

易方达价值精选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.....	9
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.....	10
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.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
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.....	39
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.....	39
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	40
7.12	投资组合报告附注	40
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	41
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	41
9	开放式基金份额变动	41
10	重大事件揭示	42
10.1	基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4	基金投资策略的改变	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	47
11.3	查阅方式	48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达价值精选混合型证券投资基金
基金简称	易方达价值精选混合
基金主代码	110009
交易代码	110009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 6 月 13 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,897,456,855.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	追求超过基准的投资回报及长期稳健的资产增值。
投资策略	本基金以深入基本面研究为主导进行投资，以“自下而上”精选价值被低估、具备持续增长能力的优势企业为主，结合“自上而下”精选最优行业，动态寻找优势企业与景气行业的最佳结合，构建投资组合。通过调整行业配置偏离度与个股的深入研究来控制风险，寻求超越基准的回报及长期可持续的资产增值。
业绩比较基准	80% × 沪深 300 指数 + 20% × 上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合基金，其预期风险收益水平高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。

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	-267,548,600.10
本期利润	-559,471,839.41
加权平均基金份额本期利润	-0.2086
本期加权平均净值利润率	-18.15%
本期基金份额净值增长率	-13.45%
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	399,053,753.15
期末可供分配基金份额利润	0.1377
期末基金资产净值	3,296,510,608.70
期末基金份额净值	1.1377
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	302.84%

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	7.46%	1.56%	-0.33%	0.78%	7.79%	0.78%
过去三个月	7.81%	1.56%	-1.46%	0.81%	9.27%	0.75%
过去六个月	-13.45%	2.38%	-11.97%	1.47%	-1.48%	0.91%
过去一年	-15.28%	2.80%	-22.52%	1.84%	7.24%	0.96%
过去三年	71.71%	2.09%	37.49%	1.47%	34.22%	0.62%
自基金合同生效起至今	302.84%	1.74%	123.20%	1.54%	179.64%	0.20%

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

易方达价值精选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

(2006 年 6 月 13 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 302.84%，同期业绩比较基准收益率为 123.20%。

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		
郑希	本基金的基金经理、科瑞证券投资基金的基金经理、投资一部副总经理	2014-01-02	-	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、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理。
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、易方达平稳增长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	2014-11-22	-	9 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。

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 股市场整体呈现快速下跌后震荡分化的行情。2016 年上半年，沪深 300 指数

下跌 15.47%，上证综指下跌 17.22%，中小盘指数下跌 20.03%，创业板指数下跌 17.92%，创业板综指下跌 13.89%。

从宏观经济层面看，全球经济复苏低于预期，美国加息预期放缓，全球流动性持续宽松，在此大背景下，全球风险资产价格震荡较大。

从国内流动性层面看，货币政策保持持续放松，但汇率的波动对国内宽松的货币政策形成一定程度的制约。整体存量资产市场博弈的格局没有改变。

从对实体层面看，工业品、农产品价格回升，周期性行业也出现了整体性的盈利回升。

2016 年上半年，本基金主要以成长性投资品种为核心仓位，集中配置新能源汽车、半导体、军工等行业，同时适时配置了白酒、农业等周期行业。

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 1.1377 元，本报告期份额净值增长率为-13.45%，同期业绩比较基准收益率为-11.97%。

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 年下半年，包括大小非解禁在内的资本市场新增供给将被逐步消化，伴随新增资金逐步流入市场，预计整体市场震荡向上，板块轮动加剧。

据此，我们将继续立足中长期盈利成长性和稳定性的原则构建组合，在下一阶段将提高仓位水平，配置具备一定弹性的个股品种，提高整体组合的进攻性。同时，我们还将维持以竞争优势明显、估值合理的稳定成长公司为核心的持仓结构，保持组合的流动性和稳定性，并在中小市值股票中寻找能超越周期的个股。

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 904,760,727.63 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精选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，易方达价值精选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精选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，易方达价值精选混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 2 次利润分配，分配金额为 904,760,727.63 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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精选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：易方达价值精选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	173,040,832.86	355,096,735.80
结算备付金		14,894,444.81	22,217,235.35
存出保证金		1,759,395.99	2,544,468.51
交易性金融资产	6.4.7.2	2,835,283,440.22	3,643,200,091.89
其中：股票投资		2,654,451,883.22	3,461,744,191.89
基金投资		-	-
债券投资		180,831,557.00	181,455,900.00
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	211,630,625.82	-
应收证券清算款		68,059,395.35	10,770,225.09
应收利息	6.4.7.5	4,935,153.77	2,391,293.99
应收股利		-	-
应收申购款		5,304,997.65	2,376,840.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,314,908,286.47	4,038,596,890.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 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		-	8,459,177.68
应付赎回款		4,554,632.55	5,996,707.44
应付管理人报酬		3,952,246.06	5,087,768.22
应付托管费		658,707.66	847,961.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,520,417.27	10,867,636.42

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	711,674.23	913,274.07
负债合计		18,397,677.77	32,172,525.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,897,456,855.55	2,247,970,245.78
未分配利润	6.4.7.10	399,053,753.15	1,758,454,119.81
所有者权益合计		3,296,510,608.70	4,006,424,365.59
负债和所有者权益总计		3,314,908,286.47	4,038,596,890.81

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1377 元，基金份额总额 2,897,456,855.55 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达价值精选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		-503,600,912.78	2,660,551,910.82
1.利息收入		4,143,367.16	4,901,167.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,596,661.94	675,441.86
债券利息收入		2,518,175.51	4,225,725.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		28,529.71	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-216,107,811.64	2,085,721,093.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-220,786,569.71	2,073,461,116.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	7,075,617.30
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	4,678,758.07	5,184,358.98
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-291,923,239.31	567,944,034.78
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	286,771.01	1,985,615.95
减：二、费用		55,870,926.63	69,996,713.64

1. 管理人报酬		23,057,267.61	35,504,584.40
2. 托管费		3,842,877.92	5,917,430.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	28,748,913.74	28,334,529.64
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	221,867.36	240,168.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-559,471,839.41	2,590,555,197.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-559,471,839.41	2,590,555,197.18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达价值精选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）	2,247,970,245.78	1,758,454,119.81	4,006,424,365.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-559,471,839.41	-559,471,839.41
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）	649,486,609.77	104,832,200.38	754,318,810.15
其中：1.基金申购款	901,447,624.08	141,649,106.16	1,043,096,730.24
2.基金赎回款	-251,961,014.31	-36,816,905.78	-288,777,920.09
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）	-	-904,760,727.63	-904,760,727.63
五、期末所有者权益（基金净值）	2,897,456,855.55	399,053,753.15	3,296,510,608.70
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）	3,287,302,471.57	205,212,631.43	3,492,515,103.00
二、本期经营活动产生的	-	2,590,555,197.18	2,590,555,197.18

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-797,689,281.65	-639,976,653.44	-1,437,665,935.09
其中：1.基金申购款	1,229,141,838.64	847,706,608.49	2,076,848,447.13
2.基金赎回款	-2,026,831,120.29	-1,487,683,261.93	-3,514,514,382.22
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）	-	-112,360,354.52	-112,360,354.52
五、期末所有者权益（基金净值）	2,489,613,189.92	2,043,430,820.65	4,533,044,010.57

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

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[2006] 97 号文件“关于同意易方达价值精选股票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《易方达价值精选股票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 2006 年 6 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 11,791,050,807.15 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，基金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。

2015 年 7 月 25 日，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金变更基金类别并由“易方达价值精选股票型证券投资基金”更名为“易方达价值精选混合型证券投资基金”。

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。

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

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、增值税、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。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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；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。

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	173,040,832.86
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	173,040,832.86

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		2,447,749,144.41	2,654,451,883.22	206,702,738.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	754,966.90	831,557.00	76,590.10
	银行间市场	180,020,240.00	180,000,000.00	-20,240.00
	合计	180,775,206.90	180,831,557.00	56,350.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-

合计	2,628,524,351.31	2,835,283,440.22	206,759,088.91
----	------------------	------------------	----------------

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	211,630,625.82	-
合计	211,630,625.82	-

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	75,143.34
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	6,032.25
应收债券利息	4,840,989.14
应收买入返售证券利息	12,276.42
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	712.62
合计	4,935,153.77

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	8,519,791.45
银行间市场应付交易费用	625.82
合计	8,520,417.27

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	500,000.00
应付赎回费	12,768.25
预提费用	198,905.98
合计	711,674.23

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	2,247,970,245.78	2,247,970,245.78
本期申购	901,447,624.08	901,447,624.08
本期赎回（以“-”号填列）	-251,961,014.31	-251,961,014.31
本期末	2,897,456,855.55	2,897,456,855.55

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	2,711,455,985.10	-953,001,865.29	1,758,454,119.81
本期利润	-267,548,600.10	-291,923,239.31	-559,471,839.41
本期基金份额交易产生的变动数	520,445,251.60	-415,613,051.22	104,832,200.38
其中：基金申购款	722,030,065.45	-580,380,959.29	141,649,106.16
基金赎回款	-201,584,813.85	164,767,908.07	-36,816,905.78
本期已分配利润	-904,760,727.63	-	-904,760,727.63
本期末	2,059,591,908.97	-1,660,538,155.82	399,053,753.15

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	1,451,984.09
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	128,395.20
其他	16,282.65
合计	1,596,661.94

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	9,734,187,640.31
减：卖出股票成本总额	9,954,974,210.02
买卖股票差价收入	-220,786,569.71

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

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	4,678,758.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,678,758.07

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	-291,923,239.31
——股票投资	-291,298,896.31
——债券投资	-624,343.00
——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	-291,923,239.31

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	286,771.01
其他	-
合计	286,771.01

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	28,748,913.74
银行间市场交易费用	-
合计	28,748,913.74

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	49,726.04
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	4,161.38
银行间账户维护费	18,000.00
其他	800.00
合计	221,867.36

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 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	
	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	1,574,782,995.53	8.22%	5,060,618,235.73	28.05%

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	1,466,595.98	8.47%	848,907.03	9.96%
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	4,607,187.11	28.06%	2,895,228.87	32.58%

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	23,057,267.61	35,504,584.40
其中：支付销售机构的客户维护费	3,454,254.25	5,297,065.66

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	3,842,877.92	5,917,430.72

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	173,040,832.86	1,451,984.09	461,279,584.96	551,995.94

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	1.400	90,672,573.20	231,237,924.38	321,910,497.58	-

2	2016-03-23	-	2016-03-23	2.350	155,902,837.57	426,947,392.48	582,850,230.05	-
合计				3.750	246,575,410.77	658,185,316.86	904,760,727.63	-

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
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	-

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
000002	万科A	2015-12-21	重大事项停牌	18.20	2016-07-04	21.99	600,000	11,990,233.00	10,920,000.00	-
000409	山东地矿	2016-03-14	重大事项停牌	10.19	-	-	510,000	5,950,960.00	5,196,900.00	-
000617	*ST 济柴	2016-04-20	重大事项停牌	12.91	-	-	639,575	6,949,496.51	8,256,913.25	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项停牌	22.07	-	-	2,069,120	42,646,401.36	45,665,478.40	-
000835	长城动漫	2016-02-29	重大事项停牌	13.22	2016-07-22	14.54	179,820	3,479,783.32	2,377,220.40	-
00097	银泰资	2016-04	重大事	15.00	-	-	300,000	4,549,023.30	4,500,000.00	-

5	源	-19	项停牌							
002072	凯瑞德	2016-02-24	重大事件停牌	22.64	2016-08-17	20.38	504,700	8,285,370.07	11,426,408.00	-
002110	广东鸿图	2016-05-03	重大事件停牌	21.62	-	-	1,511,779	34,642,519.41	32,684,661.98	-
002127	南极电商	2016-05-16	重大事件停牌	9.63	-	-	1,672,000	15,358,997.58	16,101,360.00	-
002246	北化股份	2015-11-23	重大事件停牌	14.10	2016-08-01	12.69	1,044,090	11,127,398.62	14,721,669.00	-
002373	千方科技	2016-05-12	重大事件停牌	17.11	2016-08-16	16.43	219,600	3,811,780.40	3,757,356.00	-
002587	奥拓电子	2016-04-19	重大事件停牌	14.45	2016-07-28	14.00	499,924	6,388,945.61	7,223,901.80	-
002691	冀凯股份	2016-02-23	重大事件停牌	25.81	2016-07-26	23.23	138,400	3,156,161.00	3,572,104.00	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大事件停牌	50.62	-	-	630,200	32,806,458.31	31,900,724.00	-
300166	东方国信	2016-06-08	重大事件停牌	28.23	-	-	100,000	2,622,187.83	2,823,000.00	-
300176	鸿特精密	2016-04-27	重大事件停牌	30.20	-	-	255,000	8,443,652.55	7,701,000.00	-
300223	北京君正	2016-06-03	重大事件停牌	44.00	-	-	634,846	23,314,763.74	27,933,224.00	-
300242	明家联合	2016-05-09	重大事件停牌	34.99	2016-08-12	36.69	1,001,900	30,686,042.51	35,056,481.00	-
300308	中际装备	2016-03-11	重大事件停牌	12.36	-	-	108,100	1,626,483.00	1,336,116.00	-
300323	华灿光电	2016-04-18	重大事件停牌	8.99	-	-	611,200	5,367,781.70	5,494,688.00	-
300351	永贵电器	2016-06-29	重大事件停牌	33.93	2016-07-04	33.30	289,680	8,464,745.04	9,828,842.40	-
600556	慧球科技	2016-01-20	重大事件停牌	15.80	2016-07-07	14.22	1,869,646	42,401,626.04	29,540,406.80	-
600576	万家文化	2016-04-11	重大事件停牌	22.35	-	-	574,000	10,476,448.26	12,828,900.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事件停牌	20.92	2016-07-01	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28	-

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。

本基金是混合型基金，属于证券投资基金中的中等偏高风险品种，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 0.03%(2015 年 12 月 31 日：0.03%)。

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	184,836,885.25	182,735,704.92
合计	184,836,885.25	182,735,704.92

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 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	835,660.89	1,043,008.71
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	835,660.89	1,043,008.71

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	173,040,832.86	-	-	-	173,040,832.86
结算备付金	14,894,444.81	-	-	-	14,894,444.81
存出保证金	1,759,395.99	-	-	-	1,759,395.99

交易性金融资产	180,000,000.00	831,557.00	-	2,654,451,883.22	2,835,283,440.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	211,630,625.82	-	-	-	211,630,625.82
应收证券清算款	-	-	-	68,059,395.35	68,059,395.35
应收利息	-	-	-	4,935,153.77	4,935,153.77
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,304,997.65	5,304,997.65
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	581,325,299.48	831,557.00	-	2,732,751,429.99	3,314,908,286.47
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	-	-	-	4,554,632.55	4,554,632.55
应付管理人报酬	-	-	-	3,952,246.06	3,952,246.06
应付托管费	-	-	-	658,707.66	658,707.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	8,520,417.27	8,520,417.27
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	711,674.23	711,674.23
负债总计	-	-	-	18,397,677.77	18,397,677.77
利率敏感度缺口	581,325,299.48	831,557.00	-	2,714,353,752.22	3,296,510,608.70
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	355,096,735.80	-	-	-	355,096,735.80
结算备付金	22,217,235.35	-	-	-	22,217,235.35
存出保证金	2,544,468.51	-	-	-	2,544,468.51
交易性金融资产	180,414,000.00	1,041,900.00	-	3,461,744,191.89	3,643,200,091.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,770,225.09	10,770,225.09
应收利息	-	-	-	2,391,293.99	2,391,293.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,376,840.18	2,376,840.18
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	560,272,439.66	1,041,900.00	-	3,477,282,551.15	4,038,596,890.81
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	-	-	-	8,459,177.68	8,459,177.68
应付赎回款	-	-	-	5,996,707.44	5,996,707.44
应付管理人报酬	-	-	-	5,087,768.22	5,087,768.22
应付托管费	-	-	-	847,961.39	847,961.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	10,867,636.42	10,867,636.42
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	913,274.07	913,274.07
负债总计	-	-	-	32,172,525.22	32,172,525.22
利率敏感度缺口	560,272,439.66	1,041,900.00	-	3,445,110,025.93	4,006,424,365.59

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	20,878.97	242,472.32
	2.市场利率上升 25 个基点	-20,874.13	-241,822.31

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	2,654,451,883.22	80.52	3,461,744,191.89	86.40
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	2,654,451,883.22	80.52	3,461,744,191.89	86.40

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%	179,749,842.42	190,496,080.41
	2.业绩比较基准下降 5%	-179,749,842.42	-190,496,080.41

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 2,322,829,253.91 元，属于第二层次的余额为 512,454,186.31 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 2,698,646,506.23 元，第二层次 944,553,585.66 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	2,654,451,883.22	80.08

	其中：股票	2,654,451,883.22	80.08
2	固定收益投资	180,831,557.00	5.46
	其中：债券	180,831,557.00	5.46
	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	211,630,625.82	6.38
	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	187,935,277.67	5.67
7	其他各项资产	80,058,942.76	2.42
8	合计	3,314,908,286.47	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	14,082,120.00	0.43
B	采矿业	37,806,408.00	1.15
C	制造业	1,933,240,085.46	58.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,705,700.00	0.17
E	建筑业	775,274.28	0.02
F	批发和零售业	52,468,621.00	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	42,978,066.74	1.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	264,579,801.87	8.03
J	金融业	43,730,625.00	1.33
K	房地产业	144,683,880.00	4.39
L	租赁和商务服务业	51,157,841.00	1.55
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00

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	50,228,829.77	1.52
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,362,504.00	0.28
S	综合	3,632,000.00	0.11
	合计	2,654,451,883.22	80.52

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	002077	大港股份	6,025,400	133,763,880.00	4.06
2	002384	东山精密	6,164,812	122,433,166.32	3.71
3	300365	恒华科技	2,537,501	116,090,670.75	3.52
4	002260	德奥通航	3,516,468	91,252,344.60	2.77
5	300458	全志科技	816,143	87,310,978.14	2.65
6	002224	三力士	3,720,903	86,138,904.45	2.61
7	002428	云南锗业	4,446,966	76,398,875.88	2.32
8	002035	华帝股份	2,830,875	69,299,820.00	2.10
9	600563	法拉电子	1,518,700	69,131,224.00	2.10
10	000661	长春高新	588,334	62,763,471.12	1.90
11	000858	五粮液	1,900,000	61,807,000.00	1.87
12	002643	万润股份	1,060,000	53,932,800.00	1.64
13	603377	东方时尚	1,104,173	50,228,829.77	1.52
14	300236	上海新阳	985,130	49,837,726.70	1.51
15	000651	格力电器	2,069,120	45,665,478.40	1.39
16	300097	智云股份	767,042	38,390,452.10	1.16
17	300340	科恒股份	481,054	38,113,908.42	1.16
18	300199	翰宇药业	1,769,042	36,000,004.70	1.09
19	002371	七星电子	838,756	35,076,775.92	1.06
20	300242	明家联合	1,001,900	35,056,481.00	1.06
21	600458	时代新材	2,170,831	33,821,546.98	1.03
22	300025	华星创业	2,319,615	33,263,279.10	1.01
23	600262	北方股份	1,231,028	33,003,860.68	1.00
24	002101	广东鸿图	1,511,779	32,684,661.98	0.99
25	002443	金洲管道	2,267,000	32,531,450.00	0.99
26	300038	梅泰诺	630,200	31,900,724.00	0.97
27	600029	南方航空	4,342,729	30,659,666.74	0.93

28	600556	慧球科技	1,869,646	29,540,406.80	0.90
29	000779	三毛派神	1,295,300	29,079,485.00	0.88
30	300223	北京君正	634,846	27,933,224.00	0.85
31	600382	广东明珠	1,613,100	25,809,600.00	0.78
32	002436	兴森科技	1,054,473	24,031,439.67	0.73
33	600056	中国医药	1,347,509	21,371,492.74	0.65
34	601689	拓普集团	631,981	20,823,773.95	0.63
35	000807	云铝股份	3,096,900	20,284,695.00	0.62
36	002385	大北农	2,471,200	19,917,872.00	0.60
37	300316	晶盛机电	1,448,461	18,974,839.10	0.58
38	002049	紫光国芯	406,643	17,871,959.85	0.54
39	002414	高德红外	642,718	17,334,104.46	0.53
40	300377	赢时胜	349,194	17,281,611.06	0.52
41	002127	南极电商	1,672,000	16,101,360.00	0.49
42	002155	湖南黄金	1,180,000	15,540,600.00	0.47
43	300183	东软载波	578,537	15,331,230.50	0.47
44	002246	北化股份	1,044,090	14,721,669.00	0.45
45	000876	新 希 望	1,762,600	14,664,832.00	0.44
46	300346	南大光电	326,250	14,593,162.50	0.44
47	002169	智光电气	625,200	14,223,300.00	0.43
48	603806	福斯特	260,150	13,577,228.50	0.41
49	300310	宜通世纪	348,000	13,290,120.00	0.40
50	603898	好莱客	426,348	13,255,159.32	0.40
51	300100	双林股份	299,400	13,116,714.00	0.40
52	002439	启明星辰	500,000	12,915,000.00	0.39
53	600576	万家文化	574,000	12,828,900.00	0.39
54	600198	大唐电信	604,032	12,008,156.16	0.36
55	603766	隆鑫通用	574,700	11,620,434.00	0.35
56	002072	凯瑞德	504,700	11,426,408.00	0.35
57	000002	万 科 A	600,000	10,920,000.00	0.33
58	600975	新五丰	1,186,800	10,859,220.00	0.33
59	300230	永利股份	371,577	10,805,459.16	0.33
60	002050	三花股份	1,070,000	10,325,500.00	0.31
61	601198	东兴证券	422,300	10,321,012.00	0.31
62	300098	高新兴	645,360	10,248,316.80	0.31
63	300322	硕贝德	466,900	10,038,350.00	0.30
64	300285	国瓷材料	250,000	9,972,500.00	0.30
65	600360	华微电子	830,898	9,854,450.28	0.30
66	300351	永贵电器	289,680	9,828,842.40	0.30
67	600184	光电股份	433,415	9,812,515.60	0.30
68	600570	恒生电子	145,000	9,681,650.00	0.29
69	300336	新文化	374,800	9,362,504.00	0.28
70	002361	神剑股份	1,200,000	9,312,000.00	0.28
71	002097	山河智能	900,000	9,261,000.00	0.28

72	000901	航天科技	225,675	9,060,851.25	0.27
73	603678	火炬电子	118,400	9,024,448.00	0.27
74	002639	雪人股份	765,000	8,904,600.00	0.27
75	600775	南京熊猫	590,400	8,826,480.00	0.27
76	002673	西部证券	322,800	8,347,608.00	0.25
77	000617	*ST 济柴	639,575	8,256,913.25	0.25
78	600109	国金证券	600,000	8,088,000.00	0.25
79	600006	东风汽车	900,000	7,983,000.00	0.24
80	300066	三川智慧	799,916	7,831,177.64	0.24
81	300159	新研股份	430,900	7,777,745.00	0.24
82	002519	银河电子	346,021	7,757,790.82	0.24
83	600285	羚锐制药	718,400	7,751,536.00	0.24
84	300176	鸿特精密	255,000	7,701,000.00	0.23
85	600566	济川药业	290,400	7,474,896.00	0.23
86	600096	云天化	800,000	7,440,000.00	0.23
87	300231	银信科技	400,000	7,376,000.00	0.22
88	002587	奥拓电子	499,924	7,223,901.80	0.22
89	300331	苏大维格	250,000	7,127,500.00	0.22
90	002262	恩华药业	344,200	6,935,630.00	0.21
91	002434	万里扬	611,600	6,654,208.00	0.20
92	000686	东北证券	510,000	6,584,100.00	0.20
93	603021	山东华鹏	140,000	6,342,000.00	0.19
94	600030	中信证券	387,900	6,295,617.00	0.19
95	002158	汉钟精机	509,920	6,287,313.60	0.19
96	600422	昆药集团	457,100	6,234,844.00	0.19
97	300017	网宿科技	90,000	6,048,000.00	0.18
98	002020	京新药业	481,500	5,956,155.00	0.18
99	600521	华海药业	239,768	5,831,157.76	0.18
100	000421	南京公用	570,000	5,705,700.00	0.17
101	600079	人福医药	337,900	5,666,583.00	0.17
102	002550	千红制药	660,000	5,504,400.00	0.17
103	300323	华灿光电	611,200	5,494,688.00	0.17
104	002117	东港股份	169,100	5,319,886.00	0.16
105	300395	菲利华	197,944	5,300,940.32	0.16
106	300016	北陆药业	227,800	5,205,230.00	0.16
107	000409	山东地矿	510,000	5,196,900.00	0.16
108	002462	嘉事堂	138,400	5,155,400.00	0.16
109	002171	楚江新材	292,500	5,039,775.00	0.15
110	601799	星宇股份	100,000	4,582,000.00	0.14
111	300429	强力新材	32,800	4,580,848.00	0.14
112	000975	银泰资源	300,000	4,500,000.00	0.14
113	002245	澳洋顺昌	350,000	4,469,500.00	0.14
114	603108	润达医疗	155,900	4,394,821.00	0.13
115	600855	航天长峰	137,113	4,291,636.90	0.13

116	000963	华东医药	63,500	4,279,900.00	0.13
117	000089	深圳机场	503,400	4,278,900.00	0.13
118	300123	太阳鸟	303,925	4,267,107.00	0.13
119	300302	同有科技	130,000	4,221,100.00	0.13
120	601688	华泰证券	216,400	4,094,288.00	0.12
121	002373	千方科技	219,600	3,757,356.00	0.11
122	300440	运达科技	111,266	3,750,776.86	0.11
123	000983	西山煤电	447,600	3,647,940.00	0.11
124	000532	力合股份	200,000	3,632,000.00	0.11
125	002691	冀凯股份	138,400	3,572,104.00	0.11
126	300350	华鹏飞	100,000	3,570,000.00	0.11
127	000070	特发信息	128,900	3,379,758.00	0.10
128	002484	江海股份	221,400	3,376,350.00	0.10
129	000513	丽珠集团	72,500	3,342,975.00	0.10
130	600395	盘江股份	400,000	3,304,000.00	0.10
131	600348	阳泉煤业	500,000	3,185,000.00	0.10
132	300416	苏试试验	90,000	3,114,000.00	0.09
133	603020	爱普股份	134,000	3,067,260.00	0.09
134	600459	贵研铂业	100,000	2,988,000.00	0.09
135	600549	厦门钨业	100,000	2,971,000.00	0.09
136	600303	曙光股份	200,000	2,970,000.00	0.09
137	300166	东方国信	100,000	2,823,000.00	0.09
138	300026	红日药业	158,500	2,756,315.00	0.08
139	002240	威华股份	200,000	2,672,000.00	0.08
140	300033	同花顺	31,360	2,554,272.00	0.08
141	300059	东方财富	114,200	2,535,240.00	0.08
142	300326	凯利泰	99,200	2,479,008.00	0.08
143	601225	陕西煤业	470,400	2,431,968.00	0.07
144	000835	长城动漫	179,820	2,377,220.40	0.07
145	300053	欧比特	123,200	2,236,080.00	0.07
146	300127	银河磁体	84,600	2,155,608.00	0.07
147	600557	康缘药业	130,800	2,135,964.00	0.06
148	002458	益生股份	40,000	1,752,400.00	0.05
149	000687	华讯方舟	86,600	1,714,680.00	0.05
150	300295	三六五网	52,513	1,706,672.50	0.05
151	300418	昆仑万维	60,000	1,696,200.00	0.05
152	600345	长江通信	78,100	1,650,253.00	0.05
153	002234	民和股份	50,000	1,470,500.00	0.04
154	300252	金信诺	44,000	1,457,720.00	0.04
155	002364	中恒电气	50,000	1,371,500.00	0.04
156	300308	中际装备	108,100	1,336,116.00	0.04
157	002612	朗姿股份	50,000	1,246,500.00	0.04
158	601908	京运通	150,000	1,150,500.00	0.03
159	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.02

160	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
161	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
162	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
163	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
164	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
165	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
166	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
167	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
168	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
169	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
170	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
171	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	000858	五 粮 液	152,875,585.71	3.82
2	002224	三 力 士	129,053,965.99	3.22
3	603799	华友钴业	123,291,522.49	3.08
4	002643	万润股份	115,985,591.50	2.89
5	300097	智云股份	112,377,757.47	2.80
6	300033	同花顺	106,225,808.61	2.65
7	002340	格林美	102,398,939.73	2.56
8	300365	恒华科技	101,341,838.36	2.53
9	300073	当升科技	99,279,716.95	2.48
10	002456	欧菲光	94,656,445.89	2.36
11	300014	亿纬锂能	90,326,811.43	2.25
12	600549	厦门钨业	89,469,160.21	2.23
13	300458	全志科技	85,925,820.62	2.14
14	002428	云南锗业	82,021,296.67	2.05
15	000933	*ST 神火	80,235,267.67	2.00
16	002384	东山精密	79,096,246.14	1.97
17	600392	盛和资源	78,653,412.87	1.96
18	002077	大港股份	77,851,645.40	1.94
19	002245	澳洋顺昌	71,169,062.97	1.78
20	600395	盘江股份	71,021,399.56	1.77

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	300113	顺网科技	170,494,238.20	4.26
2	002329	皇氏集团	155,933,638.95	3.89
3	603799	华友钴业	150,193,561.47	3.75
4	300073	当升科技	132,402,849.09	3.30
5	000858	五粮液	128,205,929.29	3.20
6	600391	成发科技	120,840,101.25	3.02
7	300014	亿纬锂能	119,116,231.47	2.97
8	000901	航天科技	115,584,476.16	2.88
9	002340	格林美	111,895,925.49	2.79
10	002494	华斯股份	105,586,736.49	2.64
11	300033	同花顺	104,156,324.82	2.60
12	600392	盛和资源	102,072,177.78	2.55
13	000973	佛塑科技	98,155,615.56	2.45
14	002456	欧菲光	94,319,457.40	2.35
15	300097	智云股份	92,171,233.95	2.30
16	600549	厦门钨业	90,018,974.15	2.25
17	002517	恺英网络	87,490,051.26	2.18
18	002284	亚太股份	86,793,420.50	2.17
19	300199	翰宇药业	85,414,037.04	2.13
20	002245	澳洋顺昌	78,400,290.34	1.96

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	9,438,980,797.66
卖出股票收入（成交）总额	9,734,187,640.31

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	180,000,000.00	5.46
	其中：政策性金融债	180,000,000.00	5.46
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）	831,557.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	180,831,557.00	5.49

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	1,800,000	180,000,000.00	5.46
2	132003	15 清控 EB	7,550	831,557.00	0.03

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	1,759,395.99
2	应收证券清算款	68,059,395.35
3	应收股利	-
4	应收利息	4,935,153.77
5	应收申购款	5,304,997.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,058,942.76

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
93,001	31,155.12	131,297,885.89	4.53%	2,766,158,969.66	95.47%

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	7,087,005.52	0.2446%

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（2006 年 6 月 13 日）基金份额总额	11,791,050,807.15
本报告期期初基金份额总额	2,247,970,245.78
本报告期基金总申购份额	901,447,624.08
减：本报告期基金总赎回份额	251,961,014.31
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,897,456,855.55

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	465,279,910.09	2.43%	433,314.87	2.50%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	1,196,893,206.68	6.24%	1,114,668.54	6.44%	-
中信证券	3	3,468,421,317.24	18.10%	2,890,562.31	16.69%	-
中信建投	2	697,510,535.60	3.64%	649,592.69	3.75%	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	1,230,524,213.36	6.42%	1,145,979.98	6.62%	-
东兴证券	1	218,101,080.30	1.14%	203,120.05	1.17%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	325,143,901.82	1.70%	302,809.54	1.75%	-
申万宏源	1	598,679,923.02	3.12%	557,548.73	3.22%	-
兴业证券	1	892,075,345.77	4.65%	830,787.68	4.80%	-
平安证券	1	209,308,224.50	1.09%	194,926.95	1.13%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	653,743,368.87	3.41%	522,994.99	3.02%	-
银河证券	1	91,548,132.74	0.48%	85,258.25	0.49%	-
光大证券	1	136,256,934.01	0.71%	126,895.36	0.73%	-
中泰证券	1	5,488,455,916.96	28.64%	5,001,637.58	28.89%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	1,574,782,995.53	8.22%	1,466,595.98	8.47%	-
西南证券	1	527,508,157.69	2.75%	491,267.03	2.84%	-
海通证券	1	1,392,076,909.15	7.26%	1,296,442.91	7.49%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增东北证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司各一个交易单元。

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。

10.8 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
4	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
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	2016-01-12
6	易方达价值精选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
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
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
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
10	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
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	2016-01-29
12	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

13	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
14	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
15	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
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青岛农商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	2016-03-09
17	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
18	易方达价值精选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	2016-03-21
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
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
21	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
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
23	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
24	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
25	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
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加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
27	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	2016-04-28

	式基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
28	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
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	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
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	2016-05-10
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加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
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	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-18
38	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
39	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加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
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
41	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加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

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
43	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加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
44	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
45	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	2016-06-14
46	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
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
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	2016-06-29
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
50	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. 中国证监会核准易方达价值精选股票型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达价值精选混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
4. 《易方达价值精选混合型证券投资基金托管协议》；
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