

易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一五年八月二十六日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 2 月 13 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12	投资组合报告附注	38
8	基金份额持有人信息	39
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	39
9	开放式基金份额变动	40
10	重大事件揭示	40
10.1	基金份额持有人大会决议	40
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4	基金投资策略的改变	40
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	40
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8	其他重大事件	42
11	备查文件目录	44
11.1	备查文件目录	44
11.2	存放地点	44
11.3	查阅方式	44

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	易方达创新驱动混合
基金主代码	000603
交易代码	000603
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 13 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,614,217,326.78 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在资产配置的基础上，本基金重点关注所在行业景气度较高且具有可持续性、所在行业竞争格局良好、管理层素质较高的创新驱动型公司。
业绩比较基准	50% × 沪深 300 指数收益率 + 50% × 中债总财富指数收益率
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，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-38797888	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-38799488	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	510620	100033
法定代表人	刘晓艳	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	273,990,280.57
本期利润	353,266,903.59
加权平均基金份额本期利润	0.1142
本期加权平均净值利润率	7.11%
本期基金份额净值增长率	43.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	230,830,931.17
期末可供分配基金份额利润	0.0639
期末基金资产净值	5,182,527,388.55
期末基金份额净值	1.434
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	43.40%

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。
4. 本基金合同于 2015 年 2 月 13 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

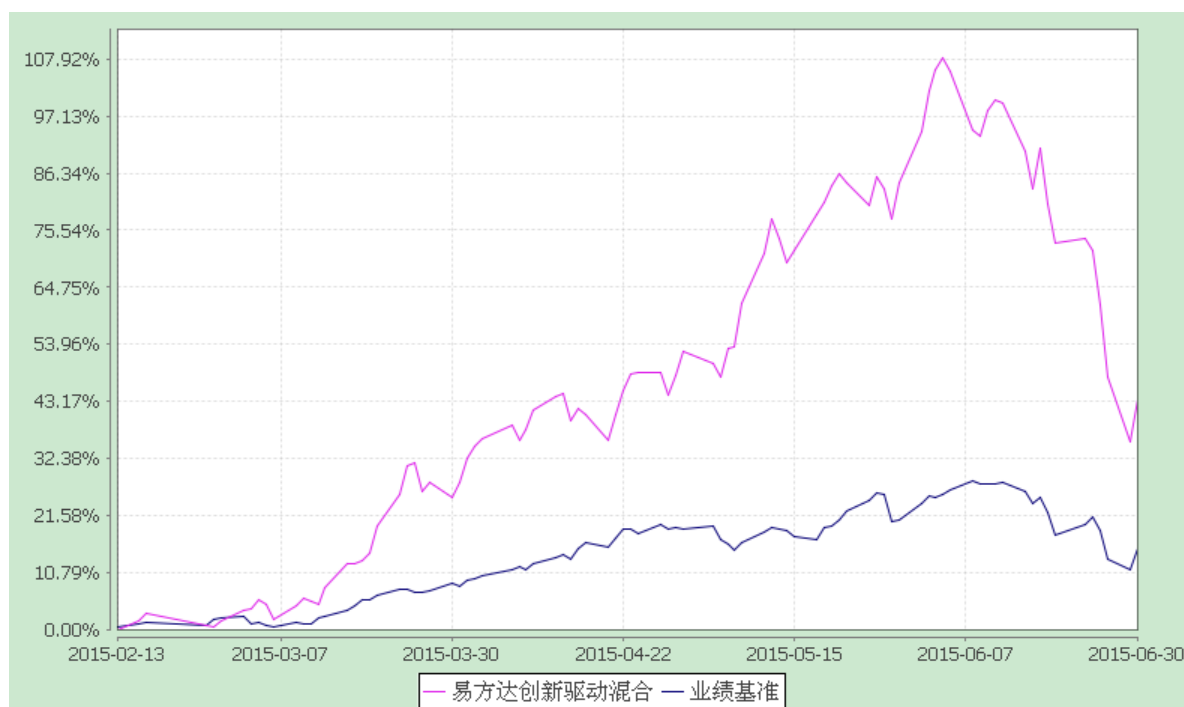
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-22.23%	4.35%	-3.65%	1.74%	-18.58%	2.61%
过去三个月	12.12%	3.36%	6.34%	1.31%	5.78%	2.05%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	43.40%	3.06%	15.37%	1.14%	28.03%	1.92%

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

易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015 年 2 月 13 日至 2015 年 6 月 30 日)



注：1. 本基金合同于 2015 年 2 月 13 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期

本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 43.40%，同期业绩比较基准收益率为 15.37%。

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、广东新三联投资发展有限公司等多个子公司。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 6 月 30 日,易方达旗下共管理 82 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 5348.85 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		
宋昆	本基金的基金经理、易方达科讯股票型证券投资基金的基金经理、易方达新兴成长混合型证券投资基金的基金经理、易方达新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、公募基金投资部副总经理	2015-02-13	-	9 年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、公募基金投资部总经理助理。

樊正伟	本基金的基金经理、易方达新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达积极成长证券投资基金的基金经理助理	2015-03-14	-	5 年	硕士研究生，曾任中国银行深圳分行职员，易方达基金管理有限公司渠道经理、研究员。
-----	---	------------	---	-----	---

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，宋昆的“任职日期”为基金合同生效之日，樊正伟的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 3 次，其中 2 次为为指数组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；1 次为不同基金经理管理的非指数基金因投资策略不同而发生的反向交

易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年，在央行偏松的货币政策操作以及积极入场的场外资金的推动下，市场整体风险偏好回升。上证综指上涨 32.23%，沪深 300 指数上涨 26.58%，深圳综指上涨 74.13%，成长股涨势领先，创业板综指上涨 106.65%。板块方面，上半年中信行业指数涨幅居前的行业包括：计算机、通信、餐饮旅游、轻工制造、纺织服装等；仅非银金融录得负收益。

本基金延续了一贯的投资思路，坚信在漫长的转型期内，战略新兴产业将是近年牛股的主要产地。2015 年上半年本基金的操作，基本保持了上述思路。

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 1.434 元，本报告期份额净值增长率为 43.40%，同期业绩比较基准收益率为 15.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自 6 月份以来，市场资金面和风险偏好两个方面都受到了较大的负面冲击：各大券商以及部分银行严厉查处场外配资问题，对资金面形成了巨大的负面冲击；市场出现向下剧烈调整，市场的风险偏好出现明显下降。因此，6 月份以来市场出现了猛烈调整，无论是主板指数，还是中小板、创业板指数都经历了大幅下挫。

在目前位置，A 股的整体市盈率已经有明显下降，加之政府的一系列规避金融不稳定的措施的出台，预计市场会逐步趋于稳定。与此同时，一批股票又开始逐渐地体现出投资的高性价比。

放眼中长期，能使中国经济进一步恢复活力的依然是不断崛起的新兴产业。随着人类走进移动互联、云计算时代，机器人为代表的人工智能将在制造业中承担举足轻重的作用。从繁重的生产中解放出来的人类，对于自身的需求必将更加重视，娱乐、医疗、环保、教育、体育产业必将迎来黄金发展时期。其中，互联网的垂直应用领域，将迅速而深刻地改变社会生活，值得我们高度地关注。

最后，衷心感谢持有人对本基金的信任和支持，我们将努力工作，力争回报大家的信任。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	185,172,320.75
结算备付金		15,329,272.42
存出保证金		1,156,437.20
交易性金融资产	6.4.7.2	5,377,806,128.32
其中：股票投资		5,129,014,928.82
基金投资		-
债券投资		248,791,199.50
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		356,510,773.19
应收利息	6.4.7.5	1,742,444.84
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		5,937,717,376.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		734,726,686.21
应付管理人报酬		10,505,539.88
应付托管费		1,750,923.29
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	7,220,985.27

应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	985,853.52
负债合计		755,189,988.17
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	3,614,217,326.78
未分配利润	6.4.7.10	1,568,310,061.77
所有者权益合计		5,182,527,388.55
负债和所有者权益总计		5,937,717,376.72

注：1.本基金合同生效日为 2015 年 2 月 13 日，2015 年半年度实际报告期间为 2015 年 2 月 13 日至 2015 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2. 报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.434 元，基金份额总额 3,614,217,326.78 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		397,618,962.70
1.利息收入		5,059,016.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,635,211.44
债券利息收入		2,416,170.82
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,634.68
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		235,935,023.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	228,605,706.85
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,179,790.00
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	6,149,526.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	79,276,623.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	77,348,299.46
减：二、费用		44,352,059.11
1. 管理人报酬		27,233,302.47
2. 托管费		4,538,883.73
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	12,409,243.28
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	170,629.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		353,266,903.59
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		353,266,903.59

注：本基金合同生效日为 2015 年 2 月 13 日，2015 年半年度实际报告期间为 2015 年 2 月 13 日至 2015 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,672,421,070.50	-	1,672,421,070.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	353,266,903.59	353,266,903.59
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）	1,941,796,256.28	1,215,043,158.18	3,156,839,414.46
其中：1.基金申购款	9,623,108,126.47	5,771,794,201.20	15,394,902,327.67
2.基金赎回款	-7,681,311,870.19	-4,556,751,043.02	-12,238,062,913.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,614,217,326.78	1,568,310,061.77	5,182,527,388.55

注：本基金合同生效日为 2015 年 2 月 13 日，2015 年半年度实际报告期间为 2015 年 2 月 13 日至 2015 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均

无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]290 号《关于核准易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》和证券基金机构监管部部函[2014]1961 号《关于易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,672,421,070.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 203,190.17 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2015 年 1 月 22 日至 2015 年 2 月 11 日，募集金额总额为人民币 1,672,421,070.50 元，其中：有效净认购金额为人民币 1,672,217,880.33 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 203,190.17 元，经安永华明（2015）验字第 60468000_G07 号验资报告予以审验。

6.4.2 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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》和《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》等 7 项会计准则；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 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。

6.4.4.1 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，惟本会计年度期间为 2015 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，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 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即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；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	185,172,320.75
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	185,172,320.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,052,196,585.30	5,129,014,928.82	76,818,343.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,476,199.50	2,331,199.50
	银行间市场	241,315,000.00	127,080.00
	合计	248,791,199.50	2,458,279.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,298,529,505.30	5,377,806,128.32	79,276,623.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	49,084.94
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	6,208.38
应收债券利息	1,686,683.16
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	468.36
合计	1,742,444.84

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	7,217,556.74
银行间市场应付交易费用	3,428.53
合计	7,220,985.27

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	833,309.90
预提费用	152,143.62
其他应付款	400.00
合计	985,853.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,672,421,070.50	1,672,421,070.50
本期申购	9,623,108,126.47	9,623,108,126.47
本期赎回（以“-”号填列）	-7,681,311,870.19	-7,681,311,870.19

本期末	3,614,217,326.78	3,614,217,326.78
-----	------------------	------------------

注：1.本基金合同于 2015 年 2 月 13 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,672,421,070.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 203,190.17 份基金份额。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	273,990,280.57	79,276,623.02	353,266,903.59
本期基金份额交易产生的变动数	-43,159,349.40	1,258,202,507.58	1,215,043,158.18
其中：基金申购款	194,590,779.94	5,577,203,421.26	5,771,794,201.20
基金赎回款	-237,750,129.34	-4,319,000,913.68	-4,556,751,043.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	230,830,931.17	1,337,479,130.60	1,568,310,061.77

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,557,098.48
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	68,666.06
其他	9,446.90
合计	2,635,211.44

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,516,171,676.98
减：卖出股票成本总额	2,287,565,970.13
买卖股票差价收入	228,605,706.85

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	163,020,144.66
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	159,715,730.00

成本总额	
减：应收利息总额	2,124,624.66
买卖债券差价收入	1,179,790.00

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,149,526.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,149,526.43

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日
1.交易性金融资产	79,276,623.02
——股票投资	76,818,343.52
——债券投资	2,458,279.50
——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	79,276,623.02

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金赎回费收入	77,348,296.24
其他	3.22
合计	77,348,299.46

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日
交易所市场交易费用	12,406,193.28
银行间市场交易费用	3,050.00
合计	12,409,243.28

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日
审计费用	42,857.28
信息披露费	109,286.34
银行汇划费	18,086.01
其他	400.00
合计	170,629.63

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	5,426,690,535.87	55.06%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30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	4,752,319.96	54.10%	3,795,610.72	52.59%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	27,233,302.47
其中：支付销售机构的客户维护费	13,363,340.33

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,538,883.73

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2015年2月13日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	185,172,320.75	2,557,098.48

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000558	莱茵置业	2015-06-15	重大事项	32.80	2015-07-13	29.52	2,011,786	52,922,840.31	65,986,580.80	-
002002	鸿达兴业	2015-06-18	重大事项	39.30	-	-	3,201,240	67,891,409.17	125,808,732.00	-
300007	汉威电子	2015-06-29	重大事项	74.72	2015-08-24	67.25	3,660,860	290,349,780.22	273,539,459.20	-
300144	宋城演艺	2015-06-18	重大事项	76.47	2015-07-20	68.82	1,936,936	159,772,401.57	148,117,495.92	-
300377	赢时胜	2015-05-20	重大事项	187.77	2015-07-15	168.99	293,750	33,725,762.10	55,157,437.50	-
300418	昆仑万维	2015-05-05	重大事项	155.91	2015-08-06	140.09	287,253	42,516,500.76	44,785,615.23	-
600074	保千里	2015-06-26	重大事项	20.92	-	-	2,000,000	49,964,939.00	41,840,000.00	-

600645	中源协和	2015-04-27	重大事项	79.34	-	-	2,486,453	148,260,958.70	197,275,181.02	-
600763	通策医疗	2015-05-25	重大事项	110.36	-	-	702,061	43,881,206.03	77,479,451.96	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.14%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日
--------	-------------------

A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	243,001,254.64
合计	243,001,254.64

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2 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6月30日
AAA	7,476,628.02
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	7,476,628.02

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。本基金的投资范围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，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	185,172,320.75	-	-	-	185,172,320.75
结算备付金	15,329,272.42	-	-	-	15,329,272.42
存出保证金	1,156,437.20	-	-	-	1,156,437.20

交易性金融资产	241,315,000.00	-	7,476,199.50	5,129,014,928.82	5,377,806,128.32
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	356,510,773.19	356,510,773.19
应收利息	-	-	-	1,742,444.84	1,742,444.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	442,973,030.37	-	7,476,199.50	5,487,268,146.85	5,937,717,376.72
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	-	-	-	734,726,686.21	734,726,686.21
应付管理人报酬	-	-	-	10,505,539.88	10,505,539.88
应付托管费	-	-	-	1,750,923.29	1,750,923.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	7,220,985.27	7,220,985.27
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	985,853.52	985,853.52
负债总计	-	-	-	755,189,988.17	755,189,988.17
利率敏感度缺口	442,973,030.37	-	7,476,199.50	4,732,078,158.68	5,182,527,388.55

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 -
	1.市场利率下降 25 个基点	476,633.31	-
	2.市场利率上升 25 个基点	-474,741.11	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	5,129,014,928.82	98.97
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	5,129,014,928.82	98.97

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2015 年 6 月 30 日
	1.业绩比较基准上升 5%	355,911,941.80
2.业绩比较基准下降 5%	-355,911,941.80	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 4,106,501,174.69 元，属于第二层次的余额为 1,271,304,953.63 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 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,129,014,928.82	86.38
	其中：股票	5,129,014,928.82	86.38
2	固定收益投资	248,791,199.50	4.19
	其中：债券	248,791,199.50	4.19
	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	200,501,593.17	3.38
7	其他各项资产	359,409,655.23	6.05
8	合计	5,937,717,376.72	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,994,953,790.17	38.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,293,387,937.41	44.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	141,024,608.32	2.72
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	272,875,181.02	5.27
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	256,744,485.98	4.95
R	文化、体育和娱乐业	170,028,925.92	3.28

S	综合	-	-
	合计	5,129,014,928.82	98.97

注：本报告期末本基金投资股票资产占基金资产净值超过 95%，属于被动超标。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002030	达安基因	10,296,646	456,141,417.80	8.80
2	002153	石基信息	3,335,343	433,561,236.57	8.37
3	300059	东方财富	5,241,400	330,679,926.00	6.38
4	300007	汉威电子	3,660,860	273,539,459.20	5.28
5	300168	万达信息	5,547,430	272,489,761.60	5.26
6	300369	绿盟科技	4,628,425	236,049,675.00	4.55
7	300024	机器人	2,766,203	213,716,843.78	4.12
8	600645	中源协和	2,486,453	197,275,181.02	3.81
9	300244	迪安诊断	2,135,633	179,265,034.02	3.46
10	600571	信雅达	1,680,727	177,904,952.95	3.43
11	300222	科大智能	3,500,000	148,925,000.00	2.87
12	300144	宋城演艺	1,936,936	148,117,495.92	2.86
13	002055	得润电子	2,503,343	144,893,492.84	2.80
14	300166	东方国信	3,961,899	142,311,412.08	2.75
15	300049	福瑞股份	1,401,334	126,106,046.66	2.43
16	002002	鸿达兴业	3,201,240	125,808,732.00	2.43
17	300229	拓尔思	3,689,690	95,562,971.00	1.84
18	600446	金证股份	722,314	89,176,886.44	1.72
19	300003	乐普医疗	1,999,902	81,136,024.14	1.57
20	600763	通策医疗	702,061	77,479,451.96	1.50
21	002657	中科金财	834,210	76,764,004.20	1.48
22	300332	天壕节能	3,000,000	75,600,000.00	1.46
23	002285	世联行	3,499,908	75,038,027.52	1.45
24	600588	用友网络	1,568,274	71,952,411.12	1.39
25	000558	莱茵置业	2,011,786	65,986,580.80	1.27
26	300182	捷成股份	1,266,350	65,217,025.00	1.26
27	600271	航天信息	1,000,000	64,710,000.00	1.25
28	002642	荣之联	1,085,061	62,011,236.15	1.20
29	300377	赢时胜	293,750	55,157,437.50	1.06
30	300271	华宇软件	1,176,381	51,537,251.61	0.99
31	002230	科大讯飞	1,414,185	49,411,623.90	0.95
32	002550	千红制药	2,300,000	48,323,000.00	0.93

33	300418	昆仑万维	287,253	44,785,615.23	0.86
34	300086	康芝药业	1,600,000	43,200,000.00	0.83
35	600074	保千里	2,000,000	41,840,000.00	0.81
36	300124	汇川技术	800,000	38,400,000.00	0.74
37	600055	华润万东	705,296	35,582,183.20	0.69
38	300358	楚天科技	800,000	34,216,000.00	0.66
39	300077	国民技术	800,000	34,032,000.00	0.66
40	002111	威海广泰	999,990	32,339,676.60	0.62
41	600728	佳都科技	911,474	30,707,559.06	0.59
42	300016	北陆药业	695,245	29,693,913.95	0.57
43	300027	华谊兄弟	574,500	21,911,430.00	0.42
44	000768	中航飞机	300,000	13,074,000.00	0.25
45	002174	游族网络	100,000	9,276,000.00	0.18
46	000503	海虹控股	165,448	8,106,952.00	0.16

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002153	石基信息	498,725,840.80	9.62
2	002030	达安基因	453,610,942.74	8.75
3	300059	东方财富	394,327,222.48	7.61
4	300007	汉威电子	290,349,780.22	5.60
5	300168	万达信息	249,293,244.65	4.81
6	002658	雪迪龙	202,723,274.11	3.91
7	300049	福瑞股份	190,958,329.19	3.68
8	300244	迪安诊断	178,072,672.81	3.44
9	600645	中源协和	174,724,822.18	3.37
10	300369	绿盟科技	172,157,606.23	3.32
11	600037	歌华有线	164,604,888.46	3.18
12	002055	得润电子	163,609,835.71	3.16
13	300144	宋城演艺	159,772,401.57	3.08
14	300222	科大智能	155,359,405.96	3.00
15	300332	天壕节能	152,342,646.90	2.94
16	300024	机器人	151,723,643.98	2.93
17	300229	拓尔思	141,029,890.92	2.72
18	300166	东方国信	133,145,521.91	2.57
19	300033	同花顺	127,613,980.28	2.46
20	600728	佳都科技	123,754,752.99	2.39

21	300231	银信科技	116,631,542.10	2.25
22	300358	楚天科技	115,915,918.58	2.24
23	300359	全通教育	108,919,511.47	2.10
24	000503	海虹控股	108,157,737.20	2.09
25	002285	世联行	106,695,530.55	2.06

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300033	同花顺	235,522,283.13	4.54
2	300359	全通教育	199,903,725.93	3.86
3	600037	歌华有线	146,853,699.34	2.83
4	002658	雪迪龙	144,401,634.15	2.79
5	300380	安硕信息	124,790,002.25	2.41
6	300231	银信科技	113,514,103.79	2.19
7	600728	佳都科技	107,911,505.80	2.08
8	002400	省广股份	77,995,189.16	1.50
9	600271	航天信息	76,562,941.76	1.48
10	002174	游族网络	69,641,458.58	1.34
11	300248	新开普	63,638,808.05	1.23
12	000503	海虹控股	62,711,171.71	1.21
13	002466	天齐锂业	60,269,768.35	1.16
14	300013	新宁物流	59,268,616.30	1.14
15	300146	汤臣倍健	57,161,833.37	1.10
16	300378	鼎捷软件	50,994,375.38	0.98
17	601166	兴业银行	50,199,717.20	0.97
18	601318	中国平安	49,681,148.01	0.96
19	300124	汇川技术	47,724,271.15	0.92
20	002318	久立特材	46,671,656.37	0.90

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,339,762,555.43
卖出股票收入（成交）总额	2,516,171,676.98

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	241,315,000.00	4.66
	其中：政策性金融债	241,315,000.00	4.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	7,476,199.50	0.14
8	其他	-	-
9	合计	248,791,199.50	4.80

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	150211	15 国开 11	1,300,000	130,455,000.00	2.52
2	150206	15 国开 06	500,000	50,460,000.00	0.97
3	150307	15 进出 07	400,000	40,292,000.00	0.78
4	150202	15 国开 02	200,000	20,108,000.00	0.39
5	110031	航信转债	51,450	7,476,199.50	0.14

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,156,437.20
2	应收证券清算款	356,510,773.19
3	应收股利	-
4	应收利息	1,742,444.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	359,409,655.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的	占基金资产净	流通受限情
----	------	------	---------	--------	-------

			公允价值	值比例 (%)	况说明
1	300007	汉威电子	273,539,459.20	5.28	重大事项停牌
2	600645	中源协和	197,275,181.02	3.81	重大事项停牌

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
124,035	29,138.69	149,952,177.12	4.15%	3,464,265,149.66	95.85%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	307,649.59	0.0085%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 2 月 13 日）基金份额总额	1,672,421,070.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,623,108,126.47
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7,681,311,870.19
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,614,217,326.78

注：本基金合同生效日为 2015 年 02 月 13 日。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处

罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	2,822,651,873.20	28.64%	2,569,743.48	29.25%	-
中信建投	2	895,734,584.09	9.09%	815,474.50	9.28%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	358,883,542.78	3.64%	326,729.22	3.72%	-
兴业证券	2	49,964,939.00	0.51%	45,488.69	0.52%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	302,008,757.47	3.06%	274,949.13	3.13%	-
广发证券	3	5,426,690,535.87	55.06%	4,752,319.96	54.10%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增招商证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司各一个交易单元，新增安信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司各两个交易单元，新增广发证券股份有限公司三个交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面

的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-14
2	易方达基金管理有限公司关于增加易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金及易方达新经济灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-04
3	易方达基金管理有限公司关于易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和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	2015-03-06
4	易方达基金管理有限公司关于增加交通银行为易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金及易方达新经济灵活配置混合型证券投资基金销售机构、在交通银行推出定期定额投资业务及参加交通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	2015-03-10
5	易方达创新驱动灵活配置混合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
6	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
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
8	易方达基金管理有限公司关于增加中国工商银行作为易方达创新驱动灵活配置混合型证券	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-31

	投资基金销售机构并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	人网站	
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	2015-04-01
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东莞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	2015-04-09
11	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
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上海证券为销售机构、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	2015-04-15
13	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	2015-04-23
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
15	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
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
17	易方达基金管理有限公司关于增加无锡农村商业银行作为易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-05-06
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华夏银行为销售机构、参加华夏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	2015-05-12
19	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
20	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	2015-06-08
21	易方达基金管理有限公司关于增加郑州银行为易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金销售机构、参加郑州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	2015-06-08
22	易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基	中国证券报、上海证券	2015-06-09

	金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
23	易方达基金管理有限公司关于增加华泰证券为易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金销售机构、参加华泰证券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	2015-06-11
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
26	易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金恢复申购、转换转入及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	2015-06-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一五年八月二十六日