

易方达价值精选混合型证券投资基金

2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年三月三十一日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	2,715,733,918.43 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
	联系电话	020-85102688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn
客户服务电话	400 881 8088	95588

传真	020-85104666	010-66105798
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-303,688,048.12	2,260,706,915.42	186,658,769.51
本期利润	-862,532,861.06	2,380,216,001.03	369,366,801.15
加权平均基金份额本期利润	-0.3135	0.8896	0.0938
本期基金份额净值增长率	-21.63%	73.24%	9.91%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0301	0.7822	0.0624
期末基金资产净值	2,797,602,615.75	4,006,424,365.59	3,492,515,103.00
期末基金份额净值	1.0301	1.7822	1.0624

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-4.14%	0.78%	1.40%	0.57%	-5.54%	0.21%
过去六个月	-9.46%	0.83%	4.23%	0.61%	-13.69%	0.22%
过去一年	-21.63%	1.77%	-8.35%	1.12%	-13.28%	0.65%
过去三年	49.21%	2.07%	36.56%	1.43%	12.65%	0.64%
过去五年	53.33%	1.77%	37.21%	1.30%	16.12%	0.47%
自基金合同生效起至今	264.74%	1.71%	133.22%	1.51%	131.52%	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

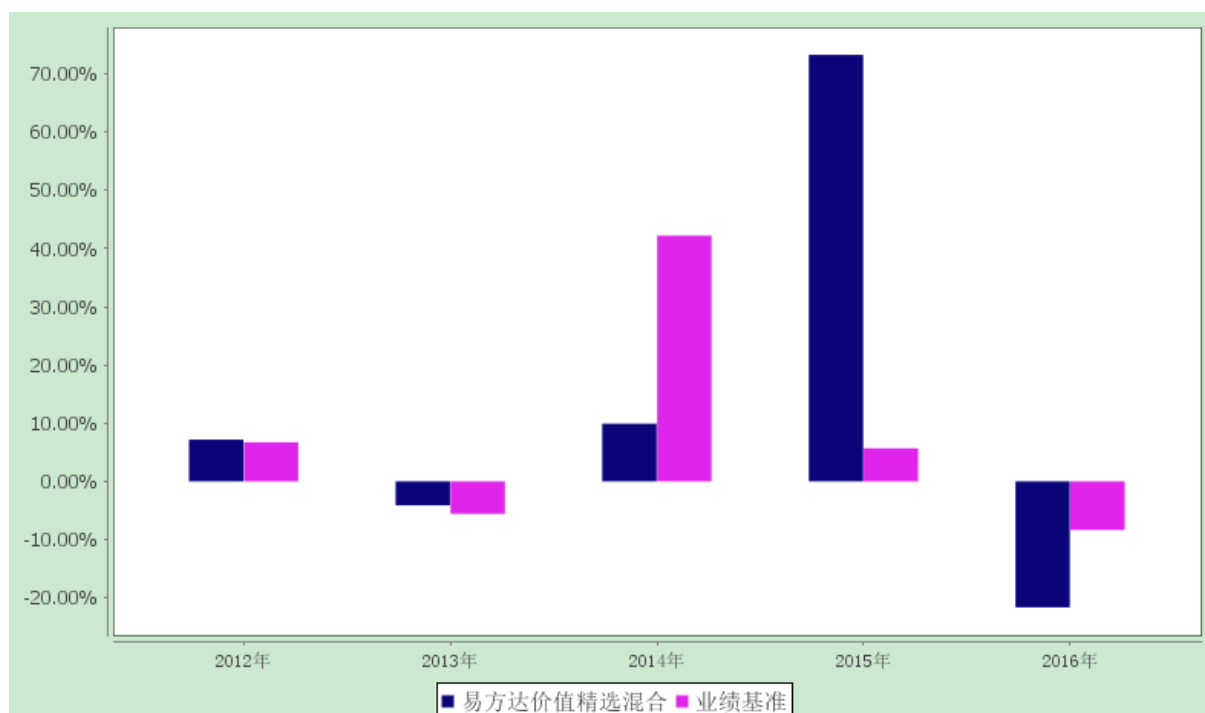
易方达价值精选混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2006年6月13日至2016年12月31日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 264.74%，同期业绩比较基准收益率为 133.22%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达价值精选混合型证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	3.750	246,575,410.77	658,185,316.86	904,760,727.63	-
2015年	0.350	27,946,683.43	84,413,671.09	112,360,354.52	-
2014年	-	-	-	-	-
合计	4.100	274,522,094.20	742,598,987.95	1,017,121,082.15	-

§ 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（简称“易方达”）成立于2001年4月17日，旗下设有北京、广州、上海、成都、大连、南京等六个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。2012 年 10 月，易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016 年 12 月，易方达获得基本养老保险基金证券投资管理机构资格。截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理的各类资产总规模 10491 亿元，其中公募基金规模 4283 亿元，公募基金规模排名连续 12 年保持在行业前五名，服务客户超过 5000 万户，公司净资产 66 亿元，在国内资产管理行业具有领先的市场地位和综合实力。

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、易方达信息产业混合型证券投资基金的基金经理、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、易方达新经济灵活配置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、易方达科翔混合型证券投资基金的基金经理、易方达国防军工混合型证券投资基金的基金经理、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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

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

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

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

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对我司旗下所有投资组合 2016 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 29 次，其中 26 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年 A 股市场整体呈现震荡下跌行情，大盘蓝筹下跌相对较小，中小创下跌幅度较大。2016 年沪深 300 指数下跌 11.28%，上证综指下跌 12.31%，中小盘指数下跌 20.14%，创业板指数下跌 27.71%，创业板综指下跌 20.35%。

从宏观经济层面看，全球经济开始复苏：美国经济增长，欧洲、中国以及日本经济数据有所好转。在美元走强的同时，全球资源价格出现普遍上升，全球流动性拐点也逐步形成。在此大背景下，全球资产价格出现分化，传统产业由于盈利明显好转得到资金的持续流入，而高估值的新兴产业估值收缩压力较大。

从国内流动性层面看，在供给侧改革、汇率贬值和传统行业盈利改善的背景下，PPI 及 CPI 的上行压力显现，国内流动性拐点的预期和整体资本市场的流动性压力正逐步形成。

从实体层面看，在供给侧改革、环保压力以及去产能等多重效应的作用下，工业品价格出现回升，周期性行业盈利能力明显提升。

本基金在 2016 年保持仓位稳定，依然以成长性投资品种为核心仓位，保持了半导体、软件、军工等新兴成长类核心品种的占比，同时适当配置了化工、资源、油气服务等周期性行业。

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 1.0301 元，本报告期份额净值增长率为-21.63%，同期业绩比较基准收益率为-8.35%。

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 2017 年，国内整体流动性趋于平稳偏紧，随着新股发行加快，股市未来的流动性环境也将维持偏紧状态，预计整体市场将逐步分化，与周期性盈利恢复相关的板块将有结构性的机会。

基于以上判断，本基金在 2017 年将保持中性偏低仓位，增加周期性投资品种的配置比例，降低组合的平均估值水平。组合将立足中长期盈利成长性和稳定性的原则进行构建，维持以竞争优势明显、估值合理的稳定成长公司为核心持仓结构，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

根据相关法律法规及《易方达价值精选混合型证券投资基金基金合同》，本基金本报告期不满足分红条件，不进行利润分配；本报告期内 2016 年 1 月 20 日已实施的利润分配 321,910,497.58 元、2016 年 3 月 23 日已实施的利润分配 582,850,230.05 元是对 2015 年度利润进行的分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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精选混合型证券投资基金 2016 年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 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	289,532,851.09	355,096,735.80
结算备付金	7,273,439.88	22,217,235.35
存出保证金	949,380.70	2,544,468.51
交易性金融资产	2,513,751,000.18	3,643,200,091.89
其中：股票投资	2,383,366,728.18	3,461,744,191.89
基金投资	-	-
债券投资	130,384,272.00	181,455,900.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
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
应收利息	1,212,759.33	2,391,293.99
应收股利	-	-

应收申购款	293,263.03	2,376,840.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,813,012,694.21	4,038,596,890.81
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	3,228,581.16	8,459,177.68
应付赎回款	4,069,001.69	5,996,707.44
应付管理人报酬	3,645,577.77	5,087,768.22
应付托管费	607,596.27	847,961.39
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,954,110.49	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	905,211.08	913,274.07
负债合计	15,410,078.46	32,172,525.22
所有者权益:		
实收基金	2,715,733,918.43	2,247,970,245.78
未分配利润	81,868,697.32	1,758,454,119.81
所有者权益合计	2,797,602,615.75	4,006,424,365.59
负债和所有者权益总计	2,813,012,694.21	4,038,596,890.81

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0301 元，基金份额总额

2,715,733,918.43 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-764,430,507.18	2,516,699,355.56
1.利息收入	6,963,193.05	9,229,785.34
其中：存款利息收入	2,976,555.89	2,795,180.43
债券利息收入	3,849,023.16	6,419,258.47
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	137,614.00	15,346.44
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-213,093,457.86	2,385,157,129.77
其中：股票投资收益	-222,559,058.14	2,370,610,861.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-20,240.00	7,822,660.45
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	9,485,840.28	6,723,607.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-558,844,812.94	119,509,085.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	544,570.57	2,803,354.84
减：二、费用	98,102,353.88	136,483,354.53
1. 管理人报酬	46,110,410.52	62,281,038.31

2. 托管费	7,685,068.43	10,380,173.06
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	43,858,775.00	63,358,727.53
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	448,099.93	463,415.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-862,532,861.06	2,380,216,001.03
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-862,532,861.06	2,380,216,001.03

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-862,532,861.06	-862,532,861.06
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）	467,763,672.65	90,708,166.20	558,471,838.85
其中：1.基金申购款	1,003,773,195.39	151,011,063.91	1,154,784,259.30
2.基金赎回款	-536,009,522.74	-60,302,897.71	-596,312,420.45
四、本期向基金份额持	-	-904,760,727.63	-904,760,727.63

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）	2,715,733,918.43	81,868,697.32	2,797,602,615.75
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,287,302,471.57	205,212,631.43	3,492,515,103.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,380,216,001.03	2,380,216,001.03
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）	-1,039,332,225.79	-714,614,158.13	-1,753,946,383.92
其中：1.基金申购款	1,695,897,704.20	1,108,321,660.32	2,804,219,364.52
2.基金赎回款	-2,735,229,929.99	-1,822,935,818.45	-4,558,165,748.44
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）	2,247,970,245.78	1,758,454,119.81	4,006,424,365.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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”。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

(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。

(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；买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有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。

(3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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
广东粤财信托有限公司（以下简称“粤财信托”）	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东

广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	2,572,315,921.68	8.74%	8,951,930,991.68	21.82%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	2,395,598.00	9.09%	386,741.03	13.10%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	8,231,166.38	21.92%	1,626,324.49	14.96%

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

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	46,110,410.52	62,281,038.31
其中：支付销售机构的客户维护费	6,968,052.31	9,295,584.39

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

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年 12月31日	2015年1月1日至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,685,068.43	10,380,173.06

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	289,532,851.09	2,732,381.81	355,096,735.80	2,508,222.21

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。

7.4.8.6 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12月31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	002101	广东鸿图	配股发行	511,779	4,892,607.24
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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
-	-	-	-	-	-

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 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	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

				类型						
002643	万润股份	2016-08-17	2017-08-18	非公开发行流通受限	43.31	36.30	217,530	9,421,224.30	7,896,339.00	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603266	天龙	2016-12-30	2017-01-10	新股	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-

	股份			流通受限						
603660	苏州科达	2016-11-21	2017-12-01	老股转让 流通受限	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股流通 受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603823	百合花	2016-12-09	2017-12-20	老股转让 流通受限	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股流通 受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-

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。

7.4.9.2 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
002156	通富微电	2016-12-28	重大事项停牌	11.38	2017-01-05	11.65	451,080	5,580,662.00	5,133,290.40	-
002260	德奥通航	2016-12-05	重大事项停牌	23.10	-	-	2,629,979	80,190,530.12	60,752,514.90	-
002567	唐人神	2016-12-22	重大事项停牌	12.64	2017-01-03	12.75	263,083	3,180,979.22	3,325,369.12	-
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大事项停牌	23.08	2017-01-06	19.60	332,822	6,309,080.03	7,681,531.76	-
300065	海兰信	2016-12-08	重大事项停牌	38.52	-	-	239,000	9,256,707.90	9,206,280.00	-
300123	太阳鸟	2016-09-28	重大事项停牌	15.08	2017-02-15	16.59	317,629	4,078,243.49	4,789,845.32	-
300223	北京君正	2016-12-19	重大事项停牌	48.40	-	-	634,846	23,314,763.74	30,726,546.40	-
300323	华灿光电	2016-04-18	重大事项停牌	8.99	2017-01-09	8.65	611,200	5,367,781.70	5,494,688.00	-
300537	广信材料	2016-10-12	重大事项停牌	48.79	2017-01-13	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项停牌	177.97	2017-03-13	195.77	270,633	47,873,343.97	48,164,555.01	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.10 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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,200,145,807.31 元，属于第二层次的余额为 313,605,192.87 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,383,366,728.18	84.73
	其中：股票	2,383,366,728.18	84.73
2	固定收益投资	130,384,272.00	4.64
	其中：债券	130,384,272.00	4.64
	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	296,806,290.97	10.55
7	其他各项资产	2,455,403.06	0.09
8	合计	2,813,012,694.21	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	----------	---------------

A	农、林、牧、渔业	27,413,110.00	0.98
B	采矿业	67,855,999.58	2.43
C	制造业	1,679,362,591.63	60.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	7,800,456.50	0.28
F	批发和零售业	70,810,985.62	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	35,974,965.73	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	261,795,164.04	9.36
J	金融业	92,533,151.66	3.31
K	房地产业	103,167,600.00	3.69
L	租赁和商务服务业	6,319,000.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	59,895.03	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	15,180,290.73	0.54
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,055,600.00	0.54
S	综合	-	-
	合计	2,383,366,728.18	85.19

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300365	恒华科技	2,582,501	107,173,791.50	3.83
2	002077	大港股份	5,770,000	103,167,600.00	3.69
3	002384	东山精密	5,145,900	100,911,099.00	3.61
4	002035	华帝股份	3,471,550	90,086,722.50	3.22
5	000333	美的集团	2,228,347	62,772,534.99	2.24
6	600519	贵州茅台	182,500	60,982,375.00	2.18
7	002260	德奥通航	2,629,979	60,752,514.90	2.17

8	002036	联创电子	2,719,272	52,101,251.52	1.86
9	000661	长春高新	441,196	49,347,772.60	1.76
10	603986	兆易创新	270,633	48,164,555.01	1.72

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.efunds.com.cn 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300097	智云股份	162,508,425.06	4.06
2	000858	五 粮 液	152,875,585.71	3.82
3	603799	华友钴业	150,052,211.56	3.75
4	300073	当升科技	139,744,441.10	3.49
5	002643	万润股份	139,078,093.13	3.47
6	600549	厦门钨业	137,906,821.51	3.44
7	002224	三 力 士	135,245,101.65	3.38
8	300458	全志科技	123,169,528.17	3.07
9	300033	同花顺	121,467,976.70	3.03
10	002340	格林美	121,000,251.83	3.02
11	000807	云铝股份	110,478,642.96	2.76
12	300014	亿纬锂能	106,579,489.63	2.66
13	300365	恒华科技	104,530,931.36	2.61
14	000333	美的集团	103,980,949.71	2.60
15	002601	佰利联	103,968,051.48	2.60
16	000933	*ST 神火	103,900,085.15	2.59
17	002428	云南锗业	102,831,677.60	2.57
18	600029	南方航空	98,197,725.13	2.45
19	002456	欧菲光	97,749,885.89	2.44
20	300231	银信科技	93,687,326.67	2.34
21	002077	大港股份	91,554,255.13	2.29
22	600519	贵州茅台	91,219,264.74	2.28
23	600395	盘江股份	88,701,974.28	2.21
24	300236	上海新阳	87,512,455.46	2.18
25	002384	东山精密	85,562,458.75	2.14
26	002371	七星电子	84,668,319.01	2.11
27	600497	驰宏锌锗	82,581,515.90	2.06
28	000983	西山煤电	81,615,170.59	2.04
29	002245	澳洋顺昌	81,279,968.13	2.03

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	194,593,090.21	4.86
2	603799	华友钴业	176,692,949.38	4.41
3	300113	顺网科技	170,494,238.20	4.26
4	300073	当升科技	169,485,561.24	4.23
5	002224	三力士	162,578,716.60	4.06
6	002329	皇氏集团	155,933,638.95	3.89
7	300097	智云股份	150,780,433.65	3.76
8	600549	厦门钨业	136,890,258.14	3.42
9	300014	亿纬锂能	133,073,895.12	3.32
10	000901	航天科技	130,676,499.40	3.26
11	002340	格林美	129,637,703.61	3.24
12	002643	万润股份	128,976,864.60	3.22
13	300199	翰宇药业	128,482,140.07	3.21
14	600391	成发科技	120,840,101.25	3.02
15	300033	同花顺	120,610,365.83	3.01
16	300242	明家联合	113,722,893.71	2.84
17	002494	华斯股份	105,586,736.49	2.64
18	600029	南方航空	104,528,402.24	2.61
19	600392	盛和资源	102,072,177.78	2.55
20	000933	*ST 神火	101,427,572.34	2.53
21	000807	云铝股份	99,169,633.61	2.48
22	000973	佛塑科技	98,155,615.56	2.45
23	002456	欧菲光	97,427,111.60	2.43
24	002428	云南锗业	95,551,096.80	2.38
25	002245	澳洋顺昌	93,070,835.70	2.32
26	600104	上汽集团	90,763,681.68	2.27
27	002101	广东鸿图	88,972,473.74	2.22
28	600395	盘江股份	87,616,576.44	2.19
29	002517	恺英网络	87,490,051.26	2.18
30	002284	亚太股份	86,793,420.50	2.17

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	14,585,364,341.31
卖出股票收入（成交）总额	14,883,328,221.94

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	129,558,000.00	4.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	826,272.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	130,384,272.00	4.66

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019546	16 国债 18	1,300,000	129,558,000.00	4.63
2	132003	15 清控 EB	7,550	826,272.00	0.03

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	949,380.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,212,759.33
5	应收申购款	293,263.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,455,403.06

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132003	15 清控 EB	826,272.00	0.03

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002260	德奥通航	60,752,514.90	2.17	重大事项停牌
2	603986	兆易创新	48,164,555.01	1.72	重大事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
89,322	30,403.86	52,730,238.63	1.94%	2,663,003,679.80	98.06%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	55,058.34	0.0020%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 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	1,003,773,195.39
减：本报告期基金总赎回份额	536,009,522.74
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	2,715,733,918.43
-------------	------------------

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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；于 2016 年 8 月 27 日发布公告，自 2016 年 8 月 27 日起聘任吴欣荣先生担任公司副总经理。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 11 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 100,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	578,658,189.70	1.97%	538,903.20	2.04%	-
招商证券	1	729,960,216.32	2.48%	679,813.31	2.58%	-

华西证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	1,606,089,833.60	5.45%	1,495,752.09	5.67%	-
中信证券	3	5,080,578,464.66	17.26%	4,228,427.31	16.04%	-
中信建投	2	1,022,265,386.08	3.47%	909,396.62	3.45%	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	1,220,712,133.13	4.15%	976,568.57	3.70%	-
东方证券	1	2,051,576,952.11	6.97%	1,910,625.06	7.25%	-
东兴证券	1	218,101,080.30	0.74%	203,120.05	0.77%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	325,143,901.82	1.10%	302,809.54	1.15%	-
申万宏源	1	895,994,629.29	3.04%	834,438.34	3.17%	-
兴业证券	1	1,253,338,188.78	4.26%	1,167,230.39	4.43%	-
平安证券	1	328,661,033.31	1.12%	306,080.96	1.16%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	1,457,019,453.97	4.95%	1,165,614.94	4.42%	-
银河证券	1	372,161,809.32	1.26%	346,593.12	1.31%	-
光大证券	1	612,255,728.14	2.08%	570,189.02	2.16%	-
中泰证券	1	6,221,622,978.74	21.13%	5,669,773.55	21.51%	-
东北证券	1	269,912,348.18	0.92%	215,929.50	0.82%	-
广发证券	2	2,572,315,921.68	8.74%	2,395,598.00	9.09%	-
西南证券	1	809,469,719.06	2.75%	753,856.62	2.86%	-
海通证券	1	1,817,452,943.91	6.17%	1,692,595.70	6.42%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-

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、联讯证券股份有限公司、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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	129,938,900.00	100.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一七年三月三十一日

