

**科瑞证券投资基金**  
**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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
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.....	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.....	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	期末上市基金前十名持有人 .....	40
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	41
9	重大事件揭示 .....	41
9.1	基金份额持有人大会决议 .....	41
9.2	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
9.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
9.4	基金投资策略的改变 .....	42
9.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
9.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	42
9.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
9.8	其他重大事件 .....	43
10	备查文件目录 .....	45
10.1	备查文件目录 .....	45
10.2	存放地点 .....	45
10.3	查阅方式 .....	46

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	科瑞证券投资基金
基金简称	易方达科瑞封闭
基金主代码	500056
交易代码	500056
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002 年 3 月 12 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份
基金合同存续期	2002 年 3 月 12 日至 2017 年 3 月 11 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2002 年 3 月 20 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于价值被市场绝对或相对低估的股票。本基金的投资目标是在控制股票投资组合的风险的前提下，追求基金资产的长期稳定的增值。
投资策略	基金管理人在对宏观经济和 market 发展趋势进行深入分析的基础上，进行资产在股票、债券和现金间的资产配置。当判断股票市场趋势向好时，基金管理人采取积极进取的投资方式，加大股票投资比例，降低债券投资、现金的比例，力求取得较好的资本增值收益；当预测股票市场走势趋淡时，则降低股票投资比例，加大债券投资和现金比例，避免股票市场大幅下挫时引起的资产损失。基金管理人主要选择公司价值被市场相对和绝对低估的股票构建投资组合。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	汤嵩彦
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559

传真	020-85104666	021-62701216
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	上海市浦东新区银城中路188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	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码	510620	200120
法定代表人	刘晓艳	牛锡明

## 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	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 36 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	-496,367,252.94
本期利润	-887,250,154.86
加权平均基金份额本期利润	-0.2958
本期加权平均净值利润率	-28.18%
本期基金份额净值增长率	-13.62%
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	-337,984,715.71
期末可供分配基金份额利润	-0.1127
期末基金资产净值	2,809,330,531.63
期末基金份额净值	0.9364
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	619.54%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人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	7.71%	1.50%	-	-	-	-
过去三个月	4.70%	2.02%	-	-	-	-
过去六个月	-13.62%	4.53%	-	-	-	-
过去一年	-14.96%	5.15%	-	-	-	-
过去三年	59.22%	3.96%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	619.54%	3.07%	-	-	-	-

#### 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

科瑞证券投资基金

份额累计净值增长率历史走势图

(2002年3月12日至2016年6月30日)



注：1. 本基金基金合同未规定业绩比较基准。

2. 自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 619.54%。

#### 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资格。2005 年 8 月,易方达获得企业年金基金投资管理资格。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、易方达价值精选混合型证券投资基金的基金经理、投资一部副总经理	2012-09-28	-	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。
常远	本基金的基金经理	2016-01-23	-	6 年	博士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、投资经理。

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。

本基金在 2016 年上半年保持稳定仓位，依然以成长性投资品种为核心仓位，保持对新能源汽车、半导体、军工等新兴成长类核心品种的占比，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 0.9364 元，本报告期份额净值增长率为-13.62%。

#### 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。

基于以上判断，本基金在下一阶段将逐步提升仓位水平，增加弹性较大的个股的配置比例以提高组合的进攻性。整体立足中长期盈利成长性和稳定性的原则构建组合，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 1,515,000,002.19 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

2016 年上半年度，托管人在科瑞基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

2016 年上半年度，易方达基金管理有限公司在科瑞基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 4 次收益分配，分配金额为 1515000002.19 元，符合基金合同的规定。

#### 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

2016 年上半年度，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关科瑞基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：科瑞证券投资基金

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	132,145,014.13	290,142,282.83

结算备付金		13,880,441.70	22,980,263.13
存出保证金		1,854,377.77	3,138,229.38
交易性金融资产	6.4.7.2	2,649,802,771.72	4,899,398,673.56
其中：股票投资		2,035,203,414.92	3,811,831,747.36
基金投资		-	-
债券投资		614,599,356.80	1,087,566,926.20
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		17,352,722.49	15,000,210.97
应收利息	6.4.7.5	11,886,481.45	31,633,774.67
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		2,826,921,809.26	5,262,293,434.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
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		4,579,511.85	29,353,849.66
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,401,434.50	6,604,305.56
应付托管费		566,905.73	1,100,717.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,246,799.15	11,695,934.20
应交税费		1,307,938.86	1,307,938.86
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	488,687.54	650,000.00
负债合计		17,591,277.63	50,712,745.86
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	-190,669,468.37	2,211,580,688.68
所有者权益合计		2,809,330,531.63	5,211,580,688.68
负债和所有者权益总计		2,826,921,809.26	5,262,293,434.54

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9364 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：科瑞证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		<b>-821,662,106.36</b>	<b>2,020,818,067.58</b>
1.利息收入		18,013,868.22	23,290,558.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	733,301.21	473,498.26
债券利息收入		16,982,473.11	22,817,060.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		298,093.90	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-448,793,072.66	1,816,259,741.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-454,065,999.26	1,803,875,098.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,080,529.06	8,537,252.69
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	3,192,397.54	3,847,390.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-390,882,901.92	181,267,767.42
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>65,588,048.50</b>	<b>78,719,304.30</b>
1. 管理人报酬		24,145,460.88	37,063,052.29
2. 托管费		4,024,243.40	6,177,175.37
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	32,612,544.92	32,513,693.72
5. 利息支出		-	1,898,940.02
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,898,940.02
6. 其他费用	6.4.7.19	4,805,799.30	1,066,442.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-887,250,154.86</b>	<b>1,942,098,763.28</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-887,250,154.86</b>	<b>1,942,098,763.28</b>

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：科瑞证券投资基金

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）	3,000,000,000.00	2,211,580,688.68	5,211,580,688.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-887,250,154.86	-887,250,154.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,515,000,002.19	-1,515,000,002.19
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-190,669,468.37	2,809,330,531.63
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）	3,000,000,000.00	621,413,348.49	3,621,413,348.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,942,098,763.28	1,942,098,763.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-270,000,000.00	-270,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	2,293,512,111.77	5,293,512,111.77

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

科瑞证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监基金字[2001]59 号文件“关于同意科瑞证券投资基金设立的批复”批准，由广东粤财信托有限公司及易方达基金管理有限公司二家发起人共同发起并向社会募集设立。本基金共募集基金份额 30 亿份，2002 年 3 月 12 日基金合同生效，2002 年 3 月 20 日正式在上海证券交易所上市。本基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行。

### 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	132,145,014.13
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	132,145,014.13

#### 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	1,892,684,457.52	2,035,203,414.92	142,518,957.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,189,288.00	76,068.80
	银行间市场	607,613,778.86	4,720,221.14
	合计	609,803,066.86	4,796,289.94
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,502,487,524.38	2,649,802,771.72	147,315,247.34

#### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	19,565.48
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	5,621.58

应收债券利息	11,860,543.34
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	751.05
合计	11,886,481.45

#### 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	7,246,799.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,246,799.15

#### 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	250,000.00
应付赎回费	-
预提费用	238,687.54
合计	488,687.54

#### 6.4.7.9 实收基金

本基金本报告期及上年度可比期间实收基金的份额未发生变动。

#### 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	1,673,382,539.42	538,198,149.26	2,211,580,688.68
本期利润	-496,367,252.94	-390,882,901.92	-887,250,154.86
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,515,000,002.19	-	-1,515,000,002.19
本期末	-337,984,715.71	147,315,247.34	-190,669,468.37

#### 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	563,135.71
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	150,433.62
其他	19,731.88
合计	733,301.21

#### 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	11,450,020,644.77
减：卖出股票成本总额	11,904,086,644.03
买卖股票差价收入	-454,065,999.26

#### 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	479,521,930.47
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	462,464,670.94
减：应收利息总额	14,976,730.47
买卖债券差价收入	2,080,529.06

#### 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	3,192,397.54
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,192,397.54

#### 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	-390,882,901.92
——股票投资	-380,380,003.46
——债券投资	-10,502,898.46

——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	-390,882,901.92

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 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	32,611,019.92
银行间市场交易费用	1,525.00
合计	32,612,544.92

#### 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	59,672.34
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	1,611.75
银行间账户维护费	18,000.00
上市费	29,835.26
分红手续费	4,545,000.01
其他	2,500.00
合计	4,805,799.30

#### 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
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	基金托管人
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

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 额的比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
广发证券	1,253,455,898.48	5.71%	142,622,077.19	0.67%

##### 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	1,136,191.43	5.91%	189,797.41	2.62%
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	129,843.52	0.68%	-	-

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	24,145,460.88	37,063,052.29
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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	4,024,243.40	6,177,175.37

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

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	219,110,562.00	219,110,562.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	70,497,900.00	-
期末持有的基金份额	148,612,662.00	219,110,562.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.95%	7.30%

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

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
粤财信托	7,500,000.00	0.25%	7,500,000.00	0.25%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	132,145,014.13	563,135.71	705,956,495.50	330,212.86

注：本基金的银行存款由基金托管人交通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

金额单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	002790	瑞尔特	新股网下发行	3,022	50,104.76
广发证券	300518	盛讯达	新股网下发行	1,306	29,019.32
广发证券	603028	赛福天	新股网下发行	3,309	14,096.34
广发证券	603131	上海沪工	新股网下发行	1,263	12,743.67
广发证券	603339	四方冷链	新股网下发行	2,793	28,460.67
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 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	2016-02-15	2016-02-16	-	1.000	300,000,000.00	-	300,000,000.00	-
2	2016-03-01	2016-03-02	-	1.400	420,000,000.00	-	420,000,000.00	-
3	2016-03-16	2016-03-17	-	1.250	375,000,002.19	-	375,000,002.19	-
4	2016-03-23	2016-03-24	-	1.400	420,000,000.00	-	420,000,000.00	-
合计				5.050	1,515,000,002.19	-	1,515,000,002.19	-

#### 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	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-



				受限						
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	700,000	13,980,045.33	12,740,000.00	-
000409	山东地矿	2016-03-14	重大事项停牌	10.19	-	-	1,509,902	17,395,623.45	15,385,901.38	-
000617	*ST 济柴	2016-04-20	重大事项停牌	12.91	-	-	66,300	781,865.00	855,933.00	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项停牌	22.07	-	-	586,769	12,122,486.23	12,949,991.83	-
000932	华菱钢铁	2016-03-28	重大事项停牌	3.95	2016-08-08	4.35	1,500,000	5,704,845.13	5,925,000.00	-
000975	银泰资源	2016-04-19	重大事项停牌	15.00	-	-	280,000	4,221,607.00	4,200,000.00	-
002072	凯瑞德	2016-02-24	重大事项停牌	22.64	2016-08-17	20.38	852,083	13,991,507.15	19,291,159.12	-
002110	广东鸿图	2016-05-03	重大事项停牌	21.62	-	-	120,000	1,147,200.00	2,594,400.00	-
002127	南极电商	2016-05-16	重大事项停牌	9.63	-	-	2,820,000	25,640,262.68	27,156,600.00	-
002567	唐人神	2016-05-16	重大事项停牌	13.98	2016-07-29	13.23	1,717,177	21,843,197.52	24,006,134.46	-
002587	奥拓电子	2016-04-19	重大事项停牌	14.45	2016-07-28	14.00	1,049,961	14,203,367.14	15,171,936.45	-
002691	冀凯股份	2016-02-23	重大事项停牌	25.81	2016-07-26	23.23	127,829	3,147,768.27	3,299,266.49	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大事项停牌	50.62	-	-	1,059,988	55,506,746.55	53,656,592.56	-
300176	鸿特精密	2016-04-27	重大事项停牌	30.20	-	-	280,000	9,466,550.00	8,456,000.00	-
300223	北京君正	2016-06-03	重大事项停牌	44.00	-	-	832,859	30,179,214.59	36,645,796.00	-

600209	罗顿发展	2016-02-24	重大事项停牌	11.13	-	-	600,000	6,160,208.42	6,678,000.00	-
600556	慧球科技	2016-01-20	重大事项停牌	15.80	2016-07-07	14.22	2,247,452	51,725,530.75	35,509,741.60	-
600576	万家文化	2016-04-11	重大事项停牌	22.35	-	-	500,000	8,567,153.70	11,175,000.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	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。

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 0.00%(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	352,123,754.60	548,052,862.67
合计	352,123,754.60	548,052,862.67

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	0.00	0.00
未评级	274,336,145.54	571,110,839.03
合计	274,336,145.54	571,110,839.03

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	132,145,014.13	-	-	-	132,145,014.13
结算备付金	13,880,441.70	-	-	-	13,880,441.70
存出保证金	1,854,377.77	-	-	-	1,854,377.77
交易性金融资产	344,448,000.00	267,886,000.00	2,265,356.80	2,035,203,414.92	2,649,802,771.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	17,352,722.49	17,352,722.49
应收利息	-	-	-	11,886,481.45	11,886,481.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	492,327,833.60	267,886,000.00	2,265,356.80	2,064,442,618.86	2,826,921,809.26
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,579,511.85	4,579,511.85
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,401,434.50	3,401,434.50
应付托管费	-	-	-	566,905.73	566,905.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	7,246,799.15	7,246,799.15
应交税费	-	-	-	1,307,938.86	1,307,938.86
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	488,687.54	488,687.54

负债总计	-	-	-	17,591,277.63	17,591,277.63
利率敏感度缺口	492,327,833.60	267,886,000.00	2,265,356.80	2,046,851,341.23	2,809,330,531.63
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	290,142,282.83	-	-	-	290,142,282.83
结算备付金	22,980,263.13	-	-	-	22,980,263.13
存出保证金	3,138,229.38	-	-	-	3,138,229.38
交易性金融资产	535,502,233.40	549,792,000.00	2,272,692.80	3,811,831,747.36	4,899,398,673.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	15,000,210.97	15,000,210.97
应收利息	-	-	-	31,633,774.67	31,633,774.67
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	851,763,008.74	549,792,000.00	2,272,692.80	3,858,465,733.00	5,262,293,434.54
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	-	-	-	29,353,849.66	29,353,849.66
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	6,604,305.56	6,604,305.56
应付托管费	-	-	-	1,100,717.58	1,100,717.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	11,695,934.20	11,695,934.20
应交税费	-	-	-	1,307,938.86	1,307,938.86
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	650,000.00	650,000.00
负债总计	-	-	-	50,712,745.86	50,712,745.86
利率敏感度缺口	851,763,008.74	549,792,000.00	2,272,692.80	3,807,752,987.14	5,211,580,688.68

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	1,684,793.22	2,935,704.27
	2.市场利率上升25个基点	-1,674,149.00	-2,916,069.60

#### 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	2,035,203,414.92	72.44	3,811,831,747.36	73.14
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	2,035,203,414.92	72.44	3,811,831,747.36	73.14

#### 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%	118,000,510.72	173,200,979.66
2.业绩比较基准下降 5%	-118,000,510.72	-173,200,979.66	

注：股票投资业绩基准取上证 A 指数。

#### 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 1,738,730,687.75 元，属于第二层次的余额为 911,072,083.97 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 2,971,457,694.36 元，第二层次 1,927,940,979.20 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	2,035,203,414.92	71.99
	其中：股票	2,035,203,414.92	71.99
2	固定收益投资	614,599,356.80	21.74
	其中：债券	614,599,356.80	21.74
	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	146,025,455.83	5.17
7	其他各项资产	31,093,581.71	1.10
8	合计	2,826,921,809.26	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	15,691,500.00	0.56
B	采矿业	63,774,115.67	2.27
C	制造业	1,471,210,140.59	52.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,008,499.50	0.32



E	建筑业	7,453,274.28	0.27
F	批发和零售业	16,275,000.00	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	34,125,000.00	1.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	187,898,701.67	6.69
J	金融业	18,766,115.80	0.67
K	房地产业	128,351,000.00	4.57
L	租赁和商务服务业	27,156,600.00	0.97
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	15,120,000.00	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	34,905,341.31	1.24
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	5,448,000.00	0.19
	合计	2,035,203,414.92	72.44

### 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	4,780,000	106,116,000.00	3.78
2	300365	恒华科技	2,220,000	101,565,000.00	3.62
3	002384	东山精密	4,689,876	93,140,937.36	3.32
4	000858	五粮液	2,700,000	87,831,000.00	3.13
5	002643	万润股份	1,518,500	77,261,280.00	2.75
6	002224	三力士	2,870,000	66,440,500.00	2.36
7	002428	云南锗业	3,482,621	59,831,428.78	2.13
8	300458	全志科技	510,000	54,559,800.00	1.94
9	300038	梅泰诺	1,059,988	53,656,592.56	1.91
10	300236	上海新阳	1,000,000	50,590,000.00	1.80
11	002035	华帝股份	1,995,000	48,837,600.00	1.74
12	600563	法拉电子	1,050,000	47,796,000.00	1.70
13	000661	长春高新	440,000	46,939,200.00	1.67
14	002260	德奥通航	1,737,676	45,092,692.20	1.61
15	600458	时代新材	2,560,000	39,884,800.00	1.42

16	300097	智云股份	790,000	39,539,500.00	1.41
17	300223	北京君正	832,859	36,645,796.00	1.30
18	600556	慧球科技	2,247,452	35,509,741.60	1.26
19	603377	东方时尚	767,319	34,905,341.31	1.24
20	300340	科恒股份	418,046	33,121,784.58	1.18
21	002127	南极电商	2,820,000	27,156,600.00	0.97
22	300346	南大光电	594,960	26,612,560.80	0.95
23	002371	七星电子	590,000	24,673,800.00	0.88
24	002567	唐人神	1,717,177	24,006,134.46	0.85
25	300100	双林股份	539,500	23,635,495.00	0.84
26	002155	湖南黄金	1,739,963	22,915,312.71	0.82
27	603806	福斯特	437,200	22,817,468.00	0.81
28	002361	神剑股份	2,700,000	20,952,000.00	0.75
29	300199	翰宇药业	973,100	19,802,585.00	0.70
30	000807	云铝股份	2,959,200	19,382,760.00	0.69
31	300310	宜通世纪	506,404	19,339,568.76	0.69
32	002072	凯瑞德	852,083	19,291,159.12	0.69
33	600029	南方航空	2,700,000	19,062,000.00	0.68
34	002050	三花股份	1,950,000	18,817,500.00	0.67
35	300285	国瓷材料	400,000	15,956,000.00	0.57
36	300316	晶盛机电	1,200,000	15,720,000.00	0.56
37	000409	山东地矿	1,509,902	15,385,901.38	0.55
38	002587	奥拓电子	1,049,961	15,171,936.45	0.54
39	600749	西藏旅游	800,000	15,120,000.00	0.54
40	000779	三毛派神	650,000	14,592,500.00	0.52
41	300322	硕贝德	650,724	13,990,566.00	0.50
42	300429	强力新材	95,604	13,352,054.64	0.48
43	300183	东软载波	500,000	13,250,000.00	0.47
44	000651	格力电器	586,769	12,949,991.83	0.46
45	002550	千红制药	1,540,000	12,843,600.00	0.46
46	000002	万科A	700,000	12,740,000.00	0.45
47	300098	高新兴	800,000	12,704,000.00	0.45
48	002439	启明星辰	450,000	11,623,500.00	0.41
49	002245	澳洋顺昌	900,000	11,493,000.00	0.41
50	300331	苏大维格	400,000	11,404,000.00	0.41
51	600576	万家文化	500,000	11,175,000.00	0.40
52	600198	大唐电信	500,000	9,940,000.00	0.35
53	600109	国金证券	730,000	9,840,400.00	0.35
54	300313	天山生物	600,000	9,840,000.00	0.35
55	600309	万华化学	560,000	9,688,000.00	0.34
56	300398	飞凯材料	127,852	9,563,329.60	0.34
57	000567	海德股份	300,000	9,495,000.00	0.34
58	601799	星宇股份	200,000	9,164,000.00	0.33
59	603678	火炬电子	120,000	9,146,400.00	0.33

60	000421	南京公用	899,950	9,008,499.50	0.32
61	000686	东北证券	691,380	8,925,715.80	0.32
62	600056	中国医药	550,000	8,723,000.00	0.31
63	002443	金洲管道	600,000	8,610,000.00	0.31
64	002639	雪人股份	730,000	8,497,200.00	0.30
65	300176	鸿特精密	280,000	8,456,000.00	0.30
66	600096	云天化	900,000	8,370,000.00	0.30
67	002123	荣信股份	400,000	8,316,000.00	0.30
68	601225	陕西煤业	1,556,392	8,046,546.64	0.29
69	601689	拓普集团	223,600	7,367,620.00	0.26
70	603766	隆鑫通用	360,100	7,281,222.00	0.26
71	600262	北方股份	270,000	7,238,700.00	0.26
72	600209	罗顿发展	600,000	6,678,000.00	0.24
73	300127	银河磁体	255,700	6,515,236.00	0.23
74	300302	同有科技	200,000	6,494,000.00	0.23
75	300231	银信科技	350,000	6,454,000.00	0.23
76	300377	赢时胜	120,999	5,988,240.51	0.21
77	600459	贵研铂业	200,000	5,976,000.00	0.21
78	000932	华菱钢铁	1,500,000	5,925,000.00	0.21
79	300025	华星创业	400,000	5,736,000.00	0.20
80	000532	力合股份	300,000	5,448,000.00	0.19
81	300395	菲利华	200,000	5,356,000.00	0.19
82	300081	恒信移动	300,000	5,100,000.00	0.18
83	600547	山东黄金	126,384	4,917,601.44	0.18
84	300416	苏试试验	140,000	4,844,000.00	0.17
85	002409	雅克科技	213,200	4,745,832.00	0.17
86	600570	恒生电子	70,000	4,673,900.00	0.17
87	002436	兴森科技	200,000	4,558,000.00	0.16
88	600775	南京熊猫	300,000	4,485,000.00	0.16
89	002049	紫光国芯	100,000	4,395,000.00	0.16
90	002458	益生股份	100,000	4,381,000.00	0.16
91	000983	西山煤电	534,890	4,359,353.50	0.16
92	002169	智光电气	190,000	4,322,500.00	0.15
93	002519	银河电子	189,980	4,259,351.60	0.15
94	002484	江海股份	276,900	4,222,725.00	0.15
95	000975	银泰资源	280,000	4,200,000.00	0.15
96	600348	阳泉煤业	620,000	3,949,400.00	0.14
97	600328	兰太实业	328,500	3,948,570.00	0.14
98	002309	中利科技	200,000	3,582,000.00	0.13
99	300350	华鹏飞	100,000	3,570,000.00	0.13
100	002494	华斯股份	219,721	3,394,689.45	0.12
101	002691	冀凯股份	127,829	3,299,266.49	0.12
102	600885	宏发股份	100,000	3,071,000.00	0.11
103	002101	广东鸿图	120,000	2,594,400.00	0.09

104	002612	朗姿股份	100,000	2,493,000.00	0.09
105	300373	扬杰科技	100,000	2,411,000.00	0.09
106	000059	华锦股份	200,000	1,860,000.00	0.07
107	002234	民和股份	50,000	1,470,500.00	0.05
108	000617	*ST 济柴	66,300	855,933.00	0.03
109	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
110	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
111	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
112	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
113	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
114	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
115	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
116	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
117	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
118	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
119	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
120	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
121	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
122	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
123	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	000933	*ST 神火	143,447,653.29	2.75
2	300073	当升科技	115,171,821.84	2.21
3	002224	三力士	114,796,710.20	2.20
4	002340	格林美	108,934,384.59	2.09
5	000983	西山煤电	105,214,978.18	2.02
6	002643	万润股份	103,903,398.90	1.99
7	300033	同花顺	103,334,642.99	1.98
8	000858	五粮液	103,162,486.04	1.98
9	002384	东山精密	102,885,316.76	1.97
10	300097	智云股份	101,698,502.46	1.95
11	002077	大港股份	96,685,928.76	1.86
12	603799	华友钴业	96,103,876.96	1.84
13	600549	厦门钨业	95,570,807.63	1.83
14	300113	顺网科技	92,291,844.58	1.77

15	300365	恒华科技	90,666,218.28	1.74
16	000779	三毛派神	86,054,311.54	1.65
17	000932	华菱钢铁	86,015,038.51	1.65
18	002601	佰利联	85,586,110.58	1.64
19	000567	海德股份	84,559,564.02	1.62
20	300014	亿纬锂能	83,988,764.46	1.61

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	176,528,438.28	3.39
2	300073	当升科技	147,825,589.91	2.84
3	600391	成发科技	146,998,216.36	2.82
4	002329	皇氏集团	141,270,419.37	2.71
5	000933	*ST 神火	140,877,244.30	2.70
6	002340	格林美	113,582,055.20	2.18
7	300242	明家联合	112,251,864.06	2.15
8	300367	东方网力	107,131,025.86	2.06
9	002494	华斯股份	106,734,563.22	2.05
10	603799	华友钴业	106,078,779.70	2.04
11	002601	佰利联	106,031,579.06	2.03
12	300033	同花顺	104,030,031.17	2.00
13	000901	航天科技	101,338,666.10	1.94
14	300014	亿纬锂能	101,325,337.03	1.94
15	300364	中文在线	99,246,111.36	1.90
16	300097	智云股份	98,717,908.20	1.89
17	000983	西山煤电	98,164,563.95	1.88
18	300199	翰宇药业	96,931,225.27	1.86
19	600549	厦门钨业	93,622,856.58	1.80
20	600136	当代明诚	93,195,726.17	1.79

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	10,507,838,315.05
卖出股票收入（成交）总额	11,450,020,644.77

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	2,265,356.80	0.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	612,334,000.00	21.80
	其中：政策性金融债	612,334,000.00	21.80
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	614,599,356.80	21.88

## 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	150207	15 国开 07	1,800,000	184,068,000.00	6.55
2	140208	14 国开 08	1,300,000	132,548,000.00	4.72
3	140201	14 国开 01	1,100,000	111,782,000.00	3.98
4	130425	13 农发 25	500,000	52,100,000.00	1.85
5	150416	15 农发 16	500,000	50,000,000.00	1.78

## 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	1,854,377.77
2	应收证券清算款	17,352,722.49
3	应收股利	-
4	应收利息	11,886,481.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,093,581.71

**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	300038	梅泰诺	53,656,592.56	1.91	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
25,004	119,980.80	1,565,444,971.00	52.18%	1,434,555,029.00	47.82%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L—FH002 沪	276,951,089.00	9.23%
2	易方达基金管理有限公司	148,612,662.00	4.95%
3	农银人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	90,420,741.00	3.01%
4	中国人寿保险股份有限公司	79,262,259.00	2.64%
5	泰康人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品—019L—CT001 沪	77,822,157.00	2.59%
6	阳光人寿保险股份有限公司—万能保险产品	56,862,653.00	1.90%
7	建信人寿保险有限公司—普通	56,294,025.00	1.88%
8	泰康人寿保险股份有限公司—万能—一个	53,281,428.00	1.78%



	险万能		
9	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	50,108,070.00	1.67%
10	阳光人寿保险股份有限公司—传统保险产品	48,717,381.00	1.62%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## 9 重大事件揭示

### 9.1 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。

### 9.2 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。

### 9.3 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。

### 9.4 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。

### 9.5 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。

### 9.6 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。

### 9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 9.7.1 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	2	1,394,989,992.14	6.35%	1,299,155.47	6.76%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	292,848,777.52	1.33%	272,731.28	1.42%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	1,156,216,060.80	5.27%	924,970.77	4.81%	-
国联证券	1	713,841,803.45	3.25%	664,799.44	3.46%	-
华龙证券	1	126,047,039.69	0.57%	100,837.63	0.52%	-
国信证券	1	3,393,426,760.65	15.46%	3,160,302.21	16.45%	-
瑞银证券	1	632,612,393.25	2.88%	506,089.85	2.63%	-
天风证券	1	385,782,900.15	1.76%	308,625.43	1.61%	-
华鑫证券	1	683,851,536.00	3.11%	547,080.90	2.85%	-
大通证券	1	841,246,457.50	3.83%	672,996.60	3.50%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

南京证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	155,588,781.36	0.71%	144,899.41	0.75%	-
平安证券	1	1,615,641,084.69	7.36%	1,504,648.58	7.83%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	1,314,803,688.70	5.99%	1,224,474.51	6.37%	-
银河证券	1	341,065,678.24	1.55%	317,633.70	1.65%	-
光大证券	1	1,465,755,986.81	6.68%	1,365,054.54	7.10%	-
中原证券	1	256,446,200.70	1.17%	205,156.84	1.07%	-
东北证券	1	484,298,471.61	2.21%	387,438.70	2.02%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	453,381,769.02	2.07%	422,235.64	2.20%	-
长城证券	1	406,426,721.83	1.85%	378,507.10	1.97%	-
广发证券	1	1,253,455,898.48	5.71%	1,136,191.43	5.91%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	1,691,787,797.63	7.71%	1,353,428.79	7.04%	-
海通证券	1	2,895,127,176.04	13.19%	2,316,098.02	12.05%	-

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、华西证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、瑞银证券有限责任公司、天风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、个股分析的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。

## 9.8 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公司旗下部分	中国证券报、上海证券	2016-01-05

	基金估值调整情况的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
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	2016-01-08
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	2016-01-12
4	科瑞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	2016-01-23
5	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
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	2016-01-29
7	科瑞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	2016-02-02
8	科瑞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	2016-02-25
9	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
10	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购厦门瑞尔特卫浴科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-02
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	2016-03-05
12	科瑞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	2016-03-11
13	科瑞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	2016-03-18
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏赛福天钢索股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-25
15	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

16	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
17	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
18	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
19	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
20	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购南通四方冷链装备股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-12
21	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
22	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	2016-06-01
23	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购上海沪工焊接集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-01
24	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购深圳市盛讯达科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-21

## 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1. 中国证券监督管理委员会《关于同意科瑞证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2001] 59 号文）；

2. 《科瑞证券投资基金基金合同》；

3. 《科瑞证券投资基金托管协议》；

4. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 10.2 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。

### 10.3 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