易方达科翔混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

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

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达科翔混合
基金主代码	110013
交易代码	110013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月13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	1,041,945,327.40份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于红利股,追求在有效控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,追求更高收益,回避市场风险。
业绩比较基准	80%×中证红利指数收益率+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合基金,理论上风险收益水平高于债券基金和货币市场基金,低于股票基金。

注:2014年7月25日,根据《关于修订易方达科翔混合型证券投资基金基金名称并相应修改基金合同等相关法律文件的公告》的规定,本基金变更基金类别并由“易方达科翔股票型证券投资基金”更名为“易方达科翔混合型证券投资基金”。

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

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	广州市天河区珠江西路城珠江广场广州银行大厦43楼

2.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.5.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	203,580,001.12	106,811,847.87	56,997,100.78
本期利润	416,796,179.03	111,011,434.24	71,208,643.48
加权平均基金份额本期利润	0.4916	0.2956	0.2669
本期基金份额净值增长率	91.23%	18.43%	23.81%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	1.0309	0.7183	0.5386
期末基金资产净值	2,908,715,818.27	878,564,881.26	353,993,545.99
期末基金份额净值	2.792	1.536	1.358

注:1.年度基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.本基金已于2008年12月13日对资基金转型通过审议的基金份额进行了拆分,基金拆分比例为1:1.3402796。

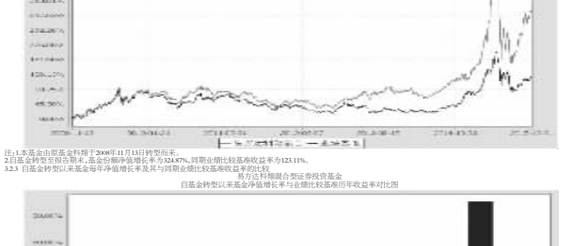
3.2 基金净值表现

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	41.30%	2.13%	17.93%	1.38%	23.37%	0.75%
过去六个月	3.56%	3.25%	-10.87%	2.34%	14.43%	0.91%
过去一年	91.23%	2.93%	22.39%	2.11%	68.84%	0.82%
过去三年	180.39%	1.99%	59.59%	1.50%	120.80%	0.49%
过去五年	125.36%	1.73%	34.85%	1.32%	90.51%	0.41%
自基金合同生效起至今	324.87%	1.66%	123.11%	1.41%	201.76%	0.25%

3.2.2 自基金转型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

易方达科翔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
(2008年11月13日至2015年12月31日)



注:1.本基金出原基金转型于2008年11月13日转型而来。
2.自基金转型以来起算,基金份额净值增长率为324.87%,同期业绩比较基准收益率为123.11%。

3.2.3 自基金转型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

易方达科翔混合型证券投资基金
自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

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	0.800	33,661,730.37	10,205,831.16	43,867,561.53	—
2014年	0.600	9,201,750.63	6,387,069.78	15,592,820.41	—
2013年	0.400	6,922,403.05	4,477,792.63	11,400,195.68	—
合计	1.800	49,789,884.05	21,070,693.57	70,860,577.62	—

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理情况

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字[2001]47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,是为适应广管理模式中基金管理人的要求,在“取信于市场、取信于社会”的宗旨,坚持“合规运规思治理理”,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,易方达获得全国社会保障基金投资管理人资格。2005年4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86只开放式基金,15只封闭式基金和多个企业年金基金及社保基金资产的投资管理业务,资产管理总规模826.58亿元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策委员会

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		
陈皓	本基金的基金经理,易方达国防军工混合型证券投资基金的基金经理,易方达价值精选混合型证券投资基金的基金经理,易方达新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,易方达平稳增长证券投资基金的基金经理,易方达平稳增长证券投资基金的基金经理,易方达平稳增长证券投资基金的基金经理,一部门总经理	2014-05-10	-	8年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员,基金经理助理兼行业研究员,基金经理助理兼行业研究员,基金经理助理兼行业研究员,一部门总经理助理,投资一部副总经理。

注:1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他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,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、公平交易的实施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产品,范围包括:上市股票、债券、一级市场申购、二级市场交易(竞价交易、大宗交易、定向增发、交易所基金、交易所债券等各个环节)、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、及时评估调整原则。

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、完善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之间一定时间段内投资品种、价格、数量、方向的差异;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分配资产组合的交易机会;系统具备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分配资产组合的交易机会;公平协调原则是指:在不同投资组合之间,公平地分配投资机会;及时评估调整原则是指:公司定期对公平交易的效果进行评估,并根据评估结果确定公允价值。

公司严格按照证券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(纯债动指数组合和量化投资组合除外)编制投资组合的投资决策委员会、投资决策委员会、投资决策委员会、