易方达亚洲精选股票型证券投资基金

2016 年年度报告

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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(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。

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 6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人 6
2.5 信息披露方式 6
2.6 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介 10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 15
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 15
§6 审计报告 15
6.1 管理层对财务报表的责任 15
6.2 注册会计师的责任 15
6.3 审计意见 16
§7 年度财务报表 16
7.1 资产负债表 16
7.2 利润表 18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 19
7.4 报表附注 20
§8 投资组合报告 43
8.1 期末基金资产组合情况 43
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 44
8.3 期末按行业分类的权益投资组合 44
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 45

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动 48
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 50
8.7 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 50
8.8 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 50
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金融衍生品投资明细 50
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 50
8.11 投资组合报告附注 50
§9 基金份额持有人信息 51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 51
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 52
§10 开放式基金份额变动 52
§11 重大事件揭示 52
11.1 基金份额持有人大会决议 52
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 52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 52
11.4 基金投资策略的改变 52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 52
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 53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 53
11.8 其他重大事件 57
§12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达亚洲精选股票型证券投资基金
基金简称	易方达亚洲精选股票（QDII）
基金主代码	118001
交易代码	118001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 1 月 21 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	833,426,661.32 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于亚洲企业，追求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	本基金将基于对全球及亚洲宏观经济，各类资产的风险与收益水平的综合分析与判断在不同区域和行业间进行积极的资产配置。在构建投资组合方面，本基金坚持价值投资的理念，以自下而上的基本面分析、深入的公司研究、对股票价值的评估作为股票投资的根本依据，辅以自上而下的宏观经济分析、国别/地区因素分析、行业分析，争取获得超越比较基准的回报。固定收益品种与货币市场工具的投资将主要用于回避投资风险、取得稳定回报，同时，保持必要的灵活性，及时把握重大的投资机会。
业绩比较基准	MSCI AC 亚洲除日本指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家/地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家/地区投资的风险。

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	郭明
	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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	无	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		无	香港中环德辅道中四至四 A 号渣打银行大厦 32 楼
办公地址		无	香港九龙观塘光观塘路三百八十八号渣打中心 15 楼
邮政编码		无	无

2.5 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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、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	-97,542,919.50	-246,177,234.48	-3,530,980.03
本期利润	-57,977,697.21	-355,185,004.12	-3,215,732.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0660	-0.3063	-0.0235
本期加权平均净值利润率	-9.26%	-35.28%	-2.97%
本期基金份额净值增长率	-7.70%	0.13%	-0.63%
3.1.2 期末数据和指标	**2016 年末**	**2015 年末**	**2014 年末**
期末可供分配利润	-452,902,987.34	-396,597,746.66	-68,396,659.03
期末可供分配基金份额利润	-0.5434	-0.4322	-0.2167
期末基金资产净值	609,348,526.67	727,047,736.49	249,769,552.48
期末基金份额净值	0.731	0.792	0.791
3.1.3 累计期末指标	**2016 年末**	**2015 年末**	**2014 年末**
基金份额累计净值增长率	-26.90%	-20.80%	-20.90%

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
过去三个月	-3.69%	0.96%	-2.81%	0.83%	-0.88%	0.13%
过去六个月	4.58%	1.05%	6.49%	0.85%	-1.91%	0.20%
过去一年	-7.70%	1.34%	10.05%	0.97%	-17.75%	0.37%
过去三年	-8.17%	2.00%	6.94%	0.92%	-15.11%	1.08%
过去五年	-5.31%	1.68%	23.54%	0.94%	-28.85%	0.74%
自基金合同生效起至今	-26.90%	1.61%	7.02%	1.07%	-33.92%	0.54%

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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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

（2010 年 1 月 21 日至 2016 年 12 月 31 日）

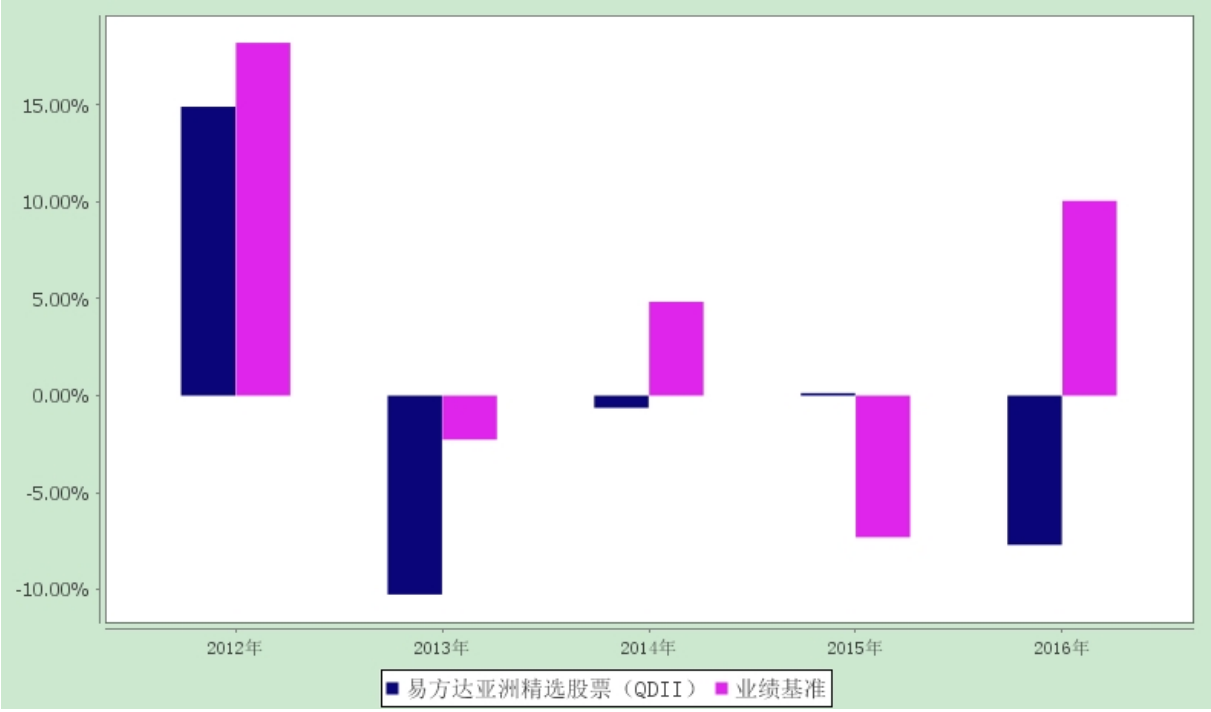
注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-26.90%，同期业绩比较基准收益率为7.02%。

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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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

本基金过去三年未发生利润分配。

§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		
张坤	本基金的基金经理、易方达中小盘混合型证券投资基金的基金经理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2014-04-08	-	8 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金投资部基金经理助理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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和分配机制，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。

对于公司旗下基金在境外的投资交易行为，公司制定了相应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，并结合境外市场的交易特点规范交易委托方式，以尽可能确保公平对待各投资组合。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

全年来看，美国经济呈现逐步复苏的态势，美联储在年末进行了加息。然而，全球其他主要经济体的复苏却不明显。中国方面，货币政策方面，上半年整体较为宽松，央行在 3 月份宣布下调金融机构人民币存款准备金率 0.5 个百分点。二季度后，受人民币汇率和国内实际负利率的制约，央行主要通过逆回购方式投放流动性，流动性整体保持中性。年末由于债券市场去杠杆，出现了阶段的流动性紧张。财政政策方面，全年总体较为积极，基建项目的规划和审批保持较快的速度。宏观经济方面，商品房市场的热销拉动房地产投资恢复，带动经济企稳，工业品进入新一轮补库存周期。

本基金的股票仓位基本稳定，并对结构进行了调整。市场配置方面，维持了香港市场较高的配置比例。行业方面，增加了汽车、金融等行业的配置，降低了环保、医药等行业的配置。个股方面，增加了业务模式有特色、估值水平合理的中小市值公司的投资比例。

4.5.2 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 0.731 元，本报告期份额净值增长率为-7.70%，同期业绩比较基准收益率为 10.05%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球来看，除美国经济出现明显复苏外，其他主要经济体的经济复苏并不显著，全球流动性在中期仍将保持较为宽松的水平。然而对美国市场来说，其估值水平已达到近几年的较高水平，企业的 ROE 也处于高位，在这种情况下，更宜寻找美国以外市场的超额收益机会。中国经济的尾部风险已经基本消除，香港市场中国公司的估值从纵向和横向来看均属于很低的水平。在这种风险收益背景下适宜积极寻找投资机会，特别是一些经营模式有特色的中小市值公司。长期来看，国内资金的海外资产配置需求不断加强，二季度以来“港股通”交易额度的使用明显加快，届时香港优质公司有望迎来增量资金，有助于改善其流动性和估值水平。

在此背景下，本基金计划采取攻守均衡的策略，力求以精选行业和个股为根本来获取超额收

益。行业方面，选择市场空间广阔、竞争格局稳定的行业；个股方面，重点选择长期逻辑清晰、竞争壁垒高和管理优秀的两类企业：一是经过时间考验的行业龙头公司，二是经营模式有特色的中小公司。通过分享这些优秀企业的成长为投资者带来回报。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控内幕交易等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

（1）结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，及时贯彻落实新法规及新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

（2）严守合规底线、管好合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，完善信息隔离和利益冲突管理制度机制。

（3）继续坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具、新投资策略的推出和应用，重点加强了对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、研究、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保了旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

（4）对投研交易、销售宣传、客户服务、人员规范、运营及IT治理、反洗钱等方面开展了一系列专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，推动公司合规、内控体系的健全完善。

（5）积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

（6）督促落实销售适当性管理制度，推动完善销售规范及客户投诉处理机制流程，保障投资者合法权益。

（7）深入贯彻“风险为本”的监管精神，持续完善制度流程，探索建立风险识别、评估、预警和控制一体化的洗钱风险防控体系，推动提升客户身份识别工作水平，强化可疑交易监测分析，做好反洗钱宣传培训、系统研发、内部审计、信息报送等各项工作。

（8）紧跟法规、市场变化和业务发展，持续优化完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、完整、准确、及时、规范。

（9）不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，使合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性得到提升。

2016 年，公司获得 ISAE3402（《国际鉴证业务准则 3402 号》）无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告，鉴证日期区间为 2014 年 7 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。同时，公司通过了 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。通过开展上述外部审计鉴证及验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.8 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。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对易方达亚洲精选股票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，易方达亚洲精选股票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亚洲精选股票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，易方达亚洲精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

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亚洲精选股票型证券投资基金 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

普华永道中天审字(2017)第 20708 号

易方达亚洲精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的易方达亚洲精选股票型证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是易方达亚洲精选股票型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但

目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述易方达亚洲精选股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)　注册会计师　陈玲　周祎

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2017-03-24

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	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	7.4.7.1	39,378,752.90	45,280,335.62
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	568,948,257.57	681,854,235.54
其中：股票投资		568,948,257.57	681,854,235.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,378,062.19	6,848,389.31
应收利息	7.4.7.5	1,569.74	879.16
应收股利		-	904,802.40
应收申购款		230,568.36	899,591.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		**610,937,210.76**	**735,788,233.08**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	6.96
应付赎回款		250,818.07	7,110,585.99
应付管理人报酬		778,481.04	912,616.61
应付托管费		181,645.59	212,943.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	11,994.14	57,545.69
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	365,745.25	446,797.46
负债合计		**1,588,684.09**	**8,740,496.59**
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	833,426,661.32	917,604,744.60
未分配利润	7.4.7.10	-224,078,134.65	-190,557,008.11
所有者权益合计		**609,348,526.67**	**727,047,736.49**
负债和所有者权益总计		**610,937,210.76**	**735,788,233.08**

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.731 元，基金份额总额 833,426,661.32 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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	附注号	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
一、收入		**-44,892,403.93**	**-327,199,463.61**
1.利息收入		56,130.64	284,874.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	56,130.64	284,874.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-87,586,625.26	-211,745,351.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-97,619,485.61	-284,491,700.46
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	55,302,410.79
股利收益	7.4.7.16	10,032,860.35	17,443,937.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	39,565,222.29	-109,007,769.64

4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		2,948,025.75	-9,070,453.77
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	124,842.65	2,339,237.01
减：二、费用		**13,085,293.28**	**27,985,540.51**
1．管理人报酬		9,397,545.15	14,684,928.88
2．托管费		2,192,760.57	3,426,483.48
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	1,041,978.64	9,050,078.88
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	7.4.7.20	453,008.92	824,049.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-57,977,697.21**	**-355,185,004.12**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-57,977,697.21**	**-355,185,004.12**

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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）	917,604,744.60	-190,557,008.11	727,047,736.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-57,977,697.21	-57,977,697.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-84,178,083.28	24,456,570.67	-59,721,512.61

值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	85,216,517.29	-24,500,449.74	60,716,067.55
2.基金赎回款	-169,394,600.57	48,957,020.41	-120,437,580.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	833,426,661.32	-224,078,134.65	609,348,526.67

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）	315,600,999.47	-65,831,446.99	249,769,552.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-355,185,004.12	-355,185,004.12
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）	602,003,745.13	230,459,443.00	832,463,188.13
其中：1.基金申购款	2,794,516,988.36	-44,828,763.68	2,749,688,224.68
2.基金赎回款	-2,192,513,243.23	275,288,206.68	-1,917,225,036.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	917,604,744.60	-190,557,008.11	727,047,736.49

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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1064 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的批复》和证监许可[2009]367 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的批复》核准，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《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2010 年 1 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 592,067,217.31 份基金份额，其中认购资金利息折合 107,302.70 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，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，境外资产托管人为渣打银行（香港）有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资（包括普通股、存托凭证和优先股等）、基金投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资（包括普通股、存托凭证和优先股等）、基金投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于收到基金申购或基金赎回确认数据当日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资（包括普通股、存托凭证和优先股等）和基金投资在持有期间应取得的现金股利及基金分红收益扣除适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

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

(3) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

(4) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照

20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	39,378,752.90	45,280,335.62
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	39,378,752.90	45,280,335.62

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		637,231,681.38	568,948,257.57	-68,283,423.81
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		637,231,681.38	568,948,257.57	-68,283,423.81
项目		上年度末		

		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		789,702,881.64	681,854,235.54	-107,848,646.10
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		789,702,881.64	681,854,235.54	-107,848,646.10

注："股票"包括普通股、存托凭证和优先股等。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,569.74	879.16
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	-	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-

其他	-	-
合计	1,569.74	879.16

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	11,994.14	57,545.69
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	11,994.14	57,545.69

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	745.25	26,797.46
预提费用	365,000.00	420,000.00
合计	365,745.25	446,797.46

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	917,604,744.60	917,604,744.60
本期申购	85,216,517.29	85,216,517.29
本期赎回（以“-”号填列）	-169,394,600.57	-169,394,600.57
本期末	833,426,661.32	833,426,661.32

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	-396,597,746.66	206,040,738.55	-190,557,008.11
本期利润	-97,542,919.50	39,565,222.29	-57,977,697.21
本期基金份额交易产生的变动数	41,237,678.82	-16,781,108.15	24,456,570.67
其中：基金申购款	-40,555,971.87	16,055,522.13	-24,500,449.74
基金赎回款	81,793,650.69	-32,836,630.28	48,957,020.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-452,902,987.34	228,824,852.69	-224,078,134.65

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	55,122.51	276,880.21
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	955.85	2,081.95
其他	52.28	5,912.37
合计	56,130.64	284,874.53

7.4.7.12 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	337,775,990.37	2,177,093,446.40
减：卖出股票成本总额	435,395,475.98	2,461,585,146.86
买卖股票差价收入	-97,619,485.61	-284,491,700.46

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	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
卖出权证成交总额	-	55,302,410.79
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	-	55,302,410.79

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	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
股票投资产生的股利收益	10,032,860.35	17,443,937.93
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	10,032,860.35	17,443,937.93

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	39,565,222.29	-109,007,769.64
——股票投资	39,565,222.29	-109,007,769.64
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-

合计	39,565,222.29	-109,007,769.64

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	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
基金赎回费收入	124,842.65	2,339,237.01
其他	-	-
合计	124,842.65	2,339,237.01

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	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
交易所市场交易费用	1,041,978.64	9,050,078.88
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,041,978.64	9,050,078.88

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	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
审计费用	65,000.00	120,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	3,840.04	13,591.11
银行间账户维护费	6,000.00	18,000.00
其他	78,168.88	372,458.16
合计	453,008.92	824,049.27

注："其他"主要包含支付给交易所的结算服务费用和存托凭证托管机构的存托服务费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

2017 年 1 月 6 日财政部、国家税务总局颁布了《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，就其于 2016 年 12 月 21 日颁布的《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)中关于“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人”的规定做出补充通知，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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
渣打银行（香港）有限公司(以下简称"渣打银行")	境外资产托管人
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、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
广东省易方达教育基金会	基金管理人发起的教育基金会
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 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	9,397,545.15	14,684,928.88
其中：支付销售机构的客户维护费	1,463,526.65	2,083,258.38

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.5%÷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

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 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	2,192,760.57	3,426,483.48

注：本基金的托管费（包括境外托管费）按前一日基金资产净值的 0.35%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.35%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
报告期初持有的基金份额	222,261,977.48	249,064,757.16
报告期间申购/买入总份额	-	103,197,220.32
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	130,000,000.00
报告期末持有的基金份额	222,261,977.48	222,261,977.48
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	26.67%	24.22%

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。

7.4.10.4.2 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 12 月 31 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
广东省易方达教育基金会	20,160,282.26	2.42%	20,160,282.26	2.20%

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。

7.4.10.5 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	6,550,687.78	47,274.11	13,436,308.94	263,657.72

渣打银行	32,828,065.12	7,848.40	31,844,026.68	13,222.49

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和渣打银行（香港）有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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
940 HK	中国动物保健品	2015-03-27	重大事项停牌	4.65	-	-	850,000	3,230,137.15	3,953,734.20	-
967 HK	桑德国际	2016-04-12	重大事项停牌	2.67	-	-	300,000	1,741,184.48	799,691.94	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

本基金属股票基金，投资于股票及其他权益类证券占基金资产的比例不低于６０％，其中投资于在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外），合计不低于股票资产的８０％（亚洲企业指注册登记或者总部在亚洲的企业）。理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家／地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家／地区投资的风险。

7.4.13.2 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（本基金为进行避险和组合的有效管理可以投资衍生品）,或者基金所投资证券之发行人出现违约（包括国家信用风险）、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投资备选库制度和交易对手备选库制度及分散化投资方式防范信用风险。于 2016 年 12 月 31 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%。

7.4.13.2.1 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12月31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	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、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。

7.4.13.2.2 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12月31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	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金在短时间内购买以及售出金融工具，成交价格较远地偏离了真实价值。当某国／地区的资本市场规模较小，金融市场不发达，某金融品种流通市值较低，参与机构数量较少，成交不活跃，以及基金需要在短时间内进行大量交易时，有可能发生流动性风险，导致基金难以快速建仓，或在出现大额赎回时，被迫在不利价格大量抛售证券，使基金净值遭受不利影响。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,主要投资的交易所流动性较好，因此本基金面临的流动性风险较小。

7.4.13.4 市场风险

本基金投资于海外市场，面临市场波动带来的风险。影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等，都将影响基金净值的升跌。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**

日					
资产					
银行存款	39,378,752.90	-	-	-	39,378,752.90
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	568,948,257.57	568,948,257.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	2,378,062.19	2,378,062.19
应收利息	-	-	-	1,569.74	1,569.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	396.75	-	-	230,171.61	230,568.36
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,379,149.65	-	-	571,558,061.11	610,937,210.76
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	-	-	-	250,818.07	250,818.07
应付管理人报酬	-	-	-	778,481.04	778,481.04
应付托管费	-	-	-	181,645.59	181,645.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	11,994.14	11,994.14
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	365,745.25	365,745.25
负债总计	-	-	-	1,588,684.09	1,588,684.09
利率敏感度缺口	39,379,149.65	-	-	569,969,377.02	609,348,526.67

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	45,280,335.62	-	-	-	45,280,335.62
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	681,854,235.54	681,854,235.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	6,848,389.31	6,848,389.31
应收利息	-	-	-	879.16	879.16
应收股利	-	-	-	904,802.40	904,802.40
应收申购款	12,424.03	-	-	887,167.02	899,591.05
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	45,292,759.65	-	-	690,495,473.43	735,788,233.08
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	-	-	-	6.96	6.96
应付赎回款	-	-	-	7,110,585.99	7,110,585.99
应付管理人报酬	-	-	-	912,616.61	912,616.61
应付托管费	-	-	-	212,943.88	212,943.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	57,545.69	57,545.69
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	446,797.46	446,797.46
负债总计	-	-	-	8,740,496.59	8,740,496.59
利率敏感度缺口	45,292,759.65	-	-	681,754,976.84	727,047,736.4

					9

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。

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	-	-
	2.市场利率上升 25 个基点	-	-

注：本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	72,212.23	32,757,036.93	41.50	32,829,290.66
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	61,796,599.62	507,151,657.95	-	568,948,257.57
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	2,378,062.19	-	2,378,062.19
应收利息	0.21	13.65	0.07	13.93
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	61,868,812.06	542,286,770.72	41.57	604,155,624.35

以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	61,868,812.06	542,286,770.72	41.57	604,155,624.35

项目	上年度末 2015年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	15,742.56	41,882,739.74	39.98	41,898,522.28
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	18,937,285.68	662,916,949.86	-	681,854,235.54
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	6,848,389.31	-	6,848,389.31
应收利息	-	2.79	0.01	2.80
应收股利	-	904,802.40	-	904,802.40
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	18,953,028.24	712,552,884.10	39.99	731,505,952.33
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	18,953,028.24	712,552,884.10	39.99	731,505,952.33

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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	上年度末

		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-30,207,781.22	-35,780,244.40
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	30,207,781.22	35,780,244.40

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	568,948,257.57	93.37	681,854,235.54	93.78
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	568,948,257.57	93.37	681,854,235.54	93.78

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	28,447,412.83	34,092,711.71
	2.业绩比较基准下降 5%	-28,447,412.83	-34,092,711.71

7.4.14 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 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 564,194,831.43 元，属于第二层次的余额为 4,753,426.14 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 674,046,125.94 元，第二层次 7,808,109.60 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	568,948,257.57	93.13
	其中：普通股	507,151,657.95	83.01
	存托凭证	61,796,599.62	10.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	39,378,752.90	6.45
8	其他各项资产	2,610,200.29	0.43
9	合计	610,937,210.76	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
香港	507,151,657.95	83.23
美国	61,796,599.62	10.14

合计	568,948,257.57	93.37

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	30,089,885.18	4.94
工业	106,087,902.04	17.41
非必需消费品	92,401,093.98	15.16
必需消费品	-	-
保健	95,267,998.53	15.63
金融	106,771,987.08	17.52
信息技术	137,529,698.82	22.57
电信服务	-	-
公用事业	799,691.94	0.13
合计	568,948,257.57	93.37

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Dongjiang Environmental Co. Ltd.	东江环保股份有限公司	895 HK	香港证券交易所	香港	4,550,000	54,945,276.75	9.02
2	Guangzhou Automobile Group Co., Ltd.	广州汽车集团股份有限公司	2238 HK	香港证券交易所	香港	6,450,000	54,118,749.51	8.88
3	Haitong International Securities	海通证券股份有限公司	665 HK	香港证券交易所	香港	11,200,000	44,582,378.40	7.32

	Group Ltd.							
4	Guangdong Yueyun Transportation Co. Ltd.	广东粤运交通股份有限公司	3399 HK	香港证券交易所	香港	10,350,000	38,976,931.49	6.40
5	ASM Pacific Technology Ltd.	-	522 HK	香港证券交易所	香港	480,000	35,272,318.32	5.79
6	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	金蝶国际软件集团有限公司	268 HK	香港证券交易所	香港	12,500,000	32,649,615.00	5.36
7	Poly Culture Group Corporation Ltd.	保利文化集团股份有限公司	3636 HK	香港证券交易所	香港	1,900,000	32,155,845.48	5.28
8	Guotai Junan International Holdings Ltd.	国泰君安国际控股有限公司	1788 HK	香港证券交易所	香港	15,000,000	32,068,183.50	5.26
9	Alibaba Group Holding Ltd.	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	52,000	31,675,174.44	5.20
10	Noah Holdings Ltd.	诺亚控股有限公司	NOAH US	纽约证券交易所	美国	198,000	30,121,425.18	4.94
11	Bloomage BioTechnology Corporation Ltd.	华熙生物科技有限公司	963 HK	香港证券交易所	香港	2,880,000	30,089,885.18	4.94
12	Technovator International Ltd.	同方泰德国际科技有限公司	1206 HK	香港证券交易所	香港	8,500,000	22,505,871.60	3.69
13	YiChang	宜昌东阳	1558 HK	香港证	香港	1,500,000	20,797,357.50	3.41

	HEC ChangJiang Pharmaceutical Co., Ltd.	光长江药业股份有限公司		券交易所				
14	Beijing Tong Ren Tang Chinese Medicine Co. Ltd.	北京同仁堂国药有限公司	8138 HK	香港证券交易所	香港	2,200,000	20,623,822.56	3.38
15	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	丽珠医药集团股份有限公司	1513 HK	香港证券交易所	香港	427,000	17,340,791.96	2.85
16	TravelSky Technology Ltd.	中国民航信息网络股份有限公司	696 HK	香港证券交易所	香港	900,000	13,122,461.70	2.15
17	Shanghai Prime Machinery Co. Ltd.	上海集优机械股份有限公司	2345 HK	香港证券交易所	香港	8,800,000	10,784,212.56	1.77
18	United Laboratories International Holdings Ltd.	联邦制药国际控股有限公司	3933 HK	香港证券交易所	香港	2,200,000	10,390,628.16	1.71
19	China Grand Pharmaceutical and Healthcare Holdings Ltd.	远大医药健康控股有限公司	512 HK	香港证券交易所	香港	6,960,000	9,463,200.19	1.55
20	Lee's Pharmaceutical Holdings Ltd.	李氏大药厂控股有限公司	950 HK	香港证券交易所	香港	1,200,000	6,741,027.36	1.11

21	Essex Bio-technology Ltd.	亿胜生物科技有限公司	1061 HK	香港证券交易所	香港	2,000,000	5,957,436.60	0.98
22	China Animal Healthcare Ltd.	中国动物保健品有限公司	940 HK	香港证券交易所	香港	850,000	3,953,734.20	0.65
23	Brilliance China Automotive Holdings Ltd.	华晨中国汽车控股有限公司	1114 HK	香港证券交易所	香港	350,000	3,343,678.38	0.55
24	Haichang Ocean Park Holdings Ltd.	海昌海洋公园控股有限公司	2255 HK	香港证券交易所	香港	1,700,000	2,782,820.61	0.46
25	Tencent Holdings Ltd.	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	香港	10,000	1,696,885.47	0.28
26	Guangshen Railway Co. Ltd.	广深铁路股份有限公司	525 HK	香港证券交易所	香港	330,000	1,381,481.24	0.23
27	Sound Global Ltd.	桑德国际有限公司	967 HK	香港证券交易所	香港	300,000	799,691.94	0.13
28	Sunny Optical Technology (Group) Co. Ltd.	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港证券交易所	香港	20,000	607,372.29	0.10

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）

1	Alibaba Group Holding Ltd.	BABA US	34,283,014.25	4.72
2	ASM Pacific Technology Ltd.	522 HK	31,885,220.86	4.39
3	Chinasoft International Ltd.	354 HK	29,993,843.10	4.13
4	Noah Holdings Ltd.	NOAH US	21,266,250.35	2.93
5	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co., Ltd.	1558 HK	20,033,965.37	2.76
6	Kingsoft Corporation Ltd.	3888 HK	18,054,598.16	2.48
7	Livzon Pharmaceutical Group Inc.	1513 HK	17,749,026.41	2.44
8	TravelSky Technology Ltd.	696 HK	13,925,572.49	1.92
9	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	268 HK	11,923,826.34	1.64
10	Technovator International Ltd.	1206 HK	10,829,014.66	1.49
11	China Southern Airlines Co. Ltd.	1055 HK	7,908,920.13	1.09
12	Qihoo 360 Technology Company Ltd.	QIHU US	6,920,249.33	0.95
13	YY inc.	YY US	6,746,827.40	0.93
14	21Vianet Group, Inc.	VNET US	6,310,040.28	0.87
15	Wisdom Sports Group	1661 HK	5,819,042.04	0.80
16	Digital China Holdings Ltd.	861 HK	5,459,311.72	0.75
17	China Industrial Securities Int'l Financial Group Ltd.	8407 HK	3,461,205.30	0.48
18	Brilliance China Automotive Holdings Ltd.	1114 HK	3,272,011.51	0.45
19	United Laboratories International Holdings Ltd.	3933 HK	2,849,920.89	0.39
20	Haichang Ocean Park Holdings Ltd.	2255 HK	2,825,032.17	0.39

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Kingsoft Corporation Ltd.	3888 HK	56,878,619.07	7.82
2	Cogobuy Group	400 HK	39,298,370.32	5.41

3	Chinasoft International Ltd.	354 HK	32,564,205.50	4.48
4	Poly Culture Group Corporation Ltd.	3636 HK	23,961,245.86	3.30
5	Hua Han Health Industry Holdings Ltd.	587 HK	21,860,959.01	3.01
6	Sinosoft Technology Group Ltd.	1297 HK	17,736,583.81	2.44
7	Dongjiang Environmental Co. Ltd.	895 HK	16,490,619.58	2.27
8	Shanghai Prime Machinery Co. Ltd.	2345 HK	14,376,439.59	1.98
9	China Southern Airlines Co. Ltd.	1055 HK	10,256,004.97	1.41
10	Dynagreen Environmental Protection Group Co., Ltd.	1330 HK	9,529,003.51	1.31
11	Qihoo 360 Technology Company Ltd.	QIHU US	7,733,995.50	1.06
12	Digital China Holdings Ltd.	861 HK	7,706,752.92	1.06
13	China Cinda Asset Management Co., Ltd.	1359 HK	7,243,584.48	1.00
14	Kingdee International Software Group Co. Ltd.	268 HK	6,448,807.74	0.89
15	YY Inc.	YY US	6,284,360.85	0.86
16	Lansen Pharmaceutical Holdings Ltd.	503 HK	6,174,547.59	0.85
17	Technovator International Ltd.	1206 HK	5,407,750.73	0.74
18	Bloomage BioTechnology Corporation Ltd.	963 HK	5,301,885.24	0.73
19	Cheetah Mobile Inc.	CMCM US	4,163,318.04	0.57
20	Wisdom Sports Group	1661 HK	4,058,213.84	0.56

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	282,924,275.72
卖出收入（成交）总额	337,775,990.37

注："买入成本"或"卖出收入"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。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 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。

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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	2,378,062.19
3	应收股利	-
4	应收利息	1,569.74
5	应收申购款	230,568.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,610,200.29

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金可以将不高于 20%的股票资产投资于除在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外）之外的其他企业，本报告期末该部分股票的投资比例为 0。

§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
19,159	43,500.53	272,730,507.16	32.72%	560,696,154.16	67.28%

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	7,861,017.21	0.9432%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§10开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010 年 1 月 21 日)基金份额总额	592,067,217.31
本报告期期初基金份额总额	917,604,744.60
本报告期基金总申购份额	85,216,517.29
减：本报告期基金总赎回份额	169,394,600.57
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额	833,426,661.32

§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

本报告期内本基金的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 7 年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务，本报告年度的审计费用为 65,000.00 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	
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	144,889,157.97	23.64%	115,911.31	24.58%	-
China	1	93,470,405.80	15.25%	74,776.24	15.86%	-

Merchants Securities (HK) Co Ltd						
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	1	74,901,719.17	12.22%	59,921.37	12.71%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	115,522,068.13	18.85%	56,079.10	11.89%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	13,451,724.32	2.19%	44,602.58	9.46%	-
UBS Securities Asia Limited	1	25,578,976.91	4.17%	25,578.99	5.42%	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	45,672,371.29	7.45%	22,836.24	4.84%	-
Goldman Sachs	1	22,974,838.78	3.75%	18,379.92	3.90%	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	34,505,465.11	5.63%	17,252.79	3.66%	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	1	13,908,680.00	2.27%	13,908.70	2.95%	-
Sanford C. Bernstein (H.K.) Limited	1	12,029,853.19	1.96%	9,623.90	2.04%	-
银河证券	1	5,957,132.75	0.97%	4,765.70	1.01%	-
国信证券	1	5,898,840.11	0.96%	4,719.08	1.00%	-
长江证券	1	3,136,702.83	0.51%	2,509.36	0.53%	-
KGI Institutional Equities	1	1,068,333.31	0.17%	747.82	0.16%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
Shin Han Investment Corp.	1	-	-	-	-	-
Hyundai	1	-	-	-	-	-

Securities (Asia) Limited						
Daishin Securities (Asia) Ltd	1	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG London	1	-	-	-	-	-
Nomura Asset Management HongKong Limited	1	-	-	-	-	-
CLSA Limited	1	-	-	-	-	-
Mirae Asset Securities Co., Ltd	1	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Knight Capital Europe Limited	1	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
BOBOM International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Daewoo Securities	1	-	-	-	-	-
Woori Investment & Securities	1	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Ltd.	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金无减少交易账户，于如下证券经营机构 KGI Institutional Equities、Sanford C. Bernstein (H.K.) Limited 各新增一个交易账户。

b）本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下：

1）交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2）研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3）提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4）法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5）价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6）其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c）基金交易账户的选择程序如下：

1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2）基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Institutional Equities	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
Shin Han Investment Corp.	-	-	-	-	-	-	-	-
Hyundai Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Daishin Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG London	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura Asset Management HongKong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Mirae Asset Securities Co., Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Knight Capital Europe Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BOBOM	-	-	-	-	-	-	-	-

International Securities Limited								
Daewoo Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Woori Investment & Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年 1 月 18 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-13
2	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
3	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
4	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
5	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年 2 月 15 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-03
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加汇付金融为销售机构、参加汇付金融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	2016-03-03
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加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
8	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
9	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年 3 月 25 日和 3 月 28 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-22
10	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	2016-03-25

		理人网站	
11	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
12	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
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宁波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	2016-04-08
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加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
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
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中国邮政储蓄银行为销售机构、参加中国邮政储蓄银行定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-22
17	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
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-28
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放	中国证券报、上海证券	2016-05-13

	式基金参加民生银行直销银行申购费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
25	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
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
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加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
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加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
29	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
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加钱景财富为销售机构、参加钱景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	2016-06-01
31	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鑫鼎盛为销售机构、参加鑫鼎盛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	2016-06-22
32	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加余杭农村商业银行为销售机构、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
33	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-28
34	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
35	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
36	易方达基金管理有限公司关于在陆金所资管开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务、参加陆金所资管定期定额投资费率优惠活动的的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-01
37	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	2016-07-07

	式基金增加苏宁基金为销售机构、参加苏宁基金申购费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
38	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信证券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	2016-07-26
39	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加嘉兴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	2016-07-28
40	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年 8 月 2 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-08-03
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途牛金服为销售机构、参加途牛金服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	2016-08-05
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万得投顾为销售机构、参加万得投顾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	2016-08-12
43	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	2016-08-27
44	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购、转换转入及定期定额投资的金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-01
45	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原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	2016-09-19
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交通银行手机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	2016-09-20
47	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年 10 月 10 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-28
48	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与广发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	2016-09-30
49	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与深圳新兰德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	2016-10-21
50	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年 10 月 21 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-10-22
51	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	2016-11-04

	式基金增加弘业期货为销售机构的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
52	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加和讯信息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	2016-11-18
53	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加汇成基金为销售机构、参加汇成基金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-11-21
54	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加吉林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	2016-11-23
55	关于易方达亚洲精选股票型证券投资基金在非直销销售机构及网上直销系统暂停大额申购及大额转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-11-24
56	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手机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	2016-11-29
57	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	2016-12-01
58	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2016 年 12 月 26 日至 2016 年 12 月 27 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-21
59	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手机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	2016-12-22
60	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加佛山农商银行为销售机构、参加佛山农商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	2016-12-26
61	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加凯石财富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	2016-12-27
62	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东莞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	2016-12-30
63	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加苏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	2016-12-30
64	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“2017 倾心回馈”基金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	2016-12-30
65	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	2016-12-30

	式基金参加中国农业银行费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
66	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邮政储蓄银行个人网上银行和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	2016-12-30
67	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加南洋商业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	2016-12-31

§12备查文件目录

12.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的文件；

2.中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的文件；

3.《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.《易方达亚洲精选股票型证券投资基金托管协议》；

6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇一七年三月三十一日