

易方达价值成长混合型证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十四日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 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 2016 年 1 月 1 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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
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.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12	投资组合报告附注	39
8	基金份额持有人信息	40
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
9	开放式基金份额变动	41
10	重大事件揭示	41
10.1	基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4	基金投资策略的改变	41
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	41
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	42
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8	其他重大事件	44
11	备查文件目录	47
11.1	备查文件目录	47
11.2	存放地点	48
11.3	查阅方式	48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达价值成长混合型证券投资基金
基金简称	易方达价值成长混合
基金主代码	110010
交易代码	110010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 4 月 2 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,889,346,523.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主动的资产配置以及对成长价值风格突出的股票进行投资，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金根据宏观及微观经济因素、市场因素和政策因素，进行大类资产的战略性配置。在股票投资方面，本基金遵循三个投资步骤。一是进行股票的风格特征的数量化评估，应用“易方达成长与价值股评价模型”，使用历史与预测的数据，从公司的备选库股票中选择成长与价值特性突出的股票。二是进行股票素质的基本面筛选，使用优质成长股与优质价值股的评价标准，在前面用数量化方法选出的风格鲜明的股票中，应用基本面分析方法，选出基本面较好的股票。三是进行成长与价值的风格配置，根据对市场的判断，动态地调整成长股与价值股的投资比重，追求在可控风险前提下的稳健回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	洪渊
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400 881 8088	95588
传真	020-85104666	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510620	100140
法定代表人	刘晓艳	易会满

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 40-43 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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-866,143,820.66
本期利润	-1,832,092,226.03
加权平均基金份额本期利润	-0.4705
本期加权平均净值利润率	-30.35%
本期基金份额净值增长率	-22.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	2,230,708,178.97
期末可供分配基金份额利润	0.5735
期末基金资产净值	6,120,054,702.09
期末基金份额净值	1.5735
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)

基金份额累计净值增长率	79.56%
-------------	--------

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
过去一个月	3.46%	1.31%	-0.25%	0.69%	3.71%	0.62%
过去三个月	0.10%	1.42%	-1.20%	0.71%	1.30%	0.71%
过去六个月	-22.53%	2.49%	-10.22%	1.29%	-12.31%	1.20%
过去一年	-25.71%	2.75%	-19.03%	1.61%	-6.68%	1.14%
过去三年	48.03%	2.03%	34.57%	1.29%	13.46%	0.74%
自基金合同生效起至今	79.56%	1.82%	21.70%	1.36%	57.86%	0.46%

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

易方达价值成长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

(2007年4月2日至2016年6月30日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 79.56%，同期业绩比较基准收益率为 21.70%。

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 2016 年 6 月 30 日，易方达旗下共管理 92 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，管理公募基金总规模 4056.91 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		

王义克	本基金的基金经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、公募基金投资部总经理助理	2014-12-06	-	9 年	硕士研究生，曾任美国雷曼兄弟亚洲投资有限公司分析师，野村国际(香港)有限公司分析师，易方达基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理助理。
萧楠	本基金的基金经理助理、易方达消费行业股票型证券投资基金的基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2015-02-14	-	10 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、基金投资部基金经理助理。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关助理协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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 16 次，其中 13 次为指数及量化投资因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；3 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

2016 年上半年，A 股下跌幅度较大。尤其是一月份 A 股出现了非常明显的下跌，二月之后市场呈现震荡态势。具体来看，2016 年上半年 A 股重要指数均出现较大幅度的下跌，其中上证综指、深证成指、中小板指和创业板指数分别下跌 17.22%，17.17%，17.88% 和 17.92%。

2016 年上半年宏观经济呈现底部复苏的态势，尤其是二季度的工业生产、投资、消费均出现周期性复苏，但复苏力度有所减弱。总量上看，一、二季度 GDP 增速均维持在 6.7% 的水平；工业增加值季调后环比折年率由一季度的 2% 回升到 8%。结构上看，一方面，上半年地产销售维持了较高的景气程度，商品房销售面积同比增速从 2015 年三、四季度 6% 左右的增速大幅回升到 30%，由此带动地产新开工增速从大幅负增长扭转为大幅正增长，对地产投资形成较强的带动效应。另一方面，一季度信贷和货币的大幅投放对总需求形成了较强的支持，信贷和货币大幅增长的背后是财政支出和基建投资力度的加大。在经济恢复的同时，2016 年上半年的物价水平也回升到接近 2%；与此同时，工业品价格改善较为明显，包括黑色金属，有色金属和部分化工品在内的工业品价格出现了较明显的上涨，上半年整体 PPI 增速由去年同期近 5% 的负增速回到 2.5% 的负增长水平，环比改善较为明显。在需求整体企稳且略有回升的背景下，一些供给侧调整相对到位的行业出现了明显的涨价趋势，如养殖、白酒、部分化工品的产品价格均有较大上涨，行业景气程度较高。

从今年年初开始，市场风险偏好快速下降，成长股出现了快速回调。由于本组合的风格整体偏成长，因此在年初的市场调整中组合的净值出现了较大的回撤。春节过后，人民币贬值预期减弱、美元加息推迟，市场逐渐企稳，我们逐渐对组合配置进行了结构调整。在方向上，我们逐步减持了部分估值较高、需要较长时间才能兑现盈利的板块和个股；另一方面，我们增持了估值较低、盈利逐渐改善的行业和公司，包括家电、农业及食品饮料等。第二季度尤其是 5、6 月份，市场风险偏好逐渐上升，我们也适度参与了部分主题机会，包括半导体行业、无人驾驶等。与此同时，我们在组

合中依旧保留了部分行业景气周期相对确定、团队执行力强的成长股。我们相信这些上述公司具备进一步成长的空间，从相对中长期的时间维度，我们依旧能分享上述公司的成长。至报告期末，本基金在汽车、化工和医药生物等行业配置较多，个股集中度适度提高。本基金维持前期的利率债持仓，以获取持有期收入为主。

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 1.5735 元，本报告期份额净值增长率为-22.53%，同期业绩比较基准收益率为-10.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年宏观经济整体将呈现稳中回落的态势。一方面，货币政策进一步宽松的概率较低，考虑到目前经济运行整体处于合理区间之内，上半年 6.7% 的 GDP 增速为全年经济总量目标的达成奠定了较好的基础。所以，在此背景下，货币政策进一步宽松以刺激经济复苏的概率并不高。另一方面，地产投资增速可能有所回落，从而制约整体投资需求。今年上半年地产销售的高景气伴随着商品价格的快速上涨，透支了一部分未来的购房需求，因此，我们预计下半年地产销售出现降温的概率较高，同时考虑到地产库存仍然处于相对较高的水平，我们预计地产投资回落的概率较高。与此同时，由于制造业投资持续低迷，虽然基建投资仍然扮演稳增长的角色，但仍然难以扭转整体固定资产投资增速回落的趋势。在总需求稳中回落的态势中，预计物价水平的压力不大。从改革的角度来看，预计下半年在国企改革、金融制度改革方面都将继续推进，在政策导向进一步明朗之后，预计对相关企业将产生积极的影响，逐步释放改革红利。

基于上述对宏观经济的分析，结合目前市场的估值水平和流动性状况，我们认为市场仍将维持区间震荡的格局。随着市场的风险偏好趋于稳定，我们预期市场的结构性机会将层出不穷，个股将反复活跃。下半年，我们将进一步优化组合结构。一方面，我们将进一步加大稳定成长类公司的配置比例，从而获取稳定持续的投资收益以及进一步降低组合的波动率。另一方面，我们仍将积极筛选高速成长类公司作为组合的补充，适当提高组合的业绩弹性。由于市场热点转换较快，我们坚持以行业景气度向上、业绩持续成长的优质企业作为我们筛选个股的核心标准。在中国经济转型过程中，我们发现有为数不少的上市公司在激烈的市场竞争中逐渐脱颖而出，这些企业将逐渐成长为中国资本市场的新蓝筹。挖掘并投资上述企业，不仅是获取投资收益的来源，也是积极引导社会资本更加有效配置的社会责任。

由于年初市场的快速回调，组合回撤较大，我们未能积极有效地回避市场的系统性风险，值得我们深刻反思。下半年，我们将更加勤勉，扎扎实实做好研究工作，挖掘并投资上述具有中长期价

值的企业，尽心尽力做好组合管理，为投资者挽回损失，并创造投资收益。债券投资策略为继续持有短久期品种，并将结合下半年宏观经济形势，灵活调整持仓结构，提高组合的流动性。

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

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 450,606,802.68 元。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对易方达价值成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，易方达价值成长混合型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达价值成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按

照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达价值成长混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 450,606,802.68 元。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达价值成长混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	377,348,751.49	294,507,107.19
结算备付金		10,189,633.34	25,417,373.79
存出保证金		2,165,396.90	3,201,534.69
交易性金融资产	6.4.7.2	5,323,929,524.04	7,434,132,032.14
其中：股票投资		5,242,760,162.04	7,088,691,532.14
基金投资		-	-
债券投资		81,169,362.00	345,440,500.00
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	369,800,605.70	550,000,945.00
应收证券清算款		102,790,202.72	2,783,140.36
应收利息	6.4.7.5	2,340,747.19	6,011,146.85
应收股利		-	-
应收申购款		650,276.62	2,302,812.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,189,215,138.00	8,318,356,092.33
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 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		40,980,466.34	85,104,929.29
应付赎回款		12,132,405.28	14,242,970.39
应付管理人报酬		7,403,143.35	10,294,761.62
应付托管费		1,233,857.24	1,715,793.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,970,351.36	14,137,680.14
应交税费		690,125.60	690,125.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,750,086.74	1,952,939.59
负债合计		69,160,435.91	128,139,200.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,889,346,523.12	3,754,706,180.18
未分配利润	6.4.7.10	2,230,708,178.97	4,435,510,711.93
所有者权益合计		6,120,054,702.09	8,190,216,892.11
负债和所有者权益总计		6,189,215,138.00	8,318,356,092.33

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5735 元，基金份额总额 3,889,346,523.12 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-1,761,928,828.10	7,595,145,495.52
1.利息收入	6.4.7.11	7,662,076.85	14,411,820.92
其中：存款利息收入		2,960,270.96	1,937,575.06
债券利息收入		3,787,486.64	12,253,656.07
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		914,319.25	220,589.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-804,119,670.90	7,236,857,678.92

其中：股票投资收益	6.4.7.12	-822,500,856.20	7,200,808,003.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-28,804.00	3,392,415.25
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	18,409,989.30	32,657,259.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-965,948,405.37	342,133,427.45
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	477,171.32	1,742,568.23
减：二、费用		70,163,397.93	191,753,165.48
1. 管理人报酬		45,140,905.09	93,686,808.31
2. 托管费		7,523,484.20	15,614,468.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	17,255,384.91	80,952,180.87
5. 利息支出		-	1,214,158.20
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,214,158.20
6. 其他费用	6.4.7.19	243,623.73	285,550.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,832,092,226.03	7,403,392,330.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,832,092,226.03	7,403,392,330.04

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	3,754,706,180.18	4,435,510,711.93	8,190,216,892.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,832,092,226.03	-1,832,092,226.03
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）	134,640,342.94	77,896,495.75	212,536,838.69
其中：1.基金申购款	467,473,560.87	267,879,734.49	735,353,295.36
2.基金赎回款	-332,833,217.93	-189,983,238.74	-522,816,456.67

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）	-	-450,606,802.68	-450,606,802.68
五、期末所有者权益（基金净值）	3,889,346,523.12	2,230,708,178.97	6,120,054,702.09
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 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）	8,631,309,662.25	2,598,800,293.32	11,230,109,955.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,403,392,330.04	7,403,392,330.04
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）	-4,442,216,887.61	-4,661,450,806.55	-9,103,667,694.16
其中：1.基金申购款	846,870,797.80	1,099,119,634.12	1,945,990,431.92
2.基金赎回款	-5,289,087,685.41	-5,760,570,440.67	-11,049,658,126.08
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）	4,189,092,774.64	5,340,741,816.81	9,529,834,591.45

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

易方达价值成长混合型证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2007] 69 号文件“关于同意易方达价值成长混合型证券投资基金募集的批复”批准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》向社会公开募集。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2007 年 4 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,874,939,465.41 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳

税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	377,348,751.49
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	377,348,751.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,332,274,296.54	5,242,760,162.04	-89,514,134.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,054,953.75	1,169,362.00
	银行间市场	80,002,240.00	80,000,000.00
	合计	81,057,193.75	81,169,362.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,413,331,490.29	5,323,929,524.04	-89,401,966.25

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

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	369,800,605.70	-
合计	369,800,605.70	-

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	125,364.43
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	4,126.86
应收债券利息	2,151,437.90
应收买入返售证券利息	58,941.04
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	876.96
合计	2,340,747.19

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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,964,361.04
银行间市场应付交易费用	5,990.32
合计	4,970,351.36

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00
应付赎回费	36,262.22
预提费用	213,824.52
合计	1,750,086.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,754,706,180.18	3,754,706,180.18
本期申购	467,473,560.87	467,473,560.87
本期赎回（以“-”号填列）	-332,833,217.93	-332,833,217.93
本期末	3,889,346,523.12	3,889,346,523.12

注：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
上年度末	5,637,368,920.91	-1,201,858,208.98	4,435,510,711.93
本期利润	-866,143,820.66	-965,948,405.37	-1,832,092,226.03
本期基金份额交易产生的变动数	188,041,471.53	-110,144,975.78	77,896,495.75
其中：基金申购款	624,255,377.12	-356,375,642.63	267,879,734.49
基金赎回款	-436,213,905.59	246,230,666.85	-189,983,238.74
本期已分配利润	-450,606,802.68	-	-450,606,802.68
本期末	4,508,659,769.10	-2,277,951,590.13	2,230,708,178.97

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	105,563.41
其他	20,940.53
合计	2,960,270.96

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	6,653,508,651.51
买卖股票差价收入	-822,500,856.20

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

	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	272,475,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	265,028,804.00
减：应收利息总额	7,475,000.00
买卖债券差价收入	-28,804.00

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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,409,989.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,409,989.30

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-965,948,405.37
——股票投资	-965,651,117.62
——债券投资	-297,287.75
——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	-965,948,405.37

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	477,171.32
其他	-
合计	477,171.32

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	17,255,384.91
银行间市场交易费用	-
合计	17,255,384.91

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	64,644.58
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	10,999.21
银行间账户维护费	18,000.00
其他	800.00
合计	243,623.73

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
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
广发证券	102,414,262.55	0.88%	4,604,976,528.12	8.94%

6.4.10.1.2 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。

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 2016年1月1日至2016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	81,931.43	0.79%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1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	3,683,982.75	8.17%	2,806,660.47	10.91%

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	45,140,905.09	93,686,808.31
其中：支付销售机构的客户维护费	7,041,937.22	14,988,728.53

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,523,484.20	15,614,468.07

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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	377,348,751.49	2,833,767.02	394,747,688.50	1,581,814.51

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未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

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	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2016-01-20	-	2016-01-20	1.200	181,170,368.56	269,436,434.12	450,606,802.68	-

合计			1.200	181,170,368.	269,436,434.	450,606,802.	
				56	12	68	-

6.4.12 期末（2016 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002312	三泰控股	2015-11-16	2016-11-17	非公开发行流通受限	20.18	18.95	3,980,000	80,316,400.00	75,421,000.00	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

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
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项停牌	22.07	-	-	1,959,031	42,937,605.38	43,235,814.17	-
000710	天兴仪表	2016-06-15	重大事项停牌	22.12	-	-	1,098,896	26,954,195.01	24,307,579.52	-
000728	国元证券	2016-06-08	重大事项停牌	16.72	2016-07-08	17.37	250,000	3,961,780.00	4,180,000.00	-
000800	北京文	2016-06	重大事	23.52	2016-0	21.86	6,799,988	198,916,086.2	159,935,717.	-

2	化	-01	项停牌		8-22				1	76	
002101	广东鸿图	2016-05-03	重大事项停牌	21.62	-	-	2,665,211	69,780,028.62	57,621,861.82	-	
002120	新海股份	2016-05-23	重大事项停牌	20.48	2016-07-15	22.53	771,350	18,427,366.62	15,797,248.00	-	
002278	神开股份	2016-04-01	重大事项停牌	13.25	2016-07-05	12.71	1,831,659	35,575,273.32	24,269,481.75	-	
002555	三七互娱	2016-03-10	重大事项停牌	18.10	2016-08-16	19.91	1,337,564	24,841,539.37	24,209,908.40	-	
002567	唐人神	2016-05-16	重大事项停牌	13.98	2016-07-29	13.23	2,144,576	27,358,632.63	29,981,172.48	-	
002587	奥拓电子	2016-04-19	重大事项停牌	14.45	2016-07-28	14.00	2,583,827	31,279,140.28	37,336,300.15	-	
002631	德尔未来	2016-06-29	重大事项停牌	26.60	-	-	1,628,097	37,127,578.23	43,307,380.20	-	
002735	王子新材	2016-04-05	重大事项停牌	41.19	-	-	818,235	29,545,190.07	33,703,099.65	-	
300284	苏交科	2016-05-20	重大事项停牌	19.49	2016-08-10	21.44	1,519,794	29,665,614.68	29,620,785.06	-	
300345	红宇新材	2016-06-21	重大事项停牌	10.46	2016-07-19	11.46	300,000	3,401,653.88	3,138,000.00	-	
600318	新力金融	2016-03-24	重大事项停牌	26.84	-	-	1,143,453	40,534,766.29	30,690,278.52	-	
600654	中安消	2016-05-19	重大事项停牌	18.54	2016-08-08	20.39	1,675,267	61,861,787.15	31,059,450.18	-	
600768	宁波富邦	2016-03-31	重大事项停牌	24.42	-	-	1,330,600	27,150,963.53	32,493,252.00	-	

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 2016 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 2016 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，属于证券投资基金中的中等风险品种，日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2016 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 0.02%(2015 年 12 月 31 日：0.00%)。

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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	82,149,726.78	351,279,405.01
合计	82,149,726.78	351,279,405.01

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。

6.4.13.2.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	1,171,073.12	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	1,171,073.12	0.00

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，其余亦可在银行间同业市场交易，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 2016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	377,348,751.49	-	-	-	377,348,751.49
结算备付金	10,189,633.34	-	-	-	10,189,633.34
存出保证金	2,165,396.90	-	-	-	2,165,396.90
交易性金融资产	80,000,000.00	1,169,362.00	-	5,242,760,162.04	5,323,929,524.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	369,800,605.70	-	-	-	369,800,605.70
应收证券清算款	-	-	-	102,790,202.72	102,790,202.72
应收利息	-	-	-	2,340,747.19	2,340,747.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	650,276.62	650,276.62
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	839,504,387.43	1,169,362.00	-	5,348,541,388.57	6,189,215,138.00
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	-	-	-	40,980,466.34	40,980,466.34
应付赎回款	-	-	-	12,132,405.28	12,132,405.28
应付管理人报酬	-	-	-	7,403,143.35	7,403,143.35
应付托管费	-	-	-	1,233,857.24	1,233,857.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,970,351.36	4,970,351.36
应交税费	-	-	-	690,125.60	690,125.60
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,750,086.74	1,750,086.74
负债总计	-	-	-	69,160,435.91	69,160,435.91
利率敏感度缺口	839,504,387.43	1,169,362.00	-	5,279,380,952.66	6,120,054,702.09
上年度末 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	294,507,107.19	-	-	-	294,507,107.19
结算备付金	25,417,373.79	-	-	-	25,417,373.79
存出保证金	3,201,534.69	-	-	-	3,201,534.69
交易性金融资产	345,440,500.00	-	-	7,088,691,532.14	7,434,132,032.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	550,000,945.00	-	-	-	550,000,945.00
应收证券清算款	-	-	-	2,783,140.36	2,783,140.36

应收利息	-	-	-	6,011,146.85	6,011,146.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,302,812.31	2,302,812.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,218,567,460.67	-	-	7,099,788,631.66	8,318,356,092.33
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	85,104,929.29	85,104,929.29
应付赎回款	-	-	-	14,242,970.39	14,242,970.39
应付管理人报酬	-	-	-	10,294,761.62	10,294,761.62
应付托管费	-	-	-	1,715,793.59	1,715,793.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	14,137,680.14	14,137,680.14
应交税费	-	-	-	690,125.60	690,125.60
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,952,939.59	1,952,939.59
负债总计	-	-	-	128,139,200.22	128,139,200.22
利率敏感度缺口	1,218,567,460.67	-	-	6,971,649,431.44	8,190,216,892.11

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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	9,279.54	359,949.83
	2.市场利率上升25个基点	-9,277.39	-359,154.75

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 2016年6月30日		上年度末 2015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	5,242,760,162.04	85.67	7,088,691,532.14	86.55
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	5,242,760,162.04	85.67	7,088,691,532.14	86.55

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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	399,422,616.04	411,662,193.52
	2.业绩比较基准下降 5%	-399,422,616.04	-411,662,193.52

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 2016 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 4,542,451,832.38 元，属于第二层次的余额为 781,477,691.66 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 5,857,601,112.65 元，第二层次 1,576,530,919.49 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。

(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 2016 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(2015 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。

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	5,242,760,162.04	84.71
	其中：股票	5,242,760,162.04	84.71
2	固定收益投资	81,169,362.00	1.31
	其中：债券	81,169,362.00	1.31
	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	369,800,605.70	5.97
	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	387,538,384.83	6.26
7	其他各项资产	107,946,623.43	1.74
8	合计	6,189,215,138.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	65,554,243.82	1.07
B	采矿业	63,950,880.69	1.04
C	制造业	3,207,968,010.15	52.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	164,552,618.61	2.69
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	118,004,441.00	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	36,937,046.00	0.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	277,113,164.88	4.53
J	金融业	21,278,000.00	0.35
K	房地产业	135,754,899.02	2.22
L	租赁和商务服务业	107,212,014.00	1.75
M	科学研究和技术服务业	29,640,911.16	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	31,567,363.05	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	45,490,000.00	0.74
Q	卫生和社会工作	366,744,499.30	5.99
R	文化、体育和娱乐业	570,992,070.36	9.33
S	综合	-	-

	合计	5,242,760,162.04	85.67
--	----	------------------	-------

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	300100	双林股份	7,000,190	306,678,323.90	5.01
2	002699	美盛文化	6,500,340	217,046,352.60	3.55
3	300015	爱尔眼科	5,908,318	215,830,856.54	3.53
4	300010	立思辰	10,000,000	209,800,000.00	3.43
5	000911	南宁糖业	7,000,220	175,565,517.60	2.87
6	600160	巨化股份	16,160,633	171,787,528.79	2.81
7	000333	美的集团	6,952,606	164,915,814.32	2.69
8	000802	北京文化	6,799,988	159,935,717.76	2.61
9	002409	雅克科技	7,011,338	156,072,383.88	2.55
10	601567	三星医疗	9,649,266	142,326,673.50	2.33
11	300133	华策影视	8,000,000	124,560,000.00	2.04
12	600699	均胜电子	3,166,710	121,284,993.00	1.98
13	600180	瑞茂通	7,681,950	116,074,264.50	1.90
14	600114	东睦股份	6,550,845	110,119,704.45	1.80
15	002707	众信旅游	5,281,380	107,212,014.00	1.75
16	600236	桂冠电力	15,798,176	106,163,742.72	1.73
17	002690	美亚光电	4,500,000	103,680,000.00	1.69
18	600763	通策医疗	3,000,000	93,540,000.00	1.53
19	603338	浙江鼎力	1,954,555	90,104,985.50	1.47
20	600158	中体产业	4,999,822	88,746,840.50	1.45
21	000596	古井贡酒	1,766,861	84,720,984.95	1.38
22	000568	泸州老窖	2,792,998	82,952,040.60	1.36
23	600731	湖南海利	7,691,980	77,304,399.00	1.26
24	002312	三泰控股	3,980,000	75,421,000.00	1.23
25	300322	硕贝德	3,320,300	71,386,450.00	1.17
26	300136	信维通信	3,350,168	70,219,521.28	1.15
27	600136	当代明诚	3,000,000	69,450,000.00	1.13
28	002450	康得新	4,000,000	68,400,000.00	1.12
29	002196	方正电机	2,000,000	68,380,000.00	1.12
30	002056	横店东磁	3,991,582	67,856,894.00	1.11
31	000998	隆平高科	3,453,859	65,554,243.82	1.07
32	600547	山东黄金	1,643,559	63,950,880.69	1.04
33	600006	东风汽车	6,896,251	61,169,746.37	1.00
34	000661	长春高新	570,203	60,829,256.04	0.99

35	300236	上海新阳	1,185,607	59,979,858.13	0.98
36	002590	万安科技	1,926,150	59,961,049.50	0.98
37	002039	黔源电力	3,036,343	58,388,875.89	0.95
38	002101	广东鸿图	2,665,211	57,621,861.82	0.94
39	300347	泰格医药	1,977,038	57,373,642.76	0.94
40	000858	五粮液	1,448,606	47,123,153.18	0.77
41	603377	东方时尚	1,000,000	45,490,000.00	0.74
42	002631	德尔未来	1,628,097	43,307,380.20	0.71
43	000651	格力电器	1,959,031	43,235,814.17	0.71
44	603901	永创智能	2,387,042	42,919,015.16	0.70
45	603678	火炬电子	560,864	42,749,054.08	0.70
46	600328	兰太实业	3,222,692	38,736,757.84	0.63
47	600240	华业资本	3,826,236	38,338,884.72	0.63
48	002587	奥拓电子	2,583,827	37,336,300.15	0.61
49	002735	王子新材	818,235	33,703,099.65	0.55
50	600768	宁波富邦	1,330,600	32,493,252.00	0.53
51	000978	桂林旅游	3,003,555	31,567,363.05	0.52
52	600654	中安消	1,675,267	31,059,450.18	0.51
53	600029	南方航空	4,389,100	30,987,046.00	0.51
54	600887	伊利股份	1,842,100	30,707,807.00	0.50
55	600318	新力金融	1,143,453	30,690,278.52	0.50
56	002567	唐人神	2,144,576	29,981,172.48	0.49
57	300284	苏交科	1,519,794	29,620,785.06	0.48
58	300121	阳谷华泰	2,001,430	27,399,576.70	0.45
59	300316	晶盛机电	2,000,000	26,200,000.00	0.43
60	000710	天兴仪表	1,098,896	24,307,579.52	0.40
61	002278	神开股份	1,831,659	24,269,481.75	0.40
62	002555	三七互娱	1,337,564	24,209,908.40	0.40
63	300238	冠昊生物	499,979	21,939,078.52	0.36
64	600702	沱牌舍得	787,800	19,884,072.00	0.32
65	002120	新海股份	771,350	15,797,248.00	0.26
66	002572	索菲亚	220,000	12,324,400.00	0.20
67	600519	贵州茅台	39,920	11,653,446.40	0.19
68	603766	隆鑫通用	499,996	10,109,919.12	0.17
69	000418	小天鹅 A	236,580	7,717,239.60	0.13
70	600418	江淮汽车	600,570	7,615,227.60	0.12
71	300033	同花顺	90,000	7,330,500.00	0.12
72	000089	深圳机场	700,000	5,950,000.00	0.10
73	600521	华海药业	208,000	5,058,560.00	0.08
74	601688	华泰证券	250,000	4,730,000.00	0.08
75	300017	网宿科技	70,000	4,704,000.00	0.08
76	000783	长江证券	400,000	4,640,000.00	0.08
77	603866	桃李面包	99,982	4,475,194.32	0.07
78	300068	南都电源	200,000	4,372,000.00	0.07

79	000728	国元证券	250,000	4,180,000.00	0.07
80	300425	环能科技	128,400	4,065,144.00	0.07
81	600557	康缘药业	240,000	3,919,200.00	0.06
82	000686	东北证券	300,000	3,873,000.00	0.06
83	600837	海通证券	250,000	3,855,000.00	0.06
84	000860	顺鑫农业	150,000	3,567,000.00	0.06
85	000567	海德股份	100,000	3,165,000.00	0.05
86	300345	红宇新材	300,000	3,138,000.00	0.05
87	300160	秀强股份	228,000	2,934,360.00	0.05
88	000402	金融街	299,915	2,915,173.80	0.05
89	600048	保利地产	300,000	2,589,000.00	0.04
90	600392	盛和资源	150,000	2,457,000.00	0.04
91	002539	新都化工	150,000	2,293,500.00	0.04
92	000785	武汉中商	173,110	1,930,176.50	0.03
93	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
94	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
95	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
96	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
97	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
98	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
99	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
100	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
101	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
102	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
103	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

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	300100	双林股份	283,546,739.01	3.46
2	000333	美的集团	156,544,650.77	1.91
3	000911	南宁糖业	150,747,325.82	1.84
4	002699	美盛文化	149,545,355.81	1.83
5	600136	当代明诚	123,625,129.06	1.51
6	002196	方正电机	122,002,375.93	1.49
7	600114	东睦股份	118,555,738.32	1.45
8	600236	桂冠电力	114,886,800.26	1.40
9	002409	雅克科技	113,653,857.53	1.39

10	300236	上海新阳	106,866,437.62	1.30
11	600158	中体产业	100,955,251.28	1.23
12	002450	康得新	88,424,165.40	1.08
13	603338	浙江鼎力	84,791,278.82	1.04
14	000998	隆平高科	84,714,426.31	1.03
15	000858	五 粮 液	83,557,855.91	1.02
16	600731	湖南海利	81,361,264.12	0.99
17	000568	泸州老窖	80,369,293.38	0.98
18	300015	爱尔眼科	76,602,622.74	0.94
19	600547	山东黄金	73,180,456.94	0.89
20	000596	古井贡酒	71,855,469.86	0.88

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	600271	航天信息	202,823,535.80	2.48
2	002690	美亚光电	194,947,614.31	2.38
3	600570	恒生电子	162,428,858.84	1.98
4	600763	通策医疗	157,124,424.91	1.92
5	300133	华策影视	152,970,844.20	1.87
6	600715	文投控股	120,660,785.55	1.47
7	002450	康得新	106,004,337.17	1.29
8	300113	顺网科技	96,976,088.28	1.18
9	000858	五 粮 液	91,832,253.78	1.12
10	600053	九鼎投资	85,032,419.09	1.04
11	002493	荣盛石化	84,452,844.58	1.03
12	600562	国睿科技	80,857,597.87	0.99
13	300078	思创医惠	79,247,415.71	0.97
14	300236	上海新阳	78,544,897.53	0.96
15	002036	联创电子	74,886,109.21	0.91
16	603108	润达医疗	71,228,209.59	0.87
17	300333	兆日科技	70,878,272.10	0.87
18	002384	东山精密	70,427,650.48	0.86
19	002370	亚太药业	67,333,781.64	0.82
20	300465	高伟达	64,953,843.69	0.79

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	5,773,228,399.03
卖出股票收入（成交）总额	5,831,007,795.31

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	80,000,000.00	1.31
	其中：政策性金融债	80,000,000.00	1.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,169,362.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,169,362.00	1.33

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	150416	15 农发 16	800,000	80,000,000.00	1.31
2	120001	16 以岭 EB	10,550	1,169,362.00	0.02

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	2,165,396.90
2	应收证券清算款	102,790,202.72
3	应收股利	-
4	应收利息	2,340,747.19
5	应收申购款	650,276.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,946,623.43

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 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情 况说明
1	000802	北京文化	159,935,717.76	2.61	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
246,403	15,784.49	65,974,467.62	1.70%	3,823,372,055.50	98.30%

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	59,104.86	0.0015%

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	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年4月2日）基金份额总额	10,874,939,465.41
本报告期期初基金份额总额	3,754,706,180.18
本报告期基金总申购份额	467,473,560.87
减：本报告期基金总赎回份额	332,833,217.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,889,346,523.12

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

本基金管理人于 2016 年 4 月 30 日发布公告，自 2016 年 4 月 30 日起聘任詹余引先生担任公司董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚先生不再担任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	
中金公司	2	999,237,755.42	8.62%	930,592.52	8.95%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	443,589,836.60	3.83%	413,115.38	3.97%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	2,975,965,015.28	25.66%	2,771,521.29	26.66%	-
瑞银证券	1	341,918,043.02	2.95%	318,428.27	3.06%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	530,337,846.70	4.57%	493,903.05	4.75%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	482,298,204.85	4.16%	449,164.54	4.32%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	114,785,012.11	0.99%	106,899.36	1.03%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	1,531,906,752.26	13.21%	1,268,188.81	12.20%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	1,778,483,765.18	15.34%	1,656,302.57	15.93%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	438,517,702.23	3.78%	408,392.74	3.93%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	1,539,947,428.96	13.28%	1,243,513.24	11.96%	-
华创证券	2	317,117,546.64	2.73%	253,693.79	2.44%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	102,414,262.55	0.88%	81,931.43	0.79%	-

注：a) 本报告期内本基金减少安信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司各一个交易单元，新增华创证券有限责任公司一个交易单元。

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。

10.7.2 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
新时代证券	-	-	700,000,000.00	100.00%	-	-

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	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-04
2	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	2016-01-05
3	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	2016-01-06
4	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-07
5	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	2016-01-08
6	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	2016-01-14
7	易方达价值成长混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-18
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加包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	2016-01-20
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加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	2016-01-20
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	2016-01-26
11	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	2016-01-27
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中经北证为销售机构、参加中经北证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	2016-01-28
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中证金牛为销售机构、参加中证金牛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	2016-01-28
14	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	2016-01-28

		人网站	
15	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	2016-01-29
16	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	2016-02-23
17	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	2016-02-26
18	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	2016-02-29
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	2016-03-02
20	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	2016-03-05
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富济财富为销售机构、参加富济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	2016-03-08
22	易方达基金管理有限公司关于在大同证券推出旗下部分开放式基金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	2016-03-10
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德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	2016-03-23
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加同花顺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	2016-03-25
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	2016-03-30
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好买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	2016-04-07
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江泰隆商业银行为销售机构、参加浙江泰隆商业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	2016-04-08
28	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正达广为销售机构、参加中正达广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	2016-04-21

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	2016-04-21
30	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国邮政储蓄银行为销售机构、参加中国邮政储蓄银行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	2016-04-22
31	易方达基金管理有限公司关于旗下基金投资基金管理人非控股股东承销证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-22
32	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加锦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	2016-04-22
33	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加诺亚正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	2016-04-28
34	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
35	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
36	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
37	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	2016-05-04
38	易方达基金管理有限公司关于官方淘宝店关闭服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05
39	易方达基金管理有限公司关于网上直销支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05
40	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加云南红塔银行为销售机构、参加云南红塔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	2016-05-09
41	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	2016-05-10
42	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加民生银行直销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	2016-05-13
43	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	2016-05-18

	式基金增加徽商期货为销售机构、参加徽商期货申购费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
44	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	2016-05-19
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盈米财富转换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	2016-05-20
46	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大智慧为销售机构、参加大智慧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	2016-05-20
47	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰金融为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
48	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加川财证券为销售机构、参加川财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	2016-05-27
49	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连银行为销售机构、参加大连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	2016-05-31
50	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鼎信汇金为销售机构、参加鼎信汇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	2016-06-01
51	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加鑫鼎盛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	2016-06-20
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余杭农村商业银行作为销售机构、参加余杭农村商业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	2016-06-23
53	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	2016-06-30
54	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	2016-06-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准易方达价值成长混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达价值成长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和营业执照。

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

二〇一六年八月二十四日