

易方达平稳增长证券投资基金

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。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。

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.....	5
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.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§ 5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6	审计报告.....	15
6.1	管理层对财务报表的责任.....	15
6.2	注册会计师的责任.....	15
6.3	审计意见.....	15
§ 7	年度财务报表.....	16
7.1	资产负债表.....	16
7.2	利润表.....	18
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4	报表附注.....	20
§ 8	投资组合报告.....	43
8.1	期末基金资产组合情况.....	43
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	46
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	50

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	50
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	50
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	50
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
8.12	投资组合报告附注	50
§ 9	基金份额持有人信息	51
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 10	开放式基金份额变动	52
§ 11	重大事件揭示	52
11.1	基金份额持有人大会决议	52
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	52
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
11.4	基金投资策略的改变	53
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8	其他重大事件	54
§ 12	备查文件目录	62
12.1	备查文件目录	62
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达平稳增长证券投资基金
基金简称	易方达平稳增长混合
基金主代码	110001
交易代码	110001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	840,593,686.28 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	追求资本在低风险水平下的平稳增长。
投资策略	本基金通过在股票和债券之间相对平衡的资产配置实现降低风险、稳定收益的目标。正常情况下，本基金资产配置的比例范围是：股票资产 30%—65%；债券资产 30%—65%；现金资产不低于 5%。其中，投资于具有持续发展能力的上市公司的资产比例不低于本基金股票投资总资产的 80%。
业绩比较基准	上证 A 股指数
风险收益特征	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，高于债券型基金及货币市场基金。正常情况下，本基金将控制基金资产净值波动的标准差不超过上证 A 股指数波动的标准差的 65%（置信度为 90%）；在此前提下，通过合理配置股票和债券资产比重，并将股票投资集中于具有持续发展能力的上市公司，努力实现股票市场上涨期间基金资产净值涨幅不低于上证 A 股指数涨幅的 60%，股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证 A 股指数跌幅的 50%。

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	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张南	王永民
	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942
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1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1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	田国立

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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	1,178,090,518.56	276,759,427.16	261,305,621.46
本期利润	1,142,937,045.80	370,109,522.88	337,731,286.17
加权平均基金份额本期利润	1.1678	0.2675	0.2119

本期加权平均净值利润率	50.75%	17.99%	16.37%
本期基金份额净值增长率	62.16%	19.51%	17.70%
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	1,398,073,445.67	803,941,136.26	568,368,217.86
期末可供分配基金份额利润	1.6632	0.6471	0.3877
期末基金资产净值	2,238,667,131.95	2,046,352,119.18	2,034,370,124.22
期末基金份额净值	2.663	1.647	1.388
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	578.11%	318.17%	249.91%

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

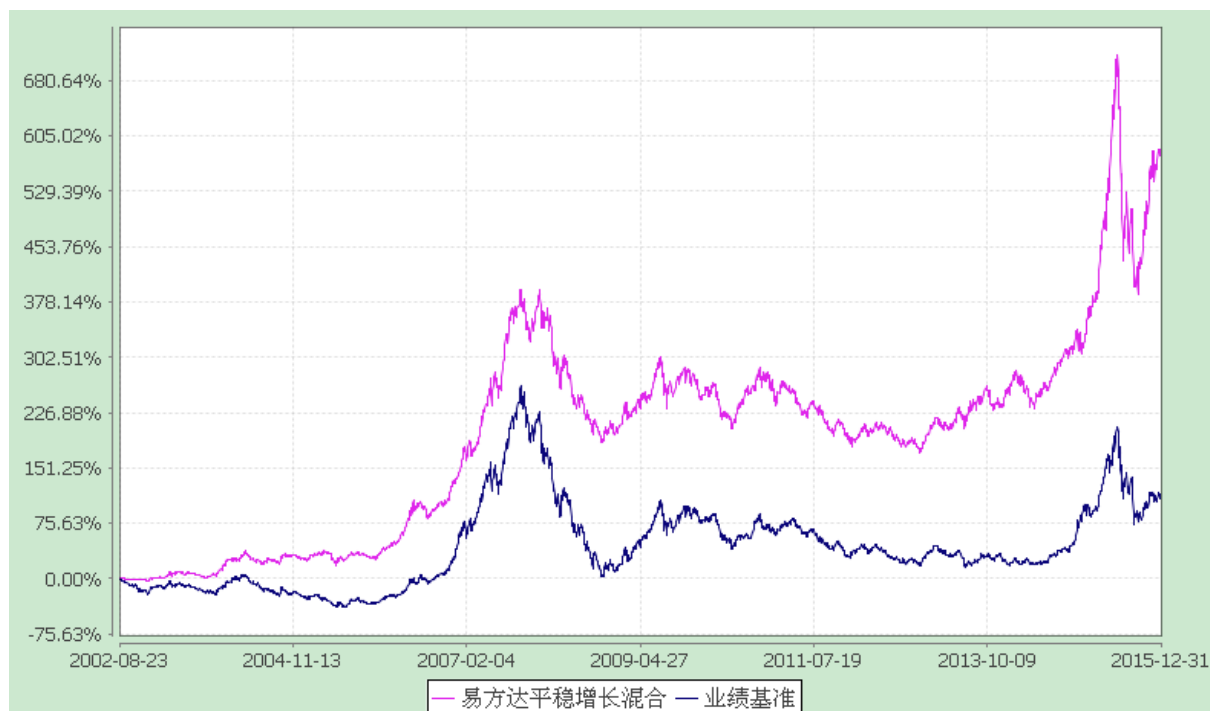
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	26.93%	1.58%	15.85%	1.57%	11.08%	0.01%
过去六个月	3.78%	2.20%	-17.31%	2.61%	21.09%	-0.41%
过去一年	62.16%	2.03%	9.29%	2.45%	52.87%	-0.42%
过去三年	128.10%	1.42%	55.90%	1.69%	72.20%	-0.27%
过去五年	84.12%	1.21%	25.99%	1.49%	58.13%	-0.28%
自基金合同生效起至今	578.11%	1.15%	110.49%	1.67%	467.62%	-0.52%

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

易方达平稳增长证券投资基金

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

（2002 年 8 月 23 日至 2015 年 12 月 31 日）

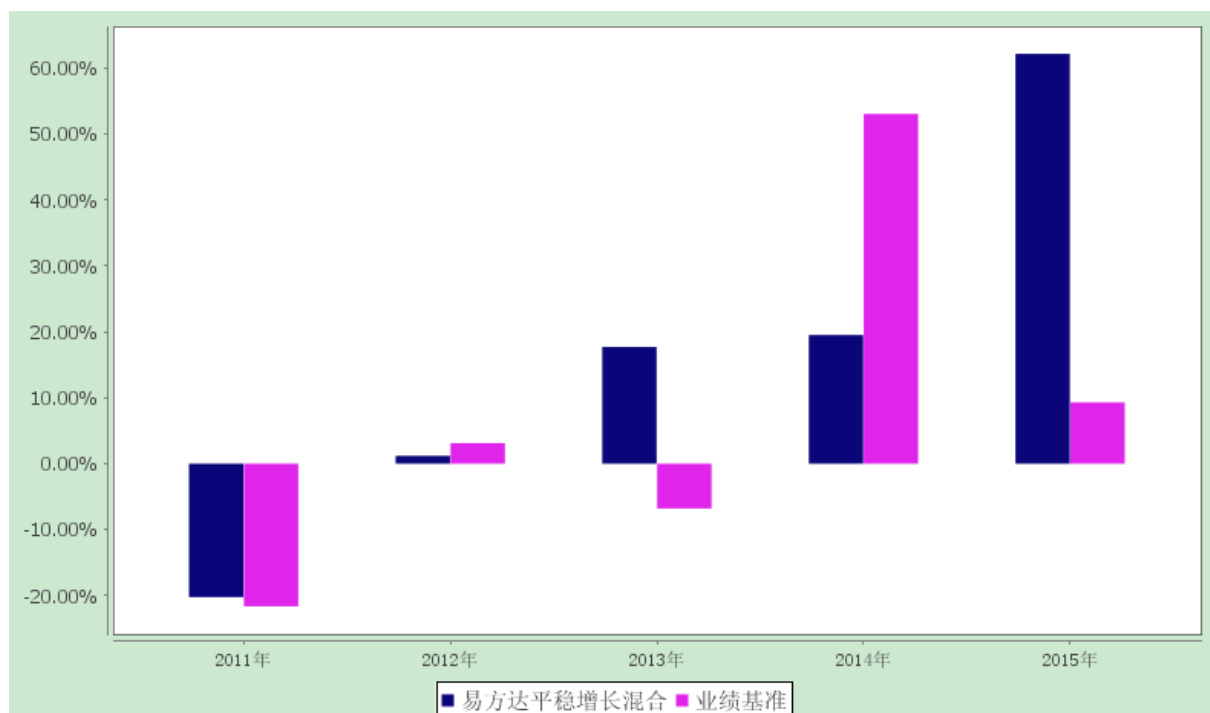


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 578.11%，同期业绩比较基准收益率为 110.49%。

3.2.3 过去五年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

易方达平稳增长证券投资基金

过去五年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
2015 年	0.050	1,947,009.34	4,134,480.77	6,081,490.11	-
2014 年	0.100	4,648,612.29	9,967,402.57	14,616,014.86	-
2013 年	0.100	5,254,122.12	11,481,301.83	16,735,423.95	-
合计	0.250	11,849,743.75	25,583,185.17	37,432,928.92	-

§ 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		
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、易方达科翔混合型证券投资基金的基金经理、投资一部总经理	2012-09-28	-	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、基金投资部基金经理助理、投资一部总经理助理、

					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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人

员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年中国经济以 GDP 同比增速 6.9% 完成收官，虽然增速较前些年下了一个台阶，经济发展进入“新常态”，但是在世界主要经济体中仍然是一个非常高的增长速度。为应对宏观经济下行的风险，2015 年政府积极推进产业结构调整、进一步释放体制红利并鼓励创新，同时配套相对宽松的货币政策；对外，积极推动“一带一路”战略和人民币国际化进程。从微观结构上看，拉动国内经济增长的主要动力也由原来的投资、出口转变为现在的消费增长，第三产业在拉动经济增长和就业中的作用越来越大。经过近些年在经济周期底部的探索，改革、创新和“一带一路”基本确立了中国经济在“新常态”下增长的三驾马车地位。

回顾 2015 年的中国资本市场，可以用“波澜壮阔”来形容。上半年在货币政策持续宽松和 A 股市场新的融资杠杆工具的驱动下，股票市场出现了显著的大幅上涨。但是在 6 月份出现了以限制杠杆风险为导火索的股灾，整个市场经历了一场罕见的“洗礼”，直到在救市政策引导下，市场情绪逐步稳定后形成估值底部，并慢慢恢复。2015 年在股市中出现的高频词汇“杠杆”、“配资”、“高估值”、“天价股”和“股灾”等，其实背后都隐含了同一个大逻辑，即流动性，这是影响 2015 年 A 股市场最大的

因素，可谓成也萧何、败也萧何。回顾 2015 年的市场，虽然流动性因素（包含杠杆因素）制造了巨大的波动，但是疯狂之后，市场还是为我们清晰地留下了两条最主要的投资主线：一个是改革红利，另一个是创新经济。这也是“新常态”下中国经济最强劲的两个支撑点，资本市场实际还是高效地将其发掘出来了。

2015 年本基金对于市场主要驱动因素和相应板块的投资机会做了前瞻性布局：一方面投资于代表新产业发展方向的高科技领域，如大数据、信息安全、工业 4.0 和半导体等；另一方面关注由于制度改革和商业模式创新所释放的红利机会，积极布局国企改革、“互联网+”等领域。本基金在投资过程中始终秉承风险和收益综合考量的原则，积极控制仓位并调整资产配置结构，通过均衡配置与灵活操作应对市场风险。

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 2.663 元，本报告期份额净值增长率为 62.16%，同期业绩比较基准收益率为 9.29%。

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，本基金将继续坚持从宏观角度研判大势与从微观细节深入印证相结合的投研思路，从产业中观层面入手做好阶段性的组合配置。从当前形势看，2016 年经济下行压力将持续，传统制造业产能过剩和大面积亏损的状况短期内预计难以好转。在供给侧改革背景下，需要提防可能出现的系统性风险，国内主要资产的预期回报率水平可能出现进一步下调。同时受到美联储加息与人民币国际化等外部因素的影响，货币政策的操作空间将小于 2015 年，流动性在保持相对宽松的情况下，边际趋紧的局面已经出现。2016 年资本市场可能将持续受到人民币资产贬值压力与降低国内实体经济资金成本之间的矛盾，以及流动性阶段波动的双重影响。

虽然充满挑战，但是我们看到中国政府立足于持续改革和创新拉动经济增长和产业升级的方针没有改变，相关配套政策还在逐步落地。因此，经济面临硬着陆风险的可能性不大，经济质量还在稳步提升，新的经济增长点正在慢慢成长。作为实体经济的晴雨表，虽然股市的整体估值水平和风险偏好会受到外部金融环境的影响起起伏伏，但是依然会在资金方面青睐于改革与创新两条主线：改革集中体现在从国企改革到供给侧改革，再到军队体制改革等广泛领域；创新集中体现在从技术创新到商业模式创新，再到金融行业创新等广泛领域。这些领域的变化将出现一系列新的投资机会，需要我们积极研究与布局。

基于以上判断，本基金在新的一年里将依据自上而下的宏观策略，合理安排资产配置，密切关注经济基本面、政策面、流动性和企业盈利的变化。通过对类债券资产、避险资产、高贝塔资产以及高成长资产的综合配置与投资，注重对优质公司的长线布局，争取获得风险可控条件下的投资回报。

综上所述，本基金希望通过管理人积极、勤勉的努力，为投资者奉献更加持续、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

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

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

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

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

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

（6）督促落实销售适当性管理制度，推动完善客户投诉处理机制流程。

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

（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《易方达平稳增长证券投资基金基金合同》，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，本报告期内 2015 年 1 月 15 日实施的利润分配 6,081,490.11 元是对 2014 年度的利润进行分配，本基金本报告期末仍应进行利润分配；本基金已于 2016 年 1 月 14 日进行了利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.20 元，总分配金额为 16,854,415.45 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达平稳增长证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

安永华明(2016)审字第 60468000_G08 号

易方达平稳增长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平稳增长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基金管理人易方达基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，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而导致的重大错报。

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基金管理人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，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达平

稳增长证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册会计师

赵雅 李明明

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2016-03-18

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达平稳增长证券投资基金

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	191,064,536.34	43,612,134.81
结算备付金		8,683,981.19	2,698,605.03
存出保证金		832,186.18	444,424.50
交易性金融资产	7.4.7.2	2,023,754,275.99	1,946,728,693.17
其中：股票投资		1,330,250,954.19	1,185,519,965.22
基金投资		-	-
债券投资		693,503,321.80	761,208,727.95
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		15,978,207.39	57,342,149.75
应收利息	7.4.7.5	15,297,712.02	12,389,068.59
应收股利		-	-

应收申购款		1,209,480.10	1,877,340.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,256,820,379.21	2,065,092,416.32
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		-	-
应付证券清算款		-	4,109,257.29
应付赎回款		8,537,444.16	7,213,624.95
应付管理人报酬		2,851,893.62	2,719,006.72
应付托管费		475,315.60	453,167.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,510,939.14	2,463,254.89
应交税费		621,330.19	621,330.19
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,156,324.55	1,160,655.31
负债合计		18,153,247.26	18,740,297.14
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	840,593,686.28	1,242,410,982.92
未分配利润	7.4.7.10	1,398,073,445.67	803,941,136.26
所有者权益合计		2,238,667,131.95	2,046,352,119.18
负债和所有者权益总计		2,256,820,379.21	2,065,092,416.32

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.663 元，基金份额总额 840,593,686.28 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达平稳增长证券投资基金

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 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		1,206,233,839.13	418,132,789.40
1.利息收入		27,674,343.14	29,310,352.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,040,583.08	656,389.81
债券利息收入		26,629,398.95	27,932,418.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,361.11	721,544.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,212,979,432.96	295,194,071.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,186,344,180.61	274,272,598.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	23,494,646.87	15,435,863.99
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	3,140,605.48	5,485,608.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-35,153,472.76	93,350,095.72
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	733,535.79	278,270.16
减：二、费用		63,296,793.33	48,023,266.52
1. 管理人报酬		33,626,809.65	30,873,224.54
2. 托管费		5,604,468.21	5,145,537.48

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	23,577,226.79	11,237,228.81
5. 利息支出		-	279,672.65
其中：卖出回购金融资产支出		-	279,672.65
6. 其他费用	7.4.7.19	488,288.68	487,603.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,142,937,045.80	370,109,522.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,142,937,045.80	370,109,522.88

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达平稳增长证券投资基金

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）	1,242,410,982.92	803,941,136.26	2,046,352,119.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,142,937,045.80	1,142,937,045.80
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）	-401,817,296.64	-542,723,246.28	-944,540,542.92
其中：1.基金申购款	276,986,188.49	392,779,997.09	669,766,185.58
2.基金赎回款	-678,803,485.13	-935,503,243.37	-1,614,306,728.50
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-6,081,490.11	-6,081,490.11

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）	840,593,686.28	1,398,073,445.67	2,238,667,131.95
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）	1,466,001,906.36	568,368,217.86	2,034,370,124.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	370,109,522.88	370,109,522.88
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）	-223,590,923.44	-119,920,589.62	-343,511,513.06
其中：1.基金申购款	212,052,454.97	111,748,267.02	323,800,721.99
2.基金赎回款	-435,643,378.41	-231,668,856.64	-667,312,235.05
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）	-	-14,616,014.86	-14,616,014.86
五、期末所有者权益（基金净值）	1,242,410,982.92	803,941,136.26	2,046,352,119.18

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

易方达平稳增长证券投资基金(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”)证监基金字[2002]40 号文《关于同意易方达平稳增长证券投资基金设立的批复》的核准,由易方达基金管理有限公司作为基金发起人向社会公开发行募集,基金合同于 2002 年 8 月 23 日正式生效,首次设立募集规模为 4,678,106,974.62 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,注册登记机构为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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 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

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债),并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4) 买入返售金融资产收入,按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6) 债券投资收益/(损失):

卖出交易所上市债券:于成交日确认债券投资收益/(损失),并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账;

卖出银行间同业市场交易债券:于成交日确认债券投资收益/(损失),并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提;

(3) 卖出回购金融资产支出,按融入资金应收或实际收到的总额及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式,投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资(简称“再投资方式”);如果投资者没有明示选择,则视为选择现金方式;

(2) 每一基金份额享有同等分配权;

- (3) 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- (4) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；
- (5) 如果基金投资当期出现亏损，则不进行收益分配；
- (6) 基金收益分配比例按照有关规定执行；
- (7) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配；年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成；
- (8) 法律、法规或监管机构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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

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 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	191,064,536.34	43,612,134.81
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	191,064,536.34	43,612,134.81

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		1,103,949,760.47	1,330,250,954.19	226,301,193.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	9,240,315.14	9,279,321.80	39,006.66
	银行间市场	670,980,904.41	684,224,000.00	13,243,095.59
	合计	680,221,219.55	693,503,321.80	13,282,102.25
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,784,170,980.02	2,023,754,275.99	239,583,295.97
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		971,027,663.91	1,185,519,965.22	214,492,301.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	244,629,360.47	297,047,727.95	52,418,367.48
	银行间市场	456,334,900.06	464,161,000.00	7,826,099.94
	合计	700,964,260.53	761,208,727.95	60,244,467.42
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,671,991,924.44	1,946,728,693.17	274,736,768.73

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	27,783.50	6,554.54
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	3,907.80	1,215.34
应收债券利息	15,265,646.22	12,381,098.81
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	374.50	199.90
合计	15,297,712.02	12,389,068.59

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,510,939.14	2,461,725.98
银行间市场应付交易费用	-	1,528.91
合计	4,510,939.14	2,463,254.89

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	750,000.00	750,000.00

应付赎回费	6,324.55	10,655.31
预提费用	400,000.00	400,000.00
合计	1,156,324.55	1,160,655.31

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	1,242,410,982.92	1,242,410,982.92
本期申购	276,986,188.49	276,986,188.49
本期赎回（以“-”号填列）	-678,803,485.13	-678,803,485.13
本期末	840,593,686.28	840,593,686.28

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	1,173,678,445.93	-369,737,309.67	803,941,136.26
本期利润	1,178,090,518.56	-35,153,472.76	1,142,937,045.80
本期基金份额交易产生的变动数	-588,518,958.54	45,795,712.26	-542,723,246.28
其中：基金申购款	426,961,986.27	-34,181,989.18	392,779,997.09
基金赎回款	-1,015,480,944.81	79,977,701.44	-935,503,243.37
本期已分配利润	-6,081,490.11	-	-6,081,490.11
本期末	1,757,168,515.84	-359,095,070.17	1,398,073,445.67

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	932,317.06	609,208.99

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	94,708.03	41,220.91
其他	13,557.99	5,959.91
合计	1,040,583.08	656,389.81

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 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
卖出股票成交总额	8,212,528,632.88	3,846,973,237.51
减：卖出股票成本总额	7,026,184,452.27	3,572,700,638.81
买卖股票差价收入	1,186,344,180.61	274,272,598.70

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	967,844,667.29	693,176,005.08
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	931,988,981.35	659,288,020.05
减：应收利息总额	12,361,039.07	18,452,121.04
买卖债券差价收入	23,494,646.87	15,435,863.99

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

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
股票投资产生的股利收益	3,140,605.48	5,485,608.81
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,140,605.48	5,485,608.81

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年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
1.交易性金融资产	-35,153,472.76	93,350,095.72
——股票投资	11,808,892.41	26,875,086.93
——债券投资	-46,962,365.17	66,475,008.79
——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	-35,153,472.76	93,350,095.72

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	733,535.79	278,270.16
印花税手续费返还	-	-
其他	-	-
合计	733,535.79	278,270.16

7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	23,571,351.79	11,232,078.81
银行间市场交易费用	5,875.00	5,150.00
合计	23,577,226.79	11,237,228.81

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	51,638.68	51,203.04
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	650.00	400.00
合计	488,288.68	487,603.04

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 14 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 0.20 元，分配金额为 16,854,415.45 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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	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、基金销售机构
广东粤财信托有限公司（以下简称“粤财信托”）	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	-	-	342,632,795.84	4.75%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	311,932.09	4.75%	265,110.46	10.77%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	33,626,809.65	30,873,224.54
其中：支付销售机构的客户维护费	983,396.67	847,646.67

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	5,604,468.21	5,145,537.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

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，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

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
中国银行	-	-	-	-	30,380,000.00	10,028.67

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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
中国银行	191,064,536.34	932,317.06	43,612,134.81	609,208.99

注：本基金的银行存款由基金托管人中国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

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。

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	2015-01-15	-	2015-01-15	0.050	1,947,009.34	4,134,480.77	6,081,490.11	-
合计				0.050	1,947,009.34	4,134,480.77	6,081,490.11	-

注：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 14 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 0.20 元，分配金额为 16,854,415.45 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000669	金鸿能源	2015-01-13	2016-01-15	非公开发行流通受限	21.10	22.28	950,000	20,045,000.00	21,166,000.00	-

注：中油金鸿能源投资股份有限公司于 2015 年 6 月 26 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 2 元人民币现金（含税）。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000034	深信泰丰	2015-12-24	重大事项停牌	27.95	-	-	89,600	2,272,873.05	2,504,320.00	-
000901	航天科技	2015-08-19	重大事项停牌	42.12	2016-02-18	47.59	1,150,000	55,913,026.98	48,438,000.00	-
000971	高升控股	2015-09-21	复牌交易不活跃	34.96	2015-12-31	26.39	707,866	14,627,568.07	24,746,995.36	注
000973	佛塑科技	2015-12-18	重大事项停牌	13.00	2016-02-22	11.70	7,190,181	87,937,198.61	93,472,353.00	-
002246	北化股份	2015-11-23	重大事项停牌	14.12	-	-	782,505	8,214,471.45	11,048,970.60	-
002544	杰赛科技	2015-08-31	重大事项停牌	41.42	-	-	853,517	26,230,704.70	35,352,674.14	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大事项停牌	56.68	-	-	42,200	2,183,661.00	2,391,896.00	-
300238	冠昊生物	2015-11-12	重大事项停牌	55.15	-	-	269,090	8,736,654.86	14,840,313.50	-
300242	明家科技	2015-12-18	重大事项停牌	49.96	2016-01-22	44.96	1,329,400	34,707,673.78	66,416,824.00	-
600847	万里股份	2015-08-18	重大事项停牌	32.18	-	-	200,000	5,537,725.00	6,436,000.00	-
600990	四创电子	2015-09-01	重大事项停牌	82.63	-	-	332,638	23,257,620.82	27,485,877.94	-

注：该股票在本期末虽已复牌但交易不活跃、流通仍受限，因而未采用市价估值。

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为 0，无抵押债券。

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为 0，无抵押债券。

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。

本基金是混合型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，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，且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 0.42%(2014 年 12 月 31 日：14.59%)。

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	上年度末
--------	-----	------

	2015年12月31日	2014年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	317,681,112.42	108,988,134.24
合计	317,681,112.42	108,988,134.24

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	3,181,568.83	104,700,580.03
AAA 以下	6,288,636.46	193,822,233.48
未评级	381,617,650.31	366,078,879.01
合计	391,087,855.60	664,601,692.52

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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	191,064,536.34	-	-	-	191,064,536.34
结算备付金	8,683,981.19	-	-	-	8,683,981.19
存出保证金	832,186.18	-	-	-	832,186.18
交易性金融资产	321,822,321.80	371,681,000.00	-	1,330,250,954.19	2,023,754,275.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	15,978,207.39	15,978,207.39
应收利息	-	-	-	15,297,712.02	15,297,712.02
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,209,480.10	1,209,480.10
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	522,403,025.51	371,681,000.00	-	1,362,736,353.70	2,256,820,379.21
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,537,444.16	8,537,444.16
应付管理人报酬	-	-	-	2,851,893.62	2,851,893.62

应付托管费	-	-	-	475,315.60	475,315.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,510,939.14	4,510,939.14
应交税费	-	-	-	621,330.19	621,330.19
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,156,324.55	1,156,324.55
负债总计	-	-	-	18,153,247.26	18,153,247.26
利率敏感度缺口	522,403,025.51	371,681,000.00	-	1,344,583,106.44	2,238,667,131.95
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	43,612,134.81	-	-	-	43,612,134.81
结算备付金	2,698,605.03	-	-	-	2,698,605.03
存出保证金	444,424.50	-	-	-	444,424.50
交易性金融资产	173,569,089.00	571,486,132.19	16,153,506.76	1,185,519,965.22	1,946,728,693.17
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	57,342,149.75	57,342,149.75
应收利息	-	-	-	12,389,068.59	12,389,068.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	596.42	-	-	1,876,744.05	1,877,340.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	220,324,849.76	571,486,132.19	16,153,506.76	1,257,127,927.61	2,065,092,416.32
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	-	-	-	-	-

应付证券清算款	-	-	-	4,109,257.29	4,109,257.29
应付赎回款	-	-	-	7,213,624.95	7,213,624.95
应付管理人报酬	-	-	-	2,719,006.72	2,719,006.72
应付托管费	-	-	-	453,167.79	453,167.79
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,463,254.89	2,463,254.89
应交税费	-	-	-	621,330.19	621,330.19
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,160,655.31	1,160,655.31
负债总计	-	-	-	18,740,297.14	18,740,297.14
利率敏感度缺口	220,324,849.76	571,486,132.19	16,153,506.76	1,238,387,630.47	2,046,352,119.18

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	2,662,633.86	2,288,118.38
	2.市场利率上升 25 个基点	-2,641,251.87	-2,268,256.33

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 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	1,330,250,954.19	59.42	1,185,519,965.22	57.93
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	1,330,250,954.19	59.42	1,185,519,965.22	57.93

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	65,222,670.32	53,568,969.86
	2.业绩比较基准下降 5%	-65,222,670.32	-53,568,969.86

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 975,950,729.65 元，属于第二层次的余额为 1,047,803,546.34 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 1,327,896,012.68 元，第二层次 618,832,680.49 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	1,330,250,954.19	58.94
	其中：股票	1,330,250,954.19	58.94
2	固定收益投资	693,503,321.80	30.73
	其中：债券	693,503,321.80	30.73

	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	199,748,517.53	8.85
7	其他各项资产	33,317,585.69	1.48
8	合计	2,256,820,379.21	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	1,030,694,266.34	46.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,201,092.00	1.35
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,949,529.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	3,308,375.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	157,568,113.34	7.04
J	金融业	12,072,911.76	0.54
K	房地产业	49,274,072.75	2.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	24,161,280.00	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	3,516,994.00	0.16

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	2,504,320.00	0.11
	合计	1,330,250,954.19	59.42

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000973	佛塑科技	7,190,181	93,472,353.00	4.18
2	300113	顺网科技	776,000	78,663,120.00	3.51
3	002260	德奥通航	1,666,000	75,303,200.00	3.36
4	002329	皇氏集团	2,600,000	72,540,000.00	3.24
5	002494	华斯股份	2,600,000	68,900,000.00	3.08
6	300242	明家科技	1,329,400	66,416,824.00	2.97
7	002517	泰亚股份	1,071,377	64,861,163.58	2.90
8	300199	翰宇药业	2,400,000	59,112,000.00	2.64
9	000901	航天科技	1,150,000	48,438,000.00	2.16
10	002101	广东鸿图	1,435,671	47,377,143.00	2.12
11	002284	亚太股份	2,005,819	41,480,336.92	1.85
12	002384	东山精密	2,000,000	40,040,000.00	1.79
13	600391	成发科技	747,744	38,778,003.84	1.73
14	002077	大港股份	1,891,105	37,727,544.75	1.69
15	002544	杰赛科技	853,517	35,352,674.14	1.58
16	600262	北方股份	800,000	33,840,000.00	1.51
17	600990	四创电子	332,638	27,485,877.94	1.23
18	000971	高升控股	707,866	24,746,995.36	1.11
19	002776	柏堡龙	314,600	24,161,280.00	1.08
20	600556	慧球科技	844,800	22,868,736.00	1.02
21	600703	三安光电	900,000	21,852,000.00	0.98
22	000669	金鸿能源	950,000	21,166,000.00	0.95
23	600850	华东电脑	300,000	15,495,000.00	0.69
24	300238	冠昊生物	269,090	14,840,313.50	0.66
25	300230	永利股份	379,200	14,170,704.00	0.63
26	000652	泰达股份	1,822,700	12,995,851.00	0.58
27	000563	陕国投 A	798,473	12,072,911.76	0.54
28	002565	上海绿新	993,400	11,871,130.00	0.53

29	600048	保利地产	1,085,200	11,546,528.00	0.52
30	600104	上汽集团	528,670	11,218,377.40	0.50
31	002246	北化股份	782,505	11,048,970.60	0.49
32	300248	新开普	279,936	10,399,622.40	0.46
33	002668	奥马电器	122,057	10,167,348.10	0.45
34	600475	华光股份	461,994	9,558,655.86	0.43
35	600236	桂冠电力	1,207,900	9,035,092.00	0.40
36	002474	榕基软件	364,480	8,729,296.00	0.39
37	600038	中直股份	160,000	8,436,800.00	0.38
38	600855	航天长峰	208,970	8,291,929.60	0.37
39	300390	天华超净	180,910	8,028,785.80	0.36
40	300165	天瑞仪器	300,000	7,836,000.00	0.35
41	002355	兴民钢圈	359,500	7,211,570.00	0.32
42	300035	中科电气	431,862	6,952,978.20	0.31
43	300101	振芯科技	220,900	6,518,759.00	0.29
44	600847	万里股份	200,000	6,436,000.00	0.29
45	002224	三力士	277,200	6,020,784.00	0.27
46	000835	长城动漫	249,500	5,571,335.00	0.25
47	002368	太极股份	79,818	5,355,787.80	0.24
48	600720	祁连山	586,788	5,181,338.04	0.23
49	002688	金河生物	195,625	4,560,018.75	0.20
50	600306	商业城	133,300	3,953,678.00	0.18
51	000858	五粮液	131,800	3,595,504.00	0.16
52	002425	凯撒股份	123,900	3,591,861.00	0.16
53	300299	富春通信	75,900	3,572,613.00	0.16
54	000978	桂林旅游	248,200	3,516,994.00	0.16
55	601799	星宇股份	92,417	3,485,045.07	0.16
56	002019	亿帆鑫富	85,400	3,416,000.00	0.15
57	600377	宁沪高速	378,100	3,308,375.00	0.15
58	600233	大杨创世	110,606	2,779,528.78	0.12
59	000034	深信泰丰	89,600	2,504,320.00	0.11
60	300038	梅泰诺	42,200	2,391,896.00	0.11

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	601318	中国平安	134,955,381.22	6.59
2	002296	辉煌科技	106,609,685.27	5.21
3	300059	东方财富	89,199,893.63	4.36

4	000973	佛塑科技	87,937,198.61	4.30
5	601989	中国重工	79,738,091.43	3.90
6	600016	民生银行	79,506,467.80	3.89
7	002260	德奥通航	79,266,721.42	3.87
8	002329	皇氏集团	75,501,736.50	3.69
9	000002	万 科 A	75,487,334.48	3.69
10	600571	信雅达	75,277,990.38	3.68
11	300248	新开普	72,904,891.04	3.56
12	000901	航天科技	72,673,042.86	3.55
13	000651	格力电器	72,216,713.36	3.53
14	002494	华斯股份	71,415,939.27	3.49
15	600585	海螺水泥	69,575,390.38	3.40
16	000021	深科技	67,367,631.23	3.29
17	600536	中国软件	66,643,959.52	3.26
18	300113	顺网科技	64,508,549.51	3.15
19	002517	泰亚股份	64,508,480.37	3.15
20	600219	南山铝业	62,795,674.80	3.07
21	600703	三安光电	60,557,079.76	2.96
22	300364	中文在线	59,821,570.73	2.92
23	002668	奥马电器	59,187,021.16	2.89
24	600570	恒生电子	56,254,163.62	2.75
25	000948	南天信息	53,508,444.85	2.61
26	600050	中国联通	53,356,727.85	2.61
27	600895	张江高科	52,921,294.97	2.59
28	600391	成发科技	51,829,737.01	2.53
29	002384	东山精密	51,414,609.50	2.51
30	601766	中国中车	50,580,758.45	2.47
31	601166	兴业银行	50,009,165.76	2.44
32	600500	中化国际	49,845,093.21	2.44
33	600446	金证股份	49,706,495.96	2.43
34	002657	中科金财	49,552,312.93	2.42
35	002197	证通电子	47,533,306.31	2.32
36	601398	工商银行	47,498,137.01	2.32
37	000712	锦龙股份	47,222,833.79	2.31
38	300130	新国都	46,830,606.33	2.29
39	000902	新洋丰	46,213,676.45	2.26
40	002594	比亚迪	45,054,987.28	2.20
41	600654	中安消	44,527,894.00	2.18
42	300231	银信科技	44,306,346.82	2.17
43	002101	广东鸿图	44,269,157.25	2.16
44	300238	冠昊生物	43,654,215.43	2.13
45	300242	明家科技	43,426,529.05	2.12
46	600787	中储股份	42,533,658.12	2.08

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	300199	翰宇药业	367,248,377.30	17.95
2	300253	卫宁软件	279,139,956.17	13.64
3	300059	东方财富	191,546,526.97	9.36
4	601318	中国平安	171,176,718.69	8.36
5	601166	兴业银行	107,917,437.55	5.27
6	000651	格力电器	98,510,564.15	4.81
7	002448	中原内配	94,396,351.92	4.61
8	600446	金证股份	94,046,329.93	4.60
9	600016	民生银行	84,086,529.78	4.11
10	300238	冠昊生物	82,266,103.46	4.02
11	300226	上海钢联	82,034,309.63	4.01
12	601989	中国重工	76,369,610.70	3.73
13	000002	万 科 A	76,366,281.29	3.73
14	600536	中国软件	76,074,928.32	3.72
15	600558	大西洋	71,220,000.86	3.48
16	300248	新开普	70,452,938.18	3.44
17	600219	南山铝业	68,692,665.13	3.36
18	000021	深科技	66,136,291.24	3.23
19	002657	中科金财	65,946,162.73	3.22
20	000902	新洋丰	65,567,488.41	3.20
21	600571	信雅达	65,125,405.86	3.18
22	600585	海螺水泥	62,030,280.30	3.03
23	600895	张江高科	59,220,713.81	2.89
24	000829	天音控股	57,376,144.29	2.80
25	300364	中文在线	56,910,399.09	2.78
26	002245	澳洋顺昌	55,570,993.33	2.72
27	002260	德奥通航	55,307,607.22	2.70
28	002022	科华生物	53,597,322.48	2.62
29	000768	中航飞机	52,351,663.07	2.56
30	603678	火炬电子	51,866,338.10	2.53
31	601766	中国中车	50,816,066.25	2.48
32	002390	信邦制药	50,743,230.06	2.48
33	600500	中化国际	50,540,873.13	2.47
34	300369	绿盟科技	50,204,735.47	2.45
35	600654	中安消	49,695,281.68	2.43

36	002296	辉煌科技	48,990,467.10	2.39
37	000948	南天信息	48,895,150.56	2.39
38	000669	金鸿能源	48,341,117.05	2.36
39	601398	工商银行	47,511,798.18	2.32
40	002011	盾安环境	46,619,789.72	2.28
41	002405	四维图新	46,613,727.18	2.28
42	600050	中国联通	46,491,658.35	2.27
43	300231	银信科技	45,858,428.68	2.24
44	002594	比亚迪	45,138,264.80	2.21
45	002236	大华股份	44,938,574.50	2.20
46	000712	锦龙股份	44,901,700.70	2.19
47	300130	新国都	44,639,471.28	2.18
48	600570	恒生电子	44,461,273.46	2.17
49	600701	工大高新	43,763,030.34	2.14
50	002285	世联行	43,340,928.32	2.12
51	600118	中国卫星	42,694,384.21	2.09
52	300098	高新兴	42,047,392.26	2.05
53	002668	奥马电器	41,759,480.61	2.04

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	7,159,106,548.83
卖出股票收入（成交）总额	8,212,528,632.88

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	684,224,000.00	30.56
	其中：政策性金融债	684,224,000.00	30.56
4	企业债券	9,279,321.80	0.41
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	693,503,321.80	30.98

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	150207	15 国开 07	1,100,000	113,729,000.00	5.08
2	130237	13 国开 37	1,100,000	111,496,000.00	4.98
3	150212	15 国开 12	900,000	91,944,000.00	4.11
4	130229	13 国开 29	600,000	62,034,000.00	2.77
5	150413	15 农发 13	600,000	60,066,000.00	2.68

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	832,186.18
2	应收证券清算款	15,978,207.39
3	应收股利	-
4	应收利息	15,297,712.02
5	应收申购款	1,209,480.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,317,585.69

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

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	000973	佛塑科技	93,472,353.00	4.18	重大事项停牌
2	300242	明家科技	66,416,824.00	2.97	重大事项停牌
3	000901	航天科技	48,438,000.00	2.16	重大事项停牌

§ 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
52,672	15,959.02	24,734,678.25	2.94%	815,859,008.03	97.06%

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	5.73	0.0000%

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(2002 年 8 月 23 日)基金份额总额	4,678,106,974.62
本报告期期初基金份额总额	1,242,410,982.92
本报告期基金总申购份额	276,986,188.49
减：本报告期基金总赎回份额	678,803,485.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	840,593,686.28

§ 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。

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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 14 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 100,000.00 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	
国泰君安	1	180,867,611.56	1.20%	164,658.71	1.19%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	2,859,247,864.11	19.01%	2,603,060.20	18.81%	-
安信证券	1	409,605,146.27	2.72%	372,900.87	2.69%	-
平安证券	1	714,612,231.51	4.75%	665,517.47	4.81%	-
华泰证券	2	2,644,471,351.95	17.58%	2,434,190.39	17.59%	-
国金证券	1	2,363,521,037.22	15.71%	2,188,508.95	15.81%	-
国都证券	1	1,235,249,507.66	8.21%	1,128,960.16	8.16%	-
银河证券	2	4,144,289,302.58	27.55%	3,832,744.70	27.70%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	492,588,537.75	3.27%	448,452.94	3.24%	-

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
国泰君安	4,401,083.60	0.61%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	13,549,824.32	1.88%	-	-	-	-
安信证券	91,656,662.40	12.69%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	91,161,069.40	12.63%	-	-	-	-
国金证券	121,189,977.60	16.78%	100,000,000.00	100.00%	-	-
国都证券	188,757,615.00	26.14%	-	-	-	-
银河证券	53,797,095.02	7.45%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	157,522,594.70	21.82%	-	-	-	-

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	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加哈尔滨银行网上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	2015-01-05
2	易方达平稳增长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	2015-01-13

		理人网站	
3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配金鸿能源（000669）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-15
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加龙湾农商银行为销售机构、在龙湾农商银行推出定期定额投资业务及参加龙湾农商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	2015-01-15
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
6	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	2015-01-26
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞银行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	2015-01-31
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长安银行为销售机构、在长安银行推出定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-02
9	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
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加富滇银行为销售机构、在富滇银行推出定期定额投资业务及参加富滇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	2015-03-03
11	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
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南海农商银行为销售机构、在南海农商银行推出定期定额投资业务及参加南海农商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	2015-03-17
13	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
14	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	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

	的公告		
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续参加中国工商银行个人电子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	2015-03-30
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞丰银行为销售机构、在瑞丰银行推出定期定额投资业务及参加瑞丰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	2015-03-30
17	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	2015-04-10
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加洛阳银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-24
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加恒丰银行为销售机构、参加恒丰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	2015-04-28
20	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
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天津银行为销售机构、参加天津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	2015-04-30
22	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加一路财富官方网站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	2015-05-28
23	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
24	易方达基金管理有限公司对市场上出现假冒公司客服电话进行诈骗活动的特别提示	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-11
25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加昆仑银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-19
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、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	2015-06-25
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加哈尔滨银行电子渠道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	2015-07-01
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

29	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-07
30	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
31	易方达基金管理有限公司关于在官方京东店开展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	2015-07-08
32	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-09
33	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-10
34	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-11
35	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-14
36	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-18
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
38	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
39	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加贵阳银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-30
40	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
41	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加浦发银行网上银行、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	2015-08-03
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鑫鼎盛为销售机构、参加鑫鼎盛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	2015-08-05
43	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	2015-08-05

		理人网站	
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平安银行橙子银行渠道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	2015-08-10
45	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
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
47	易方达基金管理有限公司关于在官方京东店开展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	2015-08-14
48	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-08-21
49	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
50	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-08-27
51	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
52	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加乐清农商银行销售机构、参加乐清农商银行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	2015-08-27
53	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-08-29
54	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
55	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放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	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
56	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加恒丰银行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	2015-08-31
57	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、参加陆金所资管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	2015-09-01

58	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-02
59	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-07
60	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加济安财富为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-21
61	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加新浪仓石为销售机构、参加新浪仓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	2015-09-22
62	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-26
63	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加汉口银行为销售机构、参加汉口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	2015-09-28
64	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-09
65	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
66	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-13
67	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加积木基金为销售机构、参加积木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	2015-10-15
68	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-16
69	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-17
70	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-21
71	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加临海农商银行为销售机构、参加临海农商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	2015-10-23
72	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	2015-10-28

	式基金增加天津农商银行为销售机构的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
73	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-28
74	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
75	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
76	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
77	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在民族证券开通定期定额投资业务并参加民族证券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	2015-11-05
78	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加德阳银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-06
79	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鹿城农商银行为销售机构、参加鹿城农商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	2015-11-06
80	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
81	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宁波银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-16
82	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加德州银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-19
83	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
84	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加积木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	2015-11-24
85	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加福建海峡银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-25
86	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	2015-11-27

	式基金参加德州银行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	
87	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
88	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加福建海峡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	2015-12-03
89	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-04
90	易方达基金管理有限公司关于在官方京东店开展基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-04
91	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-11
92	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
93	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
94	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
95	易方达基金管理有限公司关于在指数熔断情况下调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-31
96	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞银行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	2015-12-31
97	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加哈尔滨银行电子渠道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
98	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银行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	2015-12-31
99	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加苏州银行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	2015-12-31
100	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加浙商银行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	2015-12-31

101	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工商银行“2016 倾心回馈”基金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	2015-12-31
102	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
103	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
104	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. 中国证监会批准易方达平稳增长证券投资基金设立的文件；
2. 《易方达平稳增长证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达平稳增长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和营业执照。

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

