品价格包括原油、铁矿石、螺纹钢价格出现明显的上涨，考虑到大宗商品同时连接终端需求和通胀预期，市场对于未来增长和通胀的判断开始出现分歧。最后是农产品价格的居高不下导致通胀预期回升。一季度由于天气原因蔬菜价格出现了大幅上涨，而同时猪肉价格也屡创新高，这也触发了对于未来通胀回升的担忧。逐步增大的市场分歧导致长端无风险利率继续下行受阻，甚至出现了一定程度的回调。而在配置压力推动下，信用债收益率持续下行，信用利差也处于较低水平。出于对违约风险的担心，市场仍然偏好高等级信用债和城投债。

三月底开始信用风险事件频发，市场风险偏好迅速下降，信用债收益率快速走高。机构迫于赎回压力持续减持，流动性较好的利率债和城投类品种受到冲击，同时叠加营改增以及宏观审慎评估体系（MPA）考核导致的季末流动性紧张影响，利率出现了一波明显的上调。在收益率出现阶段性高点后，在央行公开市场续作加量以及中期借贷便利（MLF）投放等因素影响下，市场情绪有所回暖，信用债和利率债收益率转而下行。但是由于基本面仍处于边际改善态势以及对于六月底资金面的担心，利率以震荡整理为主。进入六月后，非农数据孱弱导致美联储加息预期骤降，随后公布的中国经济数据不及预期，尤其是地产的销售投资出现回落，市场对于经济前景转向悲观。接着是英国退欧推动全球避险情绪升温，加上央行对于流动性的关注缓解了市场的担心，市场收益率出现了显著下行。而信用债自四月份冲击以后，结构分化明显。高等级、城投债收益率出现回落，但是过剩产能以及出现信用事件的发行主体收益率仍然维持高位，利差甚至有所扩大。

上半年 A 股市场受年初的熔断制度、权威人士讲话、注册制放缓、MSCI 第三次拒绝纳入 A 股及英国公投脱欧等事件影响，上证综指、中小板指、创业板指分别下跌 17.22%、17.88%、17.92%。

债券方面，本基金在二季度增持了短融和利率债，目前整体组合的杠杆较高，久期较短。股票方面，本基金积极参与新股申购并增持了部分安全边际较高的个股。

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 1.077 元，本报告期份额净值增长率为 1.99%，同期业绩比较基准收益率为-2.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场分歧将进一步加剧，等待经济趋势的拐点信号。一季度以来支撑经济回暖的主要动力是基建和地产投资，对于基建投资的可持续性分歧不大。未来一个季度市场关注的焦点将集中于地产投资能否持续，以及何时出现拐点。当前房地产销售数据已经开始出现回落，如果这是趋势性的拐点，将在未来一段时间内再次引发地产库存堆积以及投资的下降，这将会为经济带来较大的下行压力。三季度随着蔬菜和猪肉价格对于通胀推动渐趋消散，通胀水平将会逐步下行，如果叠加上地产投资的下滑，经济可能将会再次面对较大的通缩压力。

二季度以来经济改善和通胀上升约束了货币政策的进一步宽松可能，但是在经济下行风险仍然较大的背景下货币政策也很难转向紧缩。货币政策仍然紧跟经济变化，货币政策空间的进一步打开需要观察到经济下行的拐点信号。期间汇率可能会对货币政策形成阶段性的扰动。信用风险仍然较大，三季度到期量增加和市场风险偏好萎缩会导致风险较高的行业融资更加困难，这会进一步加剧信用风险的暴露和传染。同时供给侧改革和去产能的推进也带来了一定政策上的不确定性。对于利率债仍然等待信号明确和机会相对确定后逐步介入。信用债仍然以规避信用风险为主。

未来本基金将继续维持较高杠杆和较低久期，信用债将继续持有并做结构调整，利率债把握波段操作的机会。股票方面，本基金将继续寻找安全边际较高，有望获得绝对收益的个券。

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

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。本报告期内，易方达安心回馈混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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 2016 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,127,169.71	11,292,887.47
结算备付金		80,454.76	1,141,582.46
存出保证金		36,735.42	271,944.50
交易性金融资产	6.4.7.2	2,752,321,136.13	2,847,672,006.30
其中：股票投资		117,007,385.30	71,133,684.83
基金投资		-	-
债券投资		2,635,313,750.83	2,776,538,321.47
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,000,000.00	5,611,025.42
应收利息	6.4.7.5	59,872,930.24	61,175,057.24
应收股利		-	-
应收申购款		31,924.26	1,148,604.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,825,470,350.52	2,928,313,107.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		615,062,692.40	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		1,079,488.32	1,576,492.16
应付托管费		449,786.81	437,914.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	69,120.42	322,592.59

应交税费		-	-
应付利息		246,344.64	127,598.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	193,933.74	234,000.00
负债合计		617,101,366.33	742,061,538.75
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,049,728,832.20	2,069,641,874.48
未分配利润	6.4.7.10	158,640,151.99	116,609,694.42
所有者权益合计		2,208,368,984.19	2,186,251,568.90
负债和所有者权益总计		2,825,470,350.52	2,928,313,107.65

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。

2.报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.077 元，基金份额总额 2,049,728,832.20 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日（基 金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		59,885,847.12	-16,852,047.00
1.利息收入		69,454,120.84	4,349,497.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48,877.34	3,946,454.58
债券利息收入		69,405,243.50	327,472.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	75,570.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,319,808.22	-2,428,471.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,134,675.85	-2,557,065.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,420,222.02	39,535.99
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	605,354.39	89,057.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-16,955,066.11	-18,781,502.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	66,984.17	8,428.67
减：二、费用		16,618,815.47	3,811,704.42
1. 管理人报酬		6,579,230.33	2,660,786.26
2. 托管费		2,741,345.96	739,107.30
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	115,734.39	227,401.90
5. 利息支出		6,954,977.90	148,978.35
其中：卖出回购金融资产支出		6,954,977.90	148,978.35
6. 其他费用	6.4.7.19	227,526.89	35,430.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		43,267,031.65	-20,663,751.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		43,267,031.65	-20,663,751.42

注：本基金合同生效日为 2015 年 5 月 29 日，上年度可比期间为 2015 年 5 月 29 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	2,069,641,874.48	116,609,694.42	2,186,251,568.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,267,031.65	43,267,031.65
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）	-19,913,042.28	-1,236,574.08	-21,149,616.36
其中：1.基金申购款	20,746,544.63	1,199,157.73	21,945,702.36
2.基金赎回款	-40,659,586.91	-2,435,731.81	-43,095,318.72
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）	2,049,728,832.20	158,640,151.99	2,208,368,984.19
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 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）	-	-20,663,751.42	-20,663,751.42
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）	5,316,059,696.77	32,127,354.16	5,348,187,050.93
其中：1.基金申购款	5,317,250,579.27	32,132,565.85	5,349,383,145.12
2.基金赎回款	-1,190,882.50	-5,211.69	-1,196,094.19
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）	5,523,446,542.89	11,463,602.74	5,534,910,145.63

注：本基金合同生效日为 2015 年 5 月 29 日，上年度可比期间为 2015 年 5 月 29 日至 2015 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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。

6.4.3 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。

6.4.4 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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	3,127,169.71
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	3,127,169.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	98,345,930.76	117,007,385.30	18,661,454.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	122,672,274.50	123,840,932.03
	银行间市场	2,502,873,116.10	2,511,472,818.80
	合计	2,625,545,390.60	2,635,313,750.83
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,723,891,321.36	2,752,321,136.13	28,429,814.77

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,899.30
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	32.58
应收债券利息	59,870,983.51
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	14.85
合计	59,872,930.24

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	38,749.88
银行间市场应付交易费用	30,370.54
合计	69,120.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	193,933.74
合计	193,933.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,069,641,874.48	2,069,641,874.48
本期申购	20,746,544.63	20,746,544.63
本期赎回（以“-”号填列）	-40,659,586.91	-40,659,586.91
本期末	2,049,728,832.20	2,049,728,832.20

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	69,107,336.91	47,502,357.51	116,609,694.42
本期利润	60,222,097.76	-16,955,066.11	43,267,031.65
本期基金份额交易产生的变动数	-1,371,741.33	135,167.25	-1,236,574.08
其中：基金申购款	789,235.62	409,922.11	1,199,157.73
基金赎回款	-2,160,976.95	-274,754.86	-2,435,731.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	127,957,693.34	30,682,458.65	158,640,151.99

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	40,437.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,735.02
其他	704.46
合计	48,877.34

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	25,212,760.49
减：卖出股票成本总额	16,078,084.64
买卖股票差价收入	9,134,675.85

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,102,874,537.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,075,684,678.65
减：应收利息总额	29,610,081.13
买卖债券差价收入	-2,420,222.02

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	605,354.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	605,354.39

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-16,955,066.11
——股票投资	8,956,512.52
——债券投资	-25,911,578.63
——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	-16,955,066.11

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	66,984.17
基金合同生效前利息收入	-
其他	-
合计	66,984.17

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	103,784.39
银行间市场交易费用	11,950.00
合计	115,734.39

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

审计费用	44,753.80
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	14,993.15
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	227,526.89

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年5月29日（基金合同 生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,579,230.33	2,660,786.26
其中：支付销售机构的客户维护费	117.41	171.36

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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。

2.自 2016 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理费由“按前一日基金资产净值的 0.90% 年费率计提”调整为“按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提”。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,741,345.96	739,107.30

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年5月29日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	3,127,169.71	40,437.86	1,433,044,745.11	301,429.51

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002781	奇信股份	2015-12-16	2016-12-22	老股转让流通受限	13.31	43.35	204,545	2,722,493.95	8,867,025.75	-
002792	通宇通讯	2016-03-21	2017-03-28	老股转让流通受限	22.94	59.80	116,432	1,780,625.74	6,962,633.60	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
300508	维宏股份	2016-04-12	2017-04-19	老股转让流通受限	20.08	254.50	10,383	208,490.64	2,642,473.50	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
6.4.12.1.2 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
12700	海印	2016-0	2016-0	新发	99.99	99.99	8,860	885,93	885,93	-

3	转债	6-15	7-01	流通受限				2.03	2.03	
---	----	------	------	------	--	--	--	------	------	--

注：1.深圳市奇信建设集团股份有限公司于 2016 年 6 月 6 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 0.58 元人民币现金（含税）；

2.广东通宇通讯股份有限公司于 2016 年 6 月 7 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 4 元人民币现金（含税），同时按每 10 股转增 5 股进行资本公积金转增股本；

3.上海维宏电子科技股份有限公司于 2016 年 6 月 28 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 1.64 元人民币现金（含税）；

4.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。

6.4.12.2 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
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项停牌	22.07	-	-	809,900	14,989,891.51	17,874,493.00	-
000936	华西股份	2016-05-24	重大事项停牌	8.22	2016-07-13	9.04	200,000	1,640,426.52	1,644,000.00	-
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项停牌	12.44	-	-	150,000	2,605,262.59	1,866,000.00	-
300508	维宏股份	2016-06-30	重大事项停牌	254.50	2016-07-06	242.00	10,383	208,490.64	2,642,473.50	-
600654	中安消	2016-05-19	重大事项停牌	18.54	2016-08-08	20.39	60,500	2,602,437.04	1,121,670.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	20.92	2016-07-01	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 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 605,062,692.40 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
1180115	11 辽阳债	2016-07-04	68.04	400,000	27,216,000.00
1280177	12 锦城投债	2016-07-04	63.64	300,000	19,092,000.00
1280230	12 肥城资债	2016-07-04	78.49	420,000	32,965,800.00
1280485	12 遵国投债	2016-07-04	85.36	500,000	42,680,000.00
1380228	13 东丽债	2016-07-04	83.90	400,000	33,560,000.00
1480033	14 六盘水开投债	2016-07-04	109.20	1,300,000	141,960,000.00

1480060	14 毕节开源债	2016-07-04	109.93	500,000	54,965,000.00
1480191	14 宁经开债	2016-07-04	110.69	300,000	33,207,000.00
1480276	14 滕州债 02	2016-07-04	109.23	208,000	22,719,840.00
1480555	14 晋城城投债	2016-07-04	103.58	500,000	51,790,000.00
1480604	14 淮国资债	2016-07-04	107.95	900,000	97,155,000.00
150408	15 农发 08	2016-07-06	100.95	600,000	60,570,000.00
160210	16 国开 10	2016-07-06	99.95	256,000	25,587,200.00
合计				6,584,000	643,467,840.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 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 10,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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 2016 年 6 月 30 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 109.61%(2015 年 12 月 31 日：93.73%)。

6.4.13.2.1 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	113,209,076.64	29,987,131.15
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	377,364,786.59	343,819,292.16
合计	490,573,863.23	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。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	472,649,839.17	349,891,167.12
AAA 以下	1,569,472,258.34	1,437,016,177.70
未评级	162,488,773.60	676,951,841.98
合计	2,204,610,871.11	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。

6.4.13.3 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。

本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券(含可分离型可转换债券)、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。期末除 6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,127,169.71	-	-	-	3,127,169.71
结算备付金	80,454.76	-	-	-	80,454.76
存出保证金	36,735.42	-	-	-	36,735.42
交易性金融资产	634,160,000.00	1,464,920,800.00	536,232,950.83	117,007,385.30	2,752,321,136.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,000,000.00	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	59,872,930.24	59,872,930.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	31,924.26	31,924.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	637,404,359.89	1,464,920,800.00	536,232,950.83	186,912,239.80	2,825,470,350.52
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	615,062,692.40	-	-	-	615,062,692.40
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,079,488.32	1,079,488.32
应付托管费	-	-	-	449,786.81	449,786.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	69,120.42	69,120.42
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	246,344.64	246,344.64
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	193,933.74	193,933.74

负债总计	615,062,692.40	-	-	2,038,673.93	617,101,366.33
利率敏感度缺口	22,341,667.49	1,464,920,800.00	536,232,950.83	184,873,565.87	2,208,368,984.19
上年度末 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	742,061,538.7 5
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。

6.4.13.4.1.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	14,803,524.35	19,826,802.09
	2.市场利率上升25个基点	-14,619,716.69	-19,560,037.91

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	117,007,385.30	5.30	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	117,007,385.30	5.30	71,133,684.83	3.25

6.4.13.4.3.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	6,224,651.95	2,915,590.95
	2.业绩比较基准下降 5%	-6,224,651.95	-2,915,590.95

注：股票投资部分业绩基准取上证 A 指。

6.4.14 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 2016 年 6 月 30 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 91,969,406.55 元，属于第二层次的余额为 2,660,351,729.58 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 68,540,992.30 元，第二层次 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。

(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 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(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。

7 投资组合报告

7.1 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	117,007,385.30	4.14
	其中：股票	117,007,385.30	4.14
2	固定收益投资	2,635,313,750.83	93.27
	其中：债券	2,635,313,750.83	93.27
	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	3,207,624.47	0.11
7	其他各项资产	69,941,589.92	2.48
8	合计	2,825,470,350.52	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	96,962,099.37	4.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	9,642,300.03	0.44
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	706,000.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,676,859.80	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	20,126.10	0.00
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	117,007,385.30	5.30

7.3 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	17,874,493.00	0.81
2	300068	南都电源	603,876	13,200,729.36	0.60
3	600585	海螺水泥	699,999	10,177,985.46	0.46
4	002510	天汽模	1,100,000	9,152,000.00	0.41
5	002781	奇信股份	204,545	8,867,025.75	0.40
6	002792	通宇通讯	116,432	6,962,633.60	0.32
7	002035	华帝股份	250,000	6,120,000.00	0.28
8	002658	雪迪龙	220,000	3,825,800.00	0.17
9	002518	科士达	150,000	3,732,000.00	0.17
10	600498	烽火通信	145,000	3,520,600.00	0.16
11	000959	首钢股份	900,000	3,330,000.00	0.15
12	300017	网宿科技	45,800	3,077,760.00	0.14
13	600804	鹏博士	155,000	2,825,650.00	0.13
14	601567	三星医疗	189,951	2,801,777.25	0.13
15	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	0.12

16	002008	大族激光	100,000	2,284,000.00	0.10
17	002475	立讯精密	112,500	2,210,625.00	0.10
18	600703	三安光电	104,994	2,096,730.18	0.09
19	002465	海格通信	150,000	1,866,000.00	0.08
20	002690	美亚光电	80,000	1,843,200.00	0.08
21	002055	得润电子	60,000	1,837,200.00	0.08
22	000936	华西股份	200,000	1,644,000.00	0.07
23	600654	中安消	60,500	1,121,670.00	0.05
24	000059	华锦股份	98,800	918,840.00	0.04
25	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.04
26	600029	南方航空	100,000	706,000.00	0.03
27	000858	五粮液	15,000	487,950.00	0.02
28	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
29	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
30	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
31	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
32	603726	朗迪集团	1,361	68,798.55	0.00
33	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
34	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
35	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
36	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
37	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
38	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
39	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
40	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600585	海螺水泥	11,016,475.00	0.50
2	300068	南都电源	10,653,807.89	0.49
3	002510	天汽模	8,754,946.00	0.40
4	600221	海南航空	5,134,068.03	0.23
5	002658	雪迪龙	5,116,028.20	0.23
6	600029	南方航空	3,566,026.30	0.16
7	002792	通宇通讯	1,780,625.74	0.08
8	002690	美亚光电	1,698,331.54	0.08
9	000936	华西股份	1,640,426.52	0.08

10	000059	华锦股份	908,497.00	0.04
11	000858	五 粮 液	359,457.00	0.02
12	601111	中国国航	349,856.00	0.02
13	002797	第一创业	212,044.56	0.01
14	300508	维宏股份	208,490.64	0.01
15	601966	玲珑轮胎	199,126.18	0.01
16	601611	中国核建	128,594.73	0.01
17	603377	东方时尚	113,750.40	0.01
18	601900	南方传媒	112,559.06	0.01
19	002791	坚朗五金	85,697.61	0.00
20	603608	天创时尚	78,341.20	0.00

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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600221	海南航空	5,258,513.80	0.24
2	000959	首钢股份	3,338,542.08	0.15
3	600029	南方航空	2,525,577.23	0.12
4	002658	雪迪龙	1,506,293.67	0.07
5	300496	中科创达	1,435,934.94	0.07
6	002510	天汽模	1,433,577.14	0.07
7	603996	中新科技	787,935.90	0.04
8	002782	可立克	543,457.52	0.02
9	002797	第一创业	515,762.52	0.02
10	300493	润欣科技	492,926.56	0.02
11	002786	银宝山新	489,755.70	0.02
12	603299	井神股份	398,616.60	0.02
13	300494	盛天网络	397,705.60	0.02
14	601900	南方传媒	387,840.34	0.02
15	002780	三夫户外	381,031.12	0.02
16	002787	华源包装	379,316.79	0.02
17	601111	中国国航	358,500.00	0.02
18	300492	山鼎设计	291,227.39	0.01
19	300491	通合科技	287,216.25	0.01
20	300474	景嘉微	281,347.64	0.01

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。

7.4.3 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	52,995,272.59
卖出股票收入（成交）总额	25,212,760.49

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。

7.5 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	268,910,000.00	12.18
	其中：政策性金融债	268,910,000.00	12.18
4	企业债券	1,380,157,818.80	62.50
5	企业短期融资券	371,590,000.00	16.83
6	中期票据	613,770,000.00	27.79
7	可转债（可交换债）	885,932.03	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,635,313,750.83	119.33

7.6 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	141,960,000.00	6.43
2	150408	15 农发 08	1,100,000	111,045,000.00	5.03
3	1182324	11 河钢 MTN3	1,000,000	100,870,000.00	4.57
4	1480200	14 衢州国资债	900,000	98,055,000.00	4.44
5	1480604	14 准国资债	900,000	97,155,000.00	4.40

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	36,735.42
2	应收证券清算款	10,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	59,872,930.24
5	应收申购款	31,924.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	69,941,589.92

7.12.4 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。

7.12.5 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	000651	格力电器	17,874,493.00	0.81	重大事项停 牌
2	002781	奇信股份	8,867,025.75	0.40	老股转让流 通受限
3	002792	通宇通讯	6,962,633.60	0.32	老股转让流 通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 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
484	4,234,976.93	2,038,641,937.83	99.46%	11,086,894.37	0.54%

8.2 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本基金	234,098.38	0.0114%
------------------	------------	---------

8.3 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

9 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
本报告期期初基金份额总额	2,069,641,874.48
本报告期基金总申购份额	20,746,544.63
减：本报告期基金总赎回份额	40,659,586.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,049,728,832.20

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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2016年4月30日发布公告，自2016年4月30日起聘任詹余引先生担任公司董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	42,797,185.67	57.51%	39,857.10	57.51%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	31,613,494.30	42.49%	29,441.78	42.49%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增东北证券股份有限公司一个交易单元。

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。

10.7.2 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	1,893,620.25	2.37%	-	-	-	-
华泰证券	77,925,083.70	97.63%	545,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 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	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-04
2	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	2016-01-05
3	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	2016-01-06
4	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-07

5	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
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	2016-02-26
7	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
10	易方达基金管理有限公司关于网上直销支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05

11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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

二〇一六年八月二十四日