易方达裕丰回报债券型证券投资基金

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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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	易方达裕丰回报债券
基金主代码	000171
交易代码	000171
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月23日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,482,847,097.28份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券资产,严格管理权益类品种的投资比例,在控制基金资产净值波动的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金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,在债券、股票和银行存款等资产类别之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例。债券投资方面,本基金主要通过久期配置、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;股票投资部分,主要采取"自下而上"的投资策略,精选高成长性的优势企业进行投资。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三年期银行定期整存整取存款利率(税后)+1.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金,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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	廖原
	联系电话	020-85102688	021-61618888
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	Liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95528
传真		020-85104666	021-63602540

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦43楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年8月23日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	229,155,311.07	87,114,007.72	-5,956,059.96
本期利润	370,520,454.98	141,265,514.24	-19,334,446.37
加权平均基金份额本期利润	0.2197	0.2134	-0.0316
本期基金份额净值增长率	22.23%	21.28%	-3.20%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.2425	0.1098	-0.0319
期末基金资产净值	3,563,440,259.46	1,027,002,251.89	586,830,820.04
期末基金份额净值	1.435	1.174	0.968

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.本基金合同于2013年8月23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

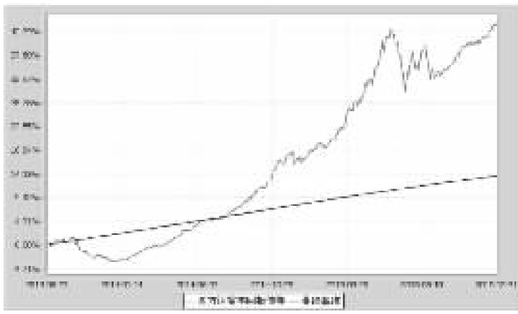
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.14%	0.22%	1.11%	0.01%	5.03%	0.21%
过去六个月	4.21%	0.49%	2.32%	0.01%	1.89%	0.48%
过去一年	22.23%	0.46%	5.06%	0.01%	17.17%	0.45%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	43.50%	0.35%	13.69%	0.02%	29.81%	0.33%

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

易方达裕丰回报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

(2013年8月23日至2015年12月31日)

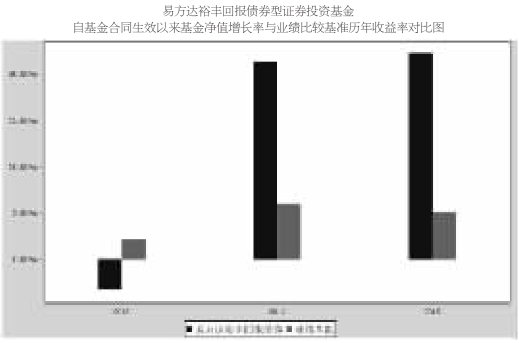


注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为43.50%,同期业绩比较基准收益率为13.69%。

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

易方达裕丰回报债券型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注:本基金合同生效日为2013年8月23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(2013年8月23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、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、固定收益基金投资部总经理	2014-01-09	-	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。
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、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、易方达安心回馈混合型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	2015-02-17	-	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"任职日期"和"离任日期"分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》,内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合,围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易(含银行间市场)等投资管理活动,贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括:集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括:通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会;投资人员应公平对待其管理的不同投资组合,控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差;建立集中交易制度,交易系统具备公平交易功能,对于满足公平交易执行条件的同向指令,系统将自动启用公平交易功能,按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行;根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制,通过系统与人工控制相结合的方式,力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待;建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制,对于发现的异常问题进行提示,并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间(纯被动指数组合和量化投资组合除外)确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易,投资人员须提供充分的投资决策依据,并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制,并借助相关技术系统,使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况,持续督促公平交易制度的落实执行,并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具,按照不同的时间窗口(包括当日内、3日内、5日内),对我司旗下所有投资组合2015年度的同向交易价差情况进行了分析,包括旗下各大类资产组合之间(即公募、社保、年金、专户四大类业务之间)的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有11次,其中8次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而和其他组合发生反向交易,3次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年债券市场再次延续牛市格局,中债总财富指数全年上涨8%,长期国债收益率也达到2009年以来的新低。债券市场连续两年的牛市较为少见,一方面是由于经济低迷,通胀下行,经济中的传统动力持续疲弱,社会融资需求出现较大的萎缩;而央行货币政策持续宽松,数次降准降息保证了流动性的供给。另一方面是年中股票市场的大幅波动,大量资金从权益类相关资产中撤出,流入债券市场,这也推动了债券收益率的快速下行。

2015年上半年债券利率波动较大。一季度工业增加值加速下滑,同时央行为了对冲外汇占款流失和经济下滑及时推出了降准降息措施,这带动债券收益率出现一波显著的下行。但是3月地方债置换消息传出,由于担心供给冲击,市场收益率大幅反弹。随着情绪修复以及央行通过降准方式大量释放流动性支持地方债发行,收益率再次回落到前期低点。5月开始股票市场的快速上涨对于债券资金形成了明显的分流,很多和权益类挂钩的类固收产品对于债券市场形成了一定的挤压,此外叠加第二批地方债发行以及金融数据的好转,这导致债券收益率再次上扬。

2015年下半年开始债券市场走出单边的牛市。三季度核心驱动在于股票市场的大幅波动造成的大类资产配置转移,大量资金涌入债券类资产,推动债券资产价格加速上涨。11月在IPO重启,美国加息预期以及经济数据好转的叠加冲击下,债市出现调整,但是很快回落。四季度债券市场基本面并没有太大的变化,经济数据继续疲软。但是政策面上去产能的提出强化了市场对于明年经济的悲观预期。由于对于2016年债券资产的看好,部分资金提前布局,推动收益率在年底出现一波非常明显的下行。同时短期资金面在央行呵护下保持平稳,市场对此充分预期,这也催化了长期收益率的下行和期限利差的缩窄。

本基金2015年上半年保持了较高的信用债仓位,并适度参与了利率债波段操作,三季度进一步增加了信用债仓位,四季度随着信用债收益率的不断下行逐步降低了信用债仓位。权益方面,上半年随着股市的不断上涨逐步降低了股票仓位,下半年在控制仓位的情况下积极参与了股票波段操作。总体来看,本基金2015年较好的把握了权益和债券市场机会,根据市场情况进行了灵活的大类资产配置和切换。在控制组合波动的情况下大幅跑赢了业绩基准。

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1.435元,本报告期份额净值增长率为22.23%,同期业绩比较基准收益率为5.06%。

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2016年,私人部门内生动力和融资需求仍然是决定经济趋势的关键,而政府部门的态度将成为最大的不确定因素。目前来看,我们对于私人部门内生动力触底回升并不乐观。制造业盈利预期仍没有明显改善,投资意愿难以见到起色。房地产受到高库存拖累,市场主体预期较为悲观,销售到投资的转化渠道可能仍然不够通畅。经济总体依然疲弱,下行压力较大。同时2016年政策风险相对较大。2015年三季度以来高层频繁提及供给侧改革,其中关键在于去产能和清理僵尸企业,在经济下滑背景下推进去产能可能会造成经济的阵痛,对短期经济形成冲击。但是同时政府也没有完全放弃需求侧的管理,财政赤字大幅扩张,在去产能的同时强调防风险,这都意味着产能出清的进度可能较为缓慢。在经济低迷的大背景下,货币政策2016年仍然会维持适应性宽松,但是相对来说会比较滞后。经济下行和通胀疲软会倒逼央行调低基准利率,而外汇占款的流出导致的基础货币缺口也会使得降准常态化。2016年海外市场的波动也会加大,尤其是新兴市场在美联储加息和大宗商品价格疲软的双重夹击下风险正在积聚,这会对国内经济形成一定的干扰。汇率的贬值压力将在2016年出现明显释放,这会对短期货币政策形成一定的掣肘,但是我们认为牺牲利率来稳住汇率的可能性并不大,利率决定仍然主要参考国内经济走势。同时在经济连续下滑背景下,防范企业盈利恶化和债务引发信用事件的风险同样需要关注。

2016年本基金债券部分将继续保持积极的操作策略,但考虑到收益率绝对水平已经较低,市场波动加大,本基金将适度降低组合久期和杠杆水平。信用债将以城投债和短融为主要配置品种,同时也积极参与利率债波段交易。权益部分将密切关注市场风险偏好的变化,做好波段操作,力争以优异的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、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,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对易方达裕丰回报债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,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,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对易方达裕丰回报债券型证券投资基金的投资运作进行了监督,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的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内,由易方达基金管理有限公司编制本托管人复核的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)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:易方达裕丰回报债券型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	2,770,255.75	1,629,270.02
结算备付金	77,513,674.72	35,792,595.16
存出保证金	445,951.88	157,135.39
交易性金融资产	4,469,963,012.57	1,796,836,543.84
其中:股票投资	279,183,130.61	79,185,596.18
基金投资	-	-
债券投资	4,190,779,881.96	1,717,650,947.66
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	87,000,243.50	-
应收证券清算款	43,703,387.44	-
应收利息	92,801,532.29	40,692,874.50
应收股利	-	-
应收申购款	4,298,636.06	2,168,453.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	600.00	-
资产总计	4,778,497,294.21	1,877,276,872.16
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,175,598,885.00	848,342,904.03
应付证券清算款	37,154,651.61	708,408.14
应付赎回款	16,436.06	79,427.99
应付管理人报酬	974,405.31	351,018.79
应付托管费	243,601.32	87,754.71
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	281,542.81	97,168.18
应交税费	-	-
应付利息	397,512.64	227,938.43
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	390,000.00	380,000.00
负债合计	1,215,057,034.75	850,274,620.27
所有者权益:		
实收基金	2,482,847,097.28	874,494,111.04
未分配利润	1,080,593,162.18	152,508,140.85
所有者权益合计	3,563,440,259.46	1,027,002,251.89
负债和所有者权益总计	4,778,497,294.21	1,877,276,872.16

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.435元,基金份额总额2,482,847,097.28份。

7.2 利润表

会计主体:易方达裕丰回报债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	413,733,866.56	167,590,719.28
1.利息收入	197,365,868.10	70,442,574.62
其中:存款利息收入	1,391,338.71	2,592,857.06
债券利息收入	195,925,206.85	67,823,250.29
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	49,322.54	26,467.27
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	70,804,694.26	42,807,738.36
其中:股票投资收益	29,868,278.09	3,291,840.98
基金投资收益	-	-
债券投资收益	37,876,590.71	39,515,897.38
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,059,825.46	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	141,365,143.91	54,151,506.52
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	4,198,160.29	188,899.78
减:二、费用	43,213,411.58	26,325,205.04
1.管理人报酬	8,979,173.22	2,824,387.23
2.托管费	2,244,793.29	706,096.93
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,433,251.43	292,168.32
5.利息支出	29,089,030.78	22,050,627.93
其中:卖出回购金融资产支出	29,089,030.78	22,050,627.93
6.其他费用	467,162.86	451,924.63
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	370,520,454.98	141,265,514.24
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	370,520,454.98	141,265,514.24

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达裕丰回报债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	874,494,111.04	152,508,140.85	1,027,002,251.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	370,520,454.98	370,520,454.98
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)	1,608,352,986.24	557,564,566.35	2,165,917,552.59
其中:1.基金申购款	2,947,538,684.99	1,012,097,629.57	3,959,636,314.56
2.基金赎回款	-1,339,185,698.75	-454,533,063.22	-1,793,718,761.97
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)	2,482,847,097.28	1,080,593,162.18	3,563,440,259.46

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	606,140,884.85	-19,310,064.81	586,830,820.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	141,265,514.24	141,265,514.24
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)	268,353,226.19	30,552,691.42	298,905,917.61
其中:1.基金申购款	426,291,356.99	43,965,355.21	470,256,712.20
2.基金赎回款	-157,938,130.80	-13,412,663.79	-171,350,794.59
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)	874,494,111.04	152,508,140.85	1,027,002,251.89

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

易方达裕丰回报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[2013]606号《关于核准易方达裕丰回报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《易方达裕丰回报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,《易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金合同》于2013年8月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为618,283,865.01份基金份额,其中认购资金利息折合18,013.36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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述事项外,本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期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。

7.4.5.2差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

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。

证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,免征营业税。

证券投资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,股权的股息、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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。基金从上市公司分配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,减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,减按25%计入应纳税所得额;自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(简称"浦发银行")	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")	基金管理人股东
广东粤财信托有限公司(以下简称"粤财信托")	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,979,173.22	2,824,387.23
其中:支付销售机构的客户维护费	6,434.04	14,584.40

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.4%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,244,793.29	706,096.93

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
	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
-	-	-	-	-	-	-

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日					
	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
浦发银行	-	53,707,561.64	-	-	39,500,000.00	2,492.35

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

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

无。

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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行	2,770,255.75	428,061.23	1,629,270.02	122,115.81

注:本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券	1580182	15长沙轨道债02	分销	400,000	40,000,000.00

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券	041459014	14广汇能源CP001	分销	100,000	9,990,000.00
广发证券	041462006	14南通国投CP001	分销	200,000	20,000,000.00
浦发银行	041469001	14北控集CP001	分销	400,000	40,000,000.00
广发证券	1480011	14宏桥债01	分销	300,000	30,000,000.00
广发证券	1480250	14合工投小微债	分销	100,000	10,000,000.00
广发证券	1480293	14徐高铁债	分销	100,000	10,000,000.00
广发证券	1480348	14临桂新区债	分销	100,000	10,000,000.00
广发证券	1480360	14赤城投债	分销	100,000	10,000,000.00
广发证券	1480363	14冀顺德债	分销	200,000	20,000,000.00
广发证券	1480480	14揭城投债	分销	200,000	20,000,000.00

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2015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

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1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	-
136120	15鲁能债	2015-12-24	2016-01-20	新发流通受限	99.99	99.99	600,000	59,995,055.34	59,995,055.34	-

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529,998,885.00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
101473003	14华信资产MTN001	2016-01-04	110.89	100,000	11,089,000.00
1280142	12铜陵建投债	2016-01-05	102.22	700,000	71,554,000.00
1380255	13铜陵建投债	2016-01-05	107.66	700,000	75,362,000.00
1380302	13十堰城投债	2016-01-05	107.51	500,000	53,755,000.00
1380315	13荆门债	2016-01-05	107.83	600,000	64,698,000.00
1380352	13平度国资债	2016-01-05	108.54	700,000	75,978,000.00
1480151	14永州城建债	2016-01-05	112.00	600,000	67,200,000.00
1480186	14益阳交投债	2016-01-05	111.30	500,000	55,650,000.00
1480299	14吉安债	2016-01-05	109.67	500,000	54,835,000.00
1480395	14元国资债	2016-01-05	109.52	400,000	43,808,000.00
合计				5,300,000	573,929,000.00

7.4.9.3.2 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645,600,000.00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。

7.4.10 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)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285,975,028.88元,属于第二层次的余额为4,183,987,983.69元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次1,095,113,317.84元,第二层次701,723,226.00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(2014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。

§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	279,183,130.61	5.84
	其中:股票	279,183,130.61	5.84
2	固定收益投资	4,190,779,881.96	87.70
	其中:债券	4,190,779,881.96	87.70
	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	87,000,243.50	1.82
	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	80,283,930.47	1.68
7	其他各项资产	141,250,107.67	2.96
8	合计	4,778,497,294.21	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	171,800,175.99	4.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,685.00	0.00
F	批发和零售业	40,297,106.00	1.13
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	48,987,263.24	1.37
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	18,079,900.38	0.51
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	279,183,130.61	7.83

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	002510	天汽模	3,345,098	59,308,587.54	1.66
2	002518	科士达	1,149,619	40,581,550.70	1.14
3	002556	辉隆股份	2,179,400	40,297,106.00	1.13
4	600804	鹏博士	1,586,017	37,620,323.24	1.06
5	002475	立讯精密	722,597	23,086,974.15	0.65
6	603686	龙马环卫	553,500	21,985,020.00	0.62
7	603588	高能环境	230,994	18,079,900.38	0.51
8	300425	环能科技	328,420	14,640,963.60	0.41
9	002035	华帝股份	686,000	12,197,080.00	0.34
10	002230	科大讯飞	306,800	11,366,940.00	0.32

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.efunds.com.cn网站的年度报告正文。

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	002510	天汽模	98,757,025.31	9.62
2	002658	雪迪龙	63,019,453.34	6.14
3	600037	歌华有线	58,756,176.95	5.72
4	000550	江铃汽车	49,988,655.20	4.87
5	002556	辉隆股份	43,624,183.55	4.25
6	002518	科士达	36,025,709.21	3.51
7	600804	鹏博士	35,393,378.17	3.45
8	000488	晨鸣纸业	34,805,556.44	3.39
9	600887	伊利股份	31,253,359.94	3.04
10	000539	粤电力A	24,099,554.08	2.35
11	000333	美的集团	23,522,397.01	2.29
12	002475	立讯精密	23,301,585.90	2.27
13	600875	东方电气	22,540,735.08	2.19
14	000800	一汽轿车	19,418,416.14	1.89
15	603588	高能环境	18,294,456.40	1.78
16	600313	农发种业	15,885,551.50	1.55
17	002111	威海广泰	15,879,741.00	1.55
18	601567	三星医疗	15,879,217.30	1.55
19	002009	天奇股份	15,742,408.04	1.53
20	600058	五矿发展	15,606,963.99	1.52

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	002510	天汽模	62,337,846.82	6.07
2	002658	雪迪龙	58,494,432.14	5.70
3	600037	歌华有线	55,124,198.00	5.37
4	000550	江铃汽车	46,003,532.21	4.48
5	600887	伊利股份	34,229,155.83	3.33
6	600875	东方电气	25,951,276.16	2.53
7	000488	晨鸣纸业	25,804,719.25	2.51
8	000800	一汽轿车	24,616,199.91	2.40
9	000333	美的集团	24,291,248.24	2.37
10	002509	天广消防	23,309,187.25	2.27
11	600682	南京新百	22,990,460.00	2.24
12	600737	中粮屯河	22,658,804.72	2.21
13	000539	粤电力A	22,576,643.64	2.20
14	002009	天奇股份	20,459,634.57	1.99
15	002111	威海广泰	17,695,655.22	1.72
16	002301	齐心集团	17,285,082.30	1.68
17	600058	五矿发展	16,393,185.72	1.60
18	600219	南山铝业	16,191,524.63	1.58
19	002375	亚厦股份	15,780,199.60	1.54
20	002086	东方海洋	15,419,315.06	1.50

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	895,548,430.04
卖出股票收入(成交)总额	741,609,903.06

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	170,708,000.00	4.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	458,520,000.00	12.87
	其中:政策性金融债	458,520,000.00	12.87
4	企业债券	2,928,307,575.89	82.18
5	企业短期融资券	120,698,000.00	3.39
6	中期票据	468,711,000.00	13.15
7	可转债(可交换债)	13,370,306.07	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	30,465,000.00	0.85
10	合计	4,190,779,881.96	117.60

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	150210	15国开10	2,400,000	260,064,000.00	7.30
2	019520	15国债20	1,200,000	119,988,000.00	3.37
3	150205	15国开05	1,000,000	104,310,000.00	2.93
4	1280287	12郴州债	1,200,000	102,996,000.00	2.89
5	1380352	13平度国资债	700,000	75,978,000.00	2.13

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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	445,951.88
2	应收证券清算款	43,703,387.44
3	应收股利	-
4	应收利息	92,801,532.29
5	应收申购款	4,298,636.06
6	其他应收款	600.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	141,250,107.67

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	110030	格力转债	3,079,713.60	0.09
2	128009	歌尔转债	1,680,021.20	0.05
3	110031	航信转债	1,380,199.20	0.04

8.12.5 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
1,183	2,098,771.85	2,461,179,738.97	99.13%	21,667,358.31	0.87%

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本基金	823,202.39	0.0332%

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	0
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(2013年8月23日)基金份额总额	618,283,865.01
本报告期期初基金份额总额	874,494,111.04
本报告期基金总申购份额	2,947,538,684.99
减:本报告期基金总赎回份额	1,339,185,698.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,482,847,097.28

§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。

经上海浦东发展银行股份有限公司决定,邓从国同志自2015年4月1日起担任资产托管与养老金业务部总经理职务。

自2016年1月起,上海浦东发展银行股份有限公司更新了组织架构并调整部门名称,聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

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3年聘请安永华明会计师事务所(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	
申万宏源	2	1,589,861,275.55	100.00%	1,433,609.39	100.00%	-

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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、个股分析的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
申万宏源	1,419,142,550.84	100.00%	149,545,170,000.00	100.00%	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一六年三月二十五日