

易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金

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 1 月 1 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 | 14 |
| 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 | 16 |
| 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 | 16 |
| § 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 | 17 |
| § 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 | 22 |
| § 8 | 投资组合报告 | 44 |
| 8.1 | 期末基金资产组合情况 | 44 |
| 8.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 45 |
| 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 | 45 |
| 8.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动 | 45 |
| 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 | 46 |

| | | |
|------|---|----|
| 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 | 期末上市基金前十名持有人 | 47 |
| 9.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 48 |
| 9.4 | 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 | 49 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 | 49 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 49 |
| 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 | 54 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 54 |
| 12.2 | 存放地点 | 54 |
| 12.3 | 查阅方式 | 54 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------------------|
| 基金名称 | 易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 易方达永旭定期开放债券 |
| 场内简称 | 易基永旭 |
| 基金主代码 | 161117 |
| 交易代码 | 161117 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式，本基金合同生效后，每封闭运作两年，集中开放一次申购和赎回 |
| 基金合同生效日 | 2012 年 6 月 19 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 | 667,757,932.48 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2012 年 7 月 18 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金在封闭期与开放期将采取不同的投资策略，力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期增值。</p> <p>封闭期内，在遵循债券组合久期与封闭期适当匹配的基础上，本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来的市场利率、信用利差水平、利率期限结构的变化，并据此对债券组合进行调整，力争提高债券组合的总投资收益。</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 两年期银行定期存款收益率（税前）+0.5% |

| | |
|--------|--|
| 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低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。 |
|--------|--|

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|-----------------------------------|---------------------|
| 名称 | | 易方达基金管理有限公司 | 中国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 | 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 |

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 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 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 |
|---------------|----------------|----------------|------------------|
| 本期已实现收益 | 74,436,925.64 | 57,868,440.97 | 93,960,363.73 |
| 本期利润 | 94,837,721.59 | 127,634,785.51 | 33,205,765.39 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1420 | 0.1145 | 0.0197 |
| 本期加权平均净值利润率 | 13.19% | 11.20% | 1.94% |
| 本期基金份额净值增长率 | 14.13% | 13.42% | 1.88% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末 | 2014 年末 | 2013 年末 |
| 期末可供分配利润 | 22,057,337.03 | 21,741,539.92 | -29,084,070.92 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0330 | 0.0326 | -0.0173 |
| 期末基金资产净值 | 735,306,774.38 | 714,590,181.32 | 1,656,228,098.55 |
| 期末基金份额净值 | 1.101 | 1.070 | 0.983 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2015 年末 | 2014 年末 | 2013 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 36.77% | 19.84% | 5.66% |

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

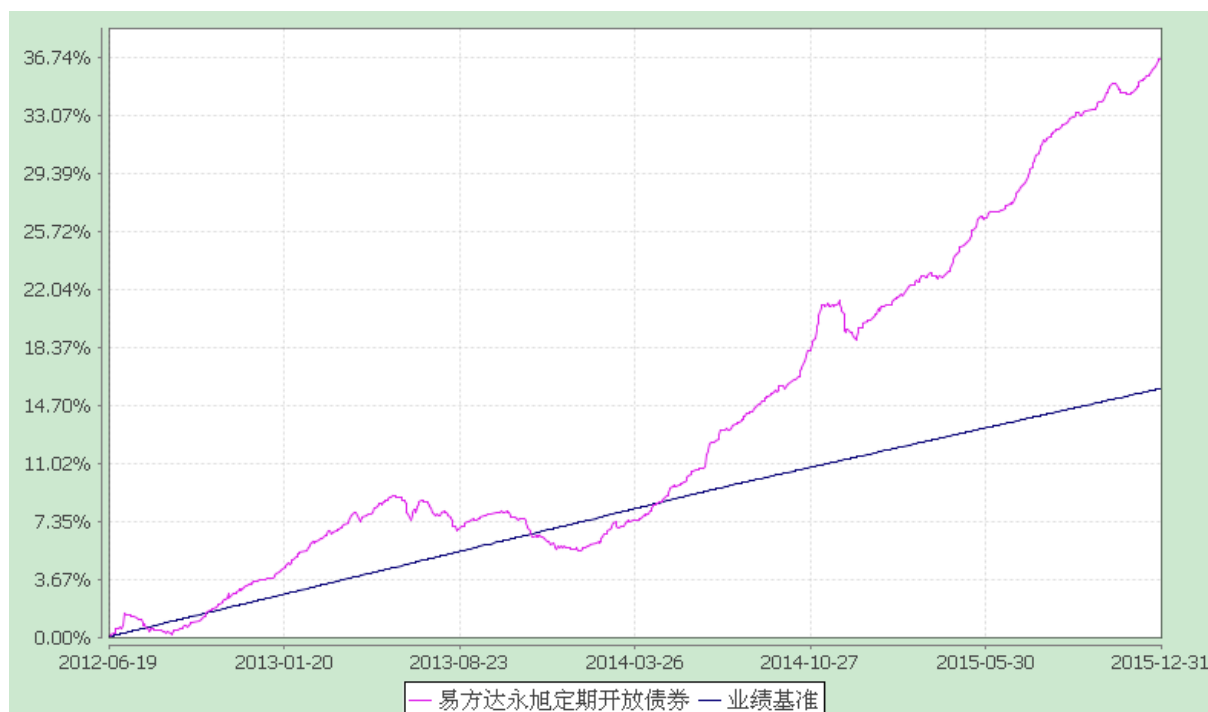
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 2.60% | 0.08% | 1.07% | 0.01% | 1.53% | 0.07% |
| 过去六个月 | 7.25% | 0.07% | 2.14% | 0.01% | 5.11% | 0.06% |
| 过去一年 | 14.13% | 0.09% | 4.25% | 0.01% | 9.88% | 0.08% |
| 过去三年 | 31.87% | 0.11% | 13.29% | 0.01% | 18.58% | 0.10% |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 36.77% | 0.11% | 15.75% | 0.01% | 21.02% | 0.10% |

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

易方达永旭添利定期开放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

(2012 年 6 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日)

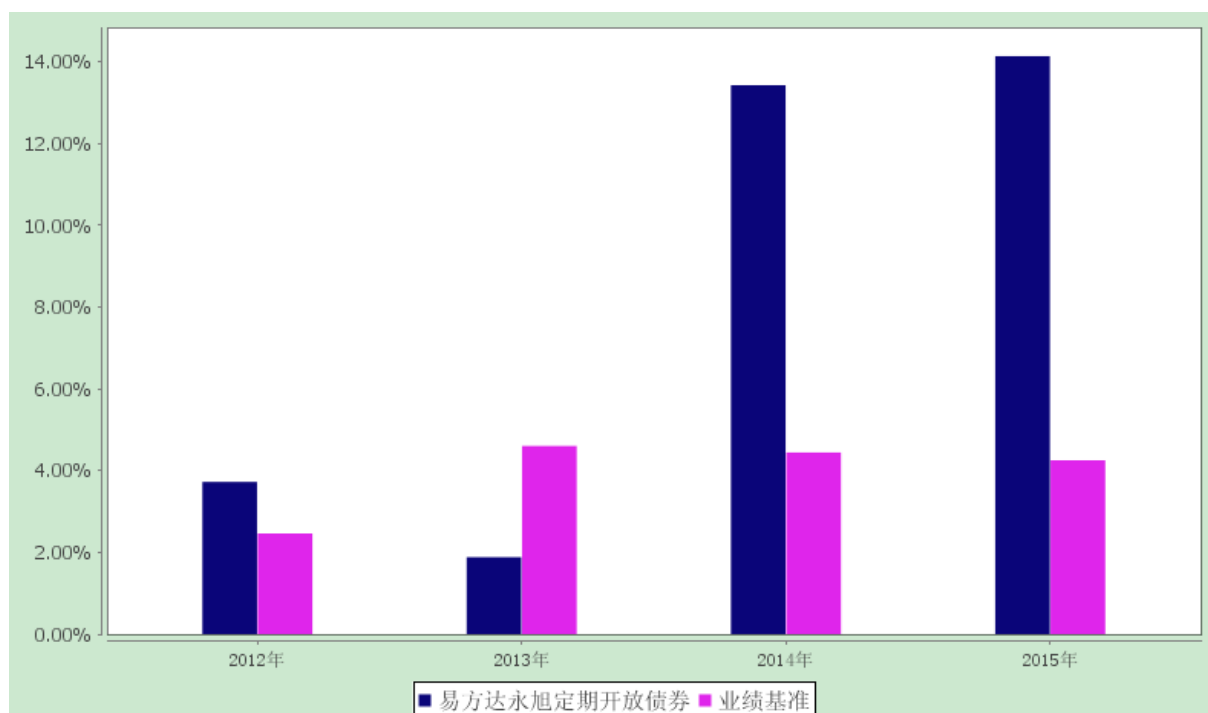


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 36.77%，同期业绩比较基准收益率为 15.75%。

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

易方达永旭添利定期开放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2012年6月19日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|-------------|----------------|-----------|----------------|----|
| 2015年 | 1.110 | 74,121,128.53 | - | 74,121,128.53 | - |
| 2014年 | 0.440 | 29,381,349.37 | - | 29,381,349.37 | - |
| 2013年 | 0.660 | 111,230,603.55 | - | 111,230,603.55 | - |
| 合计 | 2.210 | 214,733,081.45 | - | 214,733,081.45 | - |

§ 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

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 | | |
| 胡剑 | 本基金的基金经理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金的基金经理（自 2013 年 07 月 30 日至 2015 年 03 月 13 日）、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理（自 2013 年 04 月 22 日至 2015 年 03 月 13 日）、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理、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、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益研究部总经理 | 2013-04-22 | 2015-03-14 | 9 年 | 硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理。 |
| 刘琦 | 本基金的基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理（自 2013 年 04 月 22 日至 2015 年 01 月 09 日）、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理（自 2013 年 04 月 02 日至 2015 年 06 月 12 日） | 2013-04-22 | 2015-03-14 | 7 年 | 博士研究生，曾任嘉实基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司助理副总裁，易方达基金管理有限公司固定收益投资部投资经理。 |
| 李一硕 | 本基金的基金经理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达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、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）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 | 2014-07-12 | - | 7 年 | 硕士研究生，曾任瑞银证券有限公司研究员，中国国际金融有限公司研究员，易方达基金管理有限公司研究员。 |

| | | | | | |
|--|---------------------------------|--|--|--|--|
| | 的基金经理助理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理 | | | | |
|--|---------------------------------|--|--|--|--|

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》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、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 年债券市场走势整体延续了 2014 年的牛市行情，在流动性宽裕的局面下，债券资产是各类投资者较为偏好的品种。全年看收益率呈现明显的下行态势，不过中间也出现过数次调整。

年初至春节期间，随着资金面较去年末逐渐宽松以及经济基本面仍然维持在偏弱水平，收益率整体稳步持续走低。春节后债市资金面开始趋于紧张，叠加降息后市场获利盘兑现的行为比较集中，且财政部批复地方政府债务置换额度带来利率债供给上升的预期，债券市场收益率一度有所回升。进入 4 月后，在宽松流动性的推动下收益率重新开始下行，同时央行降准政策释放的资金规模可观，带动银行间回购利率迅速下行，各期限债券收益率也明显回落。但 5 月中旬以后，投资者对于未来经济复苏的预期有所增加，打新策略得益于其稳定的回报也显著分流了债券市场需求。5 月及 6 月虽然央行两次宣布降息，但对债券市场带来的利好影响均非常有限。

三季度央行货币政策继续维持宽松态度，宏观经济基本面也出现恶化，债市收益率在波动中下行，且中长端品种下行幅度相对更加明显，收益率曲线呈现牛市平坦化变动。四季度初工业增加值

及投资数据仍低于预期，投资者对于货币政策的宽松预期继续升温。不过 11 月初几个因素导致债券市场出现一波回调。美联储 10 月议息会议暗示年底有可能加息，市场对美国加息预期突然上升，全球债券收益率一度明显上扬，国内债券市场同样抛压加剧，不过此轮债券市场调整的幅度较为有限。进入 12 月后，虽然经济数据中开始出现了部分积极信号，但随着配置需求持续释放，债市收益率快速走低。

操作上，组合保持高杠杆运作的思路，得益于融资成本处于低位以及市场收益率持续下行，全年组合净值显著增长。

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 1.101 元，本报告期份额净值增长率为 14.13%，同期业绩比较基准收益率为 4.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着 2015 年末债券市场走出一波超预期的行情，债券收益率可能已经较为充分的反映了未来一段时间内货币政策的宽松预期。2016 年初长端债券的绝对收益率已经与 08 年末至 09 年初的历史阶段性低点较为接近，各类中高评级信用债的信用利差也已经降低至约四分之一分位数的历史偏低水平。同时各类收益率曲线的期限利差同样处于偏窄的区间内。

我们比较关注未来可能影响债券市场的几个因素。首先仍然是央行货币宽松政策可能低于市场预期的风险。虽然我们认为央行货币政策仍处于宽松周期内，但其政策出台的节奏及力度较难预期，往往滞后于经济和通胀下滑的走势。实际上，自去年 10 月下旬的“双降”以来，央行在货币政策上释放的积极信号已经比较有限，尤其是 2016 年初以来，尽管银行间市场流动性持续紧张，但市场机构预期的降准政策迟迟没有兑现。其次，持续的财政政策刺激对实体经济的效果可能逐步会有所体现，尤其是 2016 年政府将加大相关政策力度，包括扩大赤字率、增加政策性银行贷款及发行专项建设债券等手段。最后，虽然供给侧结构性改革仍然是政策的主要着力点，但预计去产能进程中带来的负面冲击很可能相对温和，且政府对经济托底意愿仍然强烈。

总体而言，2016 年债券市场波动性很可能有所加剧，我们将维持谨慎乐观的策略方向，避免进行过于极端的配置操作。当然，在当前的经济形势下，宏观经济增速难以出现明显回升的迹象，央行很可能仍将维持宽松的货币政策取向，保持社会流动性的整体充裕，债券市场的风险总体而言仍比较可控。

信用市场方面，高评级品种流动性溢价将维持在偏低水平，但中低评级板块信用风险释放的进程则可能刚刚开始，未来可能会有更多信用风险事件出现，对此必须保持高度的警惕，在配置上提前防范。

本组合将基本延续高杠杆、高静态收益率的投资策略。未来我们仍将把防范信用风险置于首位，关注信用资质可能下沉的持仓个券，并及时作出调整。

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

根据相关法律法规及《易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金合同》,本报告期内已实施的利润分配为 74,121,128.53 元,其中 2015 年 1 月 19 日(场外)、2015 年 1 月 20 日(场内)实施的利润分配 18,029,464.21 元是对 2014 年度的利润进行分配。本报告期末应分配尚未实施的利润分配为 17,645,869.63 元;本基金已于 2016 年 1 月 15 日(场外)、2016 年 1 月 18 日(场内)进行了利润分配,每 10 份基金份额派发红利 0.27 元,总分配金额为 18,029,464.21 元。

§ 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永旭添利定期开放债券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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，易方达永旭添利定期开放债券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永旭添利定期开放债券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，易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了4次利润分配，分配金额为74,121,128.53元。

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永旭添利定期开放债券型证券投资基金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 21042 号

易方达永旭添利定期开放债券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永旭添利定期开放债券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 年度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永旭添利定期开放债券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，上述易方达永旭添利定期开放债券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，公允反映了易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 注册会计师
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：易方达永旭添利定期开放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 | 附注号 | 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 | 7.4.7.1 | 16,592,634.67 | 3,543,636.14 |
| 结算备付金 | | 59,296,679.71 | 57,749,908.88 |
| 存出保证金 | | 15,853.57 | 46,530.59 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,437,955,666.55 | 1,431,479,666.71 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 债券投资 | | 1,437,955,666.55 | 1,431,479,666.71 |
| 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 | | 977,834.41 | 6,527,298.85 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 32,376,710.42 | 33,563,956.28 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | 37,500.00 | 37,500.00 |
| 资产总计 | | 1,547,252,879.33 | 1,532,948,497.45 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 795,839,019.74 | 814,199,147.55 |
| 应付证券清算款 | | 15,091,971.80 | 2,826,856.32 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 433,416.57 | 424,584.89 |
| 应付托管费 | | 123,833.32 | 121,309.99 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 29,884.48 | 15,022.08 |
| 应交税费 | | 2,932.20 | 2,932.20 |
| 应付利息 | | 62,046.84 | 378,463.10 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |

| | | | |
|-------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 363,000.00 | 390,000.00 |
| 负债合计 | | 811,946,104.95 | 818,358,316.13 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 667,757,932.48 | 667,757,932.48 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 67,548,841.90 | 46,832,248.84 |
| 所有者权益合计 | | 735,306,774.38 | 714,590,181.32 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,547,252,879.33 | 1,532,948,497.45 |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.101 元，基金份额总额 667,757,932.48 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达永旭添利定期开放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 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | | 116,729,697.46 | 166,587,937.29 |
| 1.利息收入 | | 84,130,834.65 | 111,572,399.25 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 877,982.56 | 12,507,878.78 |
| 债券利息收入 | | 83,252,852.09 | 98,224,315.86 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | 408,780.82 |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 431,423.79 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 12,198,066.86 | -15,283,347.77 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 12,198,066.86 | -15,118,832.70 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | -164,515.07 |
| 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 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 20,400,795.95 | 69,766,344.54 |
| 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 | - | 532,541.27 |
| 减：二、费用 | | 21,891,975.87 | 38,953,151.78 |
| 1. 管理人报酬 | | 5,035,184.67 | 8,034,464.36 |
| 2. 托管费 | | 1,438,624.21 | 2,295,561.23 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 22,298.95 | 39,848.15 |
| 5. 利息支出 | | 14,912,490.14 | 28,063,100.82 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 14,912,490.14 | 28,063,100.82 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 483,377.90 | 520,177.22 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 94,837,721.59 | 127,634,785.51 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 94,837,721.59 | 127,634,785.51 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达永旭添利定期开放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） | 667,757,932.48 | 46,832,248.84 | 714,590,181.32 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 94,837,721.59 | 94,837,721.59 |

| | | | |
|--|----------------------------------|----------------|-------------------|
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -74,121,128.53 | -74,121,128.53 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 667,757,932.48 | 67,548,841.90 | 735,306,774.38 |
| 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） | 1,685,312,169.47 | -29,084,070.92 | 1,656,228,098.55 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 127,634,785.51 | 127,634,785.51 |
| 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） | -1,017,554,236.99 | -22,337,116.38 | -1,039,891,353.37 |
| 其中：1.基金申购款 | 600,053,215.47 | 26,986,823.02 | 627,040,038.49 |
| 2.基金赎回款 | -1,617,607,452.46 | -49,323,939.40 | -1,666,931,391.86 |
| 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） | - | -29,381,349.37 | -29,381,349.37 |

| | | | |
|-----------------|----------------|---------------|----------------|
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 667,757,932.48 | 46,832,248.84 | 714,590,181.32 |
|-----------------|----------------|---------------|----------------|

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

易方达永旭添利定期开放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[2012]第 323 号《关于核准易方达永旭添利定期开放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《易方达永旭添利定期开放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，《易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,685,312,169.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 637,503.20 份基金份额。本基金为契约型、开放式基金，本基金自基金合同生效后，每封闭运作两年，集中开放一次申购和赎回。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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》、《易方达永旭添利定期开放债券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。

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

开放期内，本基金不进行收益分配。

本基金封闭期内的收益分配原则如下：

- (1) 基金收益分配采用现金方式；
- (2) 每一基金份额享有同等分配权；
- (3) 在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- (4) 基金合同生效满 3 个月后，若基金在每季最后一个交易日收盘后每 10 份基金份额可分配利润金额高于 0.05 元（含），则基金须进行收益分配，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 80%；
- (5) 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；
- (6) 本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；
- (7) 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

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。

7.4.5.3 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收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 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 16,592,634.67 | 3,543,636.14 |
| 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 | 16,592,634.67 | 3,543,636.14 |

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 | | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 813,746,124.88 | 825,466,496.55 | 11,720,371.67 |
| | 银行间市场 | 593,798,718.01 | 612,489,170.00 | 18,690,451.99 |
| | 合计 | 1,407,544,842.89 | 1,437,955,666.55 | 30,410,823.66 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,407,544,842.89 | 1,437,955,666.55 | 30,410,823.66 |
| 项目 | | 上年度末 | | |
| | | 2014 年 12 月 31 日 | | |
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 1,055,863,904.31 | 1,063,855,596.71 | 7,991,692.40 |
| | 银行间市场 | 365,605,734.69 | 367,624,070.00 | 2,018,335.31 |
| | 合计 | 1,421,469,639.00 | 1,431,479,666.71 | 10,010,027.71 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 1,421,469,639.00 | 1,431,479,666.71 | 10,010,027.71 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 665.02 | 579.92 |
| 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 | 26,683.50 | 25,987.50 |
| 应收债券利息 | 32,349,354.70 | 33,537,367.96 |
| 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 | 7.20 | 20.90 |
| 合计 | 32,376,710.42 | 33,563,956.28 |

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 12 月 31 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|--------------------------|
| 其他应收款 | 37,500.00 | 37,500.00 |
| 待摊费用 | - | - |
| 合计 | 37,500.00 | 37,500.00 |

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 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 29,884.48 | 15,022.08 |
| 合计 | 29,884.48 | 15,022.08 |

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 | 上年度末 2014 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 | 363,000.00 | 390,000.00 |
| 合计 | 363,000.00 | 390,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 667,757,932.48 | 667,757,932.48 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 667,757,932.48 | 667,757,932.48 |

注：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 |
|--------------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 21,741,539.92 | 25,090,708.92 | 46,832,248.84 |
| 本期利润 | 74,436,925.64 | 20,400,795.95 | 94,837,721.59 |
| 本期基金份额交易产生的 变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -74,121,128.53 | - | -74,121,128.53 |
| 本期末 | 22,057,337.03 | 45,491,504.87 | 67,548,841.90 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 33,644.31 | 76,784.75 |
| 定期存款利息收入 | - | 11,419,027.75 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 843,929.94 | 996,898.12 |
| 其他 | 408.31 | 15,168.16 |
| 合计 | 877,982.56 | 12,507,878.78 |

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无股票投资收益。

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 | 上年度可比期间 |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 804,506,255.41 | 2,673,377,773.11 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 768,826,751.57 | 2,618,870,634.86 |
| 减：应收利息总额 | 23,481,436.98 | 69,625,970.95 |
| 买卖债券差价收入 | 12,198,066.86 | -15,118,832.70 |

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 卖出资产支持证券成交总额 | - | 19,872,000.00 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | - | 20,000,000.00 |
| 减：应收利息总额 | - | 36,515.07 |
| 资产支持证券投资收益 | - | -164,515.07 |

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 1.交易性金融资产 | 20,400,795.95 | 69,766,344.54 |
| ——股票投资 | - | - |
| ——债券投资 | 20,400,795.95 | 69,766,344.54 |
| ——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 | 20,400,795.95 | 69,766,344.54 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | - | 487,541.27 |
| 其他 | - | 45,000.00 |
| 合计 | - | 532,541.27 |

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 13,448.95 | 18,873.15 |

| | | |
|-----------|-----------|-----------|
| 银行间市场交易费用 | 8,850.00 | 20,975.00 |
| 合计 | 22,298.95 | 39,848.15 |

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | 2014年1月1日至2014年12月31日 |
| 审计费用 | 63,000.00 | 90,000.00 |
| 信息披露费 | 300,000.00 | 300,000.00 |
| 银行汇划费 | 23,727.90 | 33,577.22 |
| 银行间账户维护费 | 36,000.00 | 36,000.00 |
| 上市费 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 其他 | 650.00 | 600.00 |
| 合计 | 483,377.90 | 520,177.22 |

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

根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2016 年 1 月 15 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.27 元，分配金额为 18,029,464.21 元。

除上述事项外，截至本会计报表批准报出日，本基金无其它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、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、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。

7.4.10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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

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 | 5,035,184.67 | 8,034,464.36 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 37,793.74 | 89,528.81 |

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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首日起 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。

7.4.10.2.2 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 | 1,438,624.21 | 2,295,561.23 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,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首日起 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。

7.4.10.3 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1月1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 |
| - | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2014年1月1日至2014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 | 49,986,671.92 | 118,800,458.08 | - | - | - | - |

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

份额单位:份

| 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 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| | 报告期初持有的基金份额 | 192,677,263.97 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | 192,677,263.97 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 192,677,263.97 | 192,677,263.97 |
| 报告期末持有的基金份额占基 | 28.85% | 28.85% |

| | | |
|--------|--|--|
| 金总份额比例 | | |
|--------|--|--|

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
| | 2015年1月1日至2015年12月31日 | | 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 |
| 中国工商银行 | 16,592,634.67 | 33,644.31 | 3,543,636.14 | 76,784.75 |

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1月1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 |
| - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 | | | | | |
| 2014年1月1日至2014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 | 041459014 | 14 广汇能源 CP001 | 分销 | 100,000 | 9,990,000.00 |
| 广发证券、中国工商银行 | 011480001 | 14 兖矿 SCP001 | 分销 | 300,000 | 30,000,000.00 |

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

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 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 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|------------|---------------|---------------|-----------|---------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2015-01-19 | 2015-01-20 | 2015-01-19 | 0.270 | 18,029,464.21 | - | 18,029,464.21 | - |
| 2 | 2015-04-14 | 2015-04-15 | 2015-04-14 | 0.290 | 19,364,978.93 | - | 19,364,978.93 | - |
| 3 | 2015-07-14 | 2015-07-15 | 2015-07-14 | 0.260 | 17,361,706.46 | - | 17,361,706.46 | - |
| 4 | 2015-10-20 | 2015-10-21 | 2015-10-20 | 0.290 | 19,364,978.93 | - | 19,364,978.93 | - |
| 合计 | | | | 1.110 | 74,121,128.53 | - | 74,121,128.53 | - |

注：（1）本基金同时具备场内除息日和场外除息日，且两除息日不为同一天。本基金每次收益分配的除息日中，第一个除息日为场内除息日，第二个除息日为场外除息日。（2）根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2016 年 1 月 15 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.27 元，分配金额为 18,029,464.21 元。

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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股票。

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 226,839,019.74 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 |
|-----------|--------|------------|------------|---------|---------------|
| 011598116 | 15 中城建 | 2016-01-04 | 100.16 | 500,000 | 50,080,000.00 |

| | | | | | |
|-----------|------------------|------------|--------|-----------|----------------|
| | SCP005 | | | | |
| 101356012 | 13 酒钢 MTN001 | 2016-01-04 | 102.95 | 500,000 | 51,475,000.00 |
| 101452019 | 14 红狮 MTN002 | 2016-01-04 | 104.66 | 200,000 | 20,932,000.00 |
| 101474009 | 14 沪世茂 MTN002 | 2016-01-04 | 106.19 | 200,000 | 21,238,000.00 |
| 1382214 | 13 魏桥铝 MTN2 | 2016-01-04 | 103.43 | 270,000 | 27,926,100.00 |
| 1380023 | 13 甬东新城 债 | 2016-01-06 | 105.99 | 400,000 | 42,396,000.00 |
| 1382298 | 13 新天山 MTN1 | 2016-01-06 | 100.96 | 120,000 | 12,115,200.00 |
| 1480525 | 14 天能债 02 | 2016-01-06 | 106.18 | 100,000 | 10,618,000.00 |
| 合计 | | | | 2,290,000 | 236,780,300.00 |

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 569,000,000.00 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。

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的低风险品种，日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

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 183.31%(2014 年 12 月 31 日：205.01%)。

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 | 上年度末 2014年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 20,409,619.18 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 232,942,522.31 | 0.00 |
| 合计 | 232,942,522.31 | 20,409,619.18 |

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 | 上年度末 2014年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 54,650,082.29 | 104,572,861.05 |
| AAA 以下 | 1,182,712,416.65 | 1,340,034,554.44 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 1,237,362,498.94 | 1,444,607,415.49 |

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，包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、资产支持证券、可分离转债存债、债券回购、银行存款等固定收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。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金不参与可转换债券投资。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 | 16,592,634.67 | - | - | - | 16,592,634.67 |
| 结算备付金 | 59,296,679.71 | - | - | - | 59,296,679.71 |
| 存出保证金 | 15,853.57 | - | - | - | 15,853.57 |
| 交易性金融资产 | 392,396,444.12 | 991,831,222.43 | 53,728,000.00 | - | 1,437,955,666.55 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-------------------------|-----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 产 | | | | | |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 977,834.41 | 977,834.41 |
| 应收利息 | - | - | - | 32,376,710.42 | 32,376,710.42 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | 37,500.00 | 37,500.00 |
| 资产总计 | 468,301,612.07 | 991,831,222.43 | 53,728,000.00 | 33,392,044.83 | 1,547,252,879.33 |
| 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 | 795,839,019.74 | - | - | - | 795,839,019.74 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 15,091,971.80 | 15,091,971.80 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 433,416.57 | 433,416.57 |
| 应付托管费 | - | - | - | 123,833.32 | 123,833.32 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 29,884.48 | 29,884.48 |
| 应交税费 | - | - | - | 2,932.20 | 2,932.20 |
| 应付利息 | - | - | - | 62,046.84 | 62,046.84 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 363,000.00 | 363,000.00 |
| 负债总计 | 795,839,019.74 | - | - | 16,107,085.21 | 811,946,104.95 |
| 利率敏感度缺口 | -327,537,407.67 | 991,831,222.43 | 53,728,000.00 | 17,284,959.62 | 735,306,774.38 |
| 上年度末 | | | | | |
| 2014 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 | 3,543,636.14 | - | - | - | 3,543,636.14 |
| 结算备付金 | 57,749,908.88 | - | - | - | 57,749,908.88 |
| 存出保证金 | 46,530.59 | - | - | - | 46,530.59 |
| 交易性金融资产 | 319,467,645.62 | 870,988,147.25 | 241,023,873.84 | - | 1,431,479,666.71 |

| | | | | | |
|-----------|-----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| | | | | | 71 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 6,527,298.85 | 6,527,298.85 |
| 应收利息 | - | - | - | 33,563,956.28 | 33,563,956.28 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | 37,500.00 | 37,500.00 |
| 资产总计 | 380,807,721.23 | 870,988,147.25 | 241,023,873.84 | 40,128,755.13 | 1,532,948,497.45 |
| 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 | 814,199,147.55 | - | - | - | 814,199,147.55 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 2,826,856.32 | 2,826,856.32 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 424,584.89 | 424,584.89 |
| 应付托管费 | - | - | - | 121,309.99 | 121,309.99 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 15,022.08 | 15,022.08 |
| 应交税费 | - | - | - | 2,932.20 | 2,932.20 |
| 应付利息 | - | - | - | 378,463.10 | 378,463.10 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 390,000.00 | 390,000.00 |
| 负债总计 | 814,199,147.55 | - | - | 4,159,168.58 | 818,358,316.13 |
| 利率敏感度缺口 | -433,391,426.32 | 870,988,147.25 | 241,023,873.84 | 35,969,586.55 | 714,590,181.32 |

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 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------|--------------------------|
| 1.市场利率下降 25 个基点 | 5,940,391.65 | 8,540,362.94 |
| 2.市场利率上升 25 个基点 | -5,888,761.34 | -8,455,087.41 |

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。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，同时本基金不参与可转换债券投资，于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 1,437,955,666.55 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 1,038,696,846.71 元，第二层次 392,782,820.00 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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 1,437,955,666.55 | 92.94 |
| | 其中：债券 | 1,437,955,666.55 | 92.94 |
| | 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 | 75,889,314.38 | 4.90 |

| | | | |
|---|--------|------------------|--------|
| 7 | 其他各项资产 | 33,407,898.40 | 2.16 |
| 8 | 合计 | 1,547,252,879.33 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

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 | 120,139,000.00 | 16.34 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 1,011,453,666.55 | 137.56 |
| 5 | 企业短期融资券 | 110,287,000.00 | 15.00 |
| 6 | 中期票据 | 196,076,000.00 | 26.67 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|------------------|--------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,437,955,666.55 | 195.56 |

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 | 019901 | 09 国债 01 | 700,000 | 70,049,000.00 | 9.53 |
| 2 | 101356012 | 13 酒钢 MTN001 | 500,000 | 51,475,000.00 | 7.00 |
| 3 | 011547003 | 15 华润 SCP003 | 500,000 | 50,205,000.00 | 6.83 |
| 4 | 019515 | 15 国债 15 | 500,000 | 50,090,000.00 | 6.81 |
| 5 | 011598116 | 15 中城建 SCP005 | 500,000 | 50,080,000.00 | 6.81 |

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 本基金本报告期没有投资股票。

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 | 15,853.57 |

| | | |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 977,834.41 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 32,376,710.42 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 37,500.00 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 33,407,898.40 |

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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 |
| 1,201 | 556,001.61 | 651,551,694.58 | 97.57% | 16,206,237.90 | 2.43% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|----|------------------------------|--------------|----------|
| 1 | 平安中信同方股份有限公司企业年金计划 | 3,661,719.00 | 56.87% |
| 2 | 内蒙古银行股份有限公司企业年金计划—交通银行股份有限公司 | 1,141,300.00 | 17.73% |
| 3 | 平安中行哈尔滨东安发动机(集团)有限公司企业年金计划 | 541,765.00 | 8.41% |
| 4 | 肖陈斌 | 300,000.00 | 4.66% |

| | | | |
|----|-----|------------|-------|
| 5 | 顾致民 | 147,918.00 | 2.30% |
| 6 | 陈庆亮 | 61,600.00 | 0.96% |
| 7 | 刘昆 | 54,200.00 | 0.84% |
| 8 | 安瑜 | 50,000.00 | 0.78% |
| 9 | 许先水 | 49,000.00 | 0.76% |
| 10 | 陈梅 | 46,400.00 | 0.72% |

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1.08 | 0.0000% |

9.4 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(2012年6月19日)基金份额总额 | 1,685,312,169.47 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 667,757,932.48 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 667,757,932.48 |

§ 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连续 4 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 63,000.00 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 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 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,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、个股分析报告及丰富全面的信息；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 | 457,910,483.49 | 51.78% | 30,151,222,000.00 | 24.31% | - | - |
| 国信证券 | 257,371,912.34 | 29.11% | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 168,996,270.86 | 19.11% | 93,858,800,000.00 | 75.69% | - | - |
| 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 | 易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金分红公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-01-13 |
| 2 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海证券为销售机构、在上海证券推出定期定额投资业务及参加上海证券申购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 | 2015-01-19 |
| 3 | 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 | 2015-01-26 |

| | | 理人网站 | |
|----|--|--------------------------|------------|
| 4 | 易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金（161117）场内交易价格波动的提示公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-01-27 |
| 5 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加久富财富为销售机构、在久富财富推出定期定额投资业务及参加久富财富申购与定期定额投资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 | 2015-01-28 |
| 6 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中金公司为销售机构并参加中金公司申购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 | 2015-02-02 |
| 7 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泉州银行为销售机构、在泉州银行推出定期定额投资业务及参加泉州银行申购与定期定额投资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 | 2015-02-10 |
| 8 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加海银基金销售为销售机构、在海银基金销售网上交易申购与定期定额投资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 | 2015-02-13 |
| 9 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加数米基金申购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 | 2015-03-05 |
| 10 | 易方达永旭添利定期开放债券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 | 2015-03-14 |
| 11 | 易方达基金管理有限公司关于公司旗下基金固定收益品种估值方法调整的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-03-20 |
| 12 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信建投期货为销售机构、在中信建投期货推出定期定额投资业务及参加中信建投期货申购与定期定额投资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 | 2015-03-23 |
| 13 | 易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金分红公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-04-08 |
| 14 | 易方达基金管理有限公司关于成立易方达国际控股有限公司的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-04-29 |
| 15 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行和手机银行申购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 | 2015-06-01 |
| 16 | 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 | 2015-06-11 |

| | | 理人网站 | |
|----|--|--------------------------|------------|
| 17 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加第一创业证券申购及定期定额投资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 | 2015-07-06 |
| 18 | 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 |
| 19 | 易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金分红公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-07-08 |
| 20 | 易方达基金管理有限公司关于在招商银行开通旗下部分开放式基金转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-07-10 |
| 21 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加汇付金融为销售机构、参加汇付金融申购与定期定额投资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 | 2015-07-22 |
| 22 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加河北银行为销售机构、参加河北银行申购与定期定额投资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 | 2015-07-27 |
| 23 | 易方达基金管理有限公司关于参加数米基金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 | 2015-07-31 |
| 24 | 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 |
| 25 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券申购及定期定额投资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 | 2015-08-12 |
| 26 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信期货为销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-08-12 |
| 27 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加江南农村商业银行作为销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-08-13 |
| 28 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中金公司申购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 | 2015-08-24 |
| 29 | 易方达基金管理有限公司关于参加天天基金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 | 2015-08-27 |
| 30 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国都证券申购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 | 2015-08-31 |
| 31 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放 | 中国证券报、上海证券 | 2015-08-31 |

| | | | |
|----|--|--------------------------|------------|
| | 式基金参加河北银行电子渠道申购及定期定额投资费率优惠活动的公告 | 报、证券时报及基金管理人网站 | |
| 32 | 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 |
| 33 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加盈米财富为销售机构、参加盈米财富申购与定期定额投资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 | 2015-10-12 |
| 34 | 易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金分红公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-10-14 |
| 35 | 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 |
| 36 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加西南证券申购及定期定额投资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 | 2015-11-02 |
| 37 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加联泰资产为销售机构、参加联泰资产申购与定期定额投资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 | 2015-11-02 |
| 38 | 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 |
| 39 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加长量基金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 | 2015-11-10 |
| 40 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加凯石财富为销售机构、参加凯石财富申购与定期定额投资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 | 2015-11-20 |
| 41 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加陆金所资管为销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-11-30 |
| 42 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加联讯证券为销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站 | 2015-12-02 |
| 43 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加利得基金为销售机构、参加利得基金申购与定期定额投资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 | 2015-12-14 |
| 44 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加众禄金融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 | 2015-12-18 |
| 45 | 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 |

| | | | |
|----|---|--------------------------|------------|
| 46 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大泰金石为销售机构、参加大泰金石申购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 | 2015-12-21 |
| 47 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行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 | 2015-12-31 |
| 48 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国邮政储蓄银行个人网上银行和手机银行申购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 | 2015-12-31 |
| 49 | 易方达基金管理有限公司关于在深圳新兰德开通旗下部分开放式基金定期定额投资及转换业务、参加深圳新兰德定期定额投资费率优惠活动的的公告 | 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.中国证监会核准易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4.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