

# 易方达价值成长混合型证券投资基金

## 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 .....	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、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2	基金净值表现 .....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	9
§ 4	管理人报告 .....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
§ 5	托管人报告 .....	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	15
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 .....	16
6.1	管理层对财务报表的责任 .....	16
6.2	注册会计师的责任 .....	16
6.3	审计意见 .....	16
§ 7	年度财务报表 .....	17
7.1	资产负债表 .....	17
7.2	利润表 .....	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	20
7.4	报表附注 .....	21
§ 8	投资组合报告 .....	45
8.1	期末基金资产组合情况 .....	45
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
8.3	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 .....	47
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
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 .....	51

8.7	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 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
8.12	投资组合报告附注 .....	51
§ 9	基金份额持有人信息 .....	52
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
§ 10	开放式基金份额变动 .....	53
§ 11	重大事件揭示 .....	53
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
11.4	基金投资策略的改变 .....	54
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
11.8	其他重大事件 .....	57
§ 12	备查文件目录 .....	64
12.1	备查文件目录 .....	64
12.2	存放地点 .....	64
12.3	查阅方式 .....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达价值成长混合型证券投资基金
基金简称	易方达价值成长混合
基金主代码	110010
交易代码	110010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 4 月 2 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,677,391,428.64 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	张南	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 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	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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

#### 2.5 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	-1,072,518,107.72	7,374,827,646.53	2,658,813,776.43

本期利润	-2,094,583,464.08	6,883,808,370.50	-180,875,216.56
加权平均基金份额本期利润	-0.5461	1.3231	-0.0166
本期加权平均净值利润率	-35.10%	68.34%	-1.38%
本期基金份额净值增长率	-26.01%	67.65%	0.13%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
期末可供分配利润	1,848,788,517.45	4,435,510,711.93	2,316,280,088.19
期末可供分配基金份额利润	0.5027	1.1813	0.2684
期末基金资产净值	5,526,179,946.09	8,190,216,892.11	11,230,109,955.57
期末基金份额净值	1.5027	2.1813	1.3011
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	71.48%	131.77%	38.25%

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	-2.74%	0.65%	1.23%	0.50%	-3.97%	0.15%
过去六个月	-4.50%	0.74%	3.87%	0.53%	-8.37%	0.21%
过去一年	-26.01%	1.82%	-6.88%	0.98%	-19.13%	0.84%
过去三年	24.21%	1.99%	33.80%	1.25%	-9.59%	0.74%
过去五年	46.12%	1.73%	35.26%	1.14%	10.86%	0.59%
自基金合同生效起至今	71.48%	1.78%	26.20%	1.32%	45.28%	0.46%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达价值成长混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2007年4月2日至2016年12月31日)

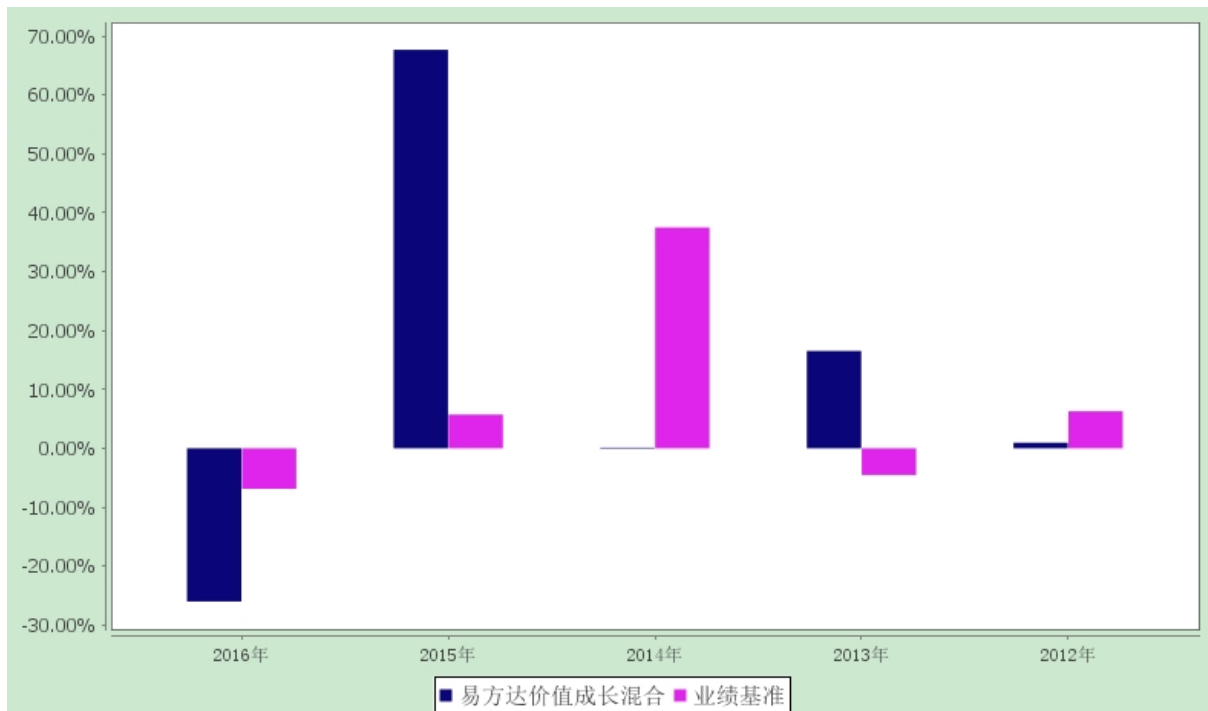


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 71.48%，同期业绩比较基准收益率为 26.20%。

### 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

易方达价值成长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	1.200	181,170,368.56	269,436,434.12	450,606,802.68	-
2015年	-	-	-	-	-
2014年	0.030	13,026,733.87	22,897,009.06	35,923,742.93	-
合计	1.230	194,197,102.43	292,333,443.18	486,530,545.61	-

## § 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		
王 义 克	本基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、公募基金投资部总经理助理	2014-12-06	-	9 年	硕士研究生，曾任美国雷曼兄弟亚洲投资有限公司分析师，野村国际（香港）有限公司分析师，易方达基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理助理。
萧 楠	本基金的基金经理助理、易方达消费行业股票型证券投资基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理（自 2015 年 03 月 24 日至 2016 年 08 月 05 日）、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理（自 2015 年 05 月 29 日至 2016 年 08 月 05 日）	2015-02-14	-	10 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金投资部基金经理助理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 股经历年初熔断暴跌后，整体呈现震荡上行态势。全年来看，上证综指涨跌幅为-

12.31%，沪深 300 指数涨跌幅为-11.28%，深证成指涨跌幅为-19.64%，创业板指涨跌幅为-27.71%。全年涨幅居前的行业包括食品饮料、建筑材料和建筑装饰等行业，而传媒、计算机和交通运输行业的跌幅较大。

2016 年中国经济从快速下滑期步入“L 型”探底期。全年 GDP 增速维持在 6.7%；工业增加值同比增长 6%。随着经济的企稳，物价出现温和上涨，全年 CPI 同比增速 2%。从结构上看，地产销售面积大幅回升，带动地产新开工和投资正增长。制造业端，长期的通缩以及企业资产负债表恶化导致了大量竞争力差的中小企业退出，行业集中度不断提高；叠加 2016 年行政手段去产能，工业品价格明显改善，企业利润明显回升，制造业投资出现回暖迹象。出口端，由于外需不断改善叠加前期人民币贬值，出口基本见底，支撑经济复苏。在需求整体企稳且略有回升的背景下，一些供给侧调整相对到位的行业出现了明显的涨价趋势，如养殖、白酒、部分化工品的产品价格均有较大上涨，行业景气程度较高。

从 2016 年全年来看，A 股市场整体呈现估值差收窄的走势，高估值的行业和个股估值下行，低估值的行业和个股则实现估值提升。另一方面，由于供给侧改革以及环保等因素的刺激，不少传统产业的龙头公司受益于供求关系的改善和产品的提价，引来了盈利的拐点。因此从市场表现上，在 1 月初市场熔断之后，市场出现了较强的结构分化。低估值的家电、食品饮料和企业盈利见底回升的煤炭、有色金属等周期性行业出现了较大的涨幅。与此同时，高估值的计算机、传媒行业等由于股价包含了过高的预期，在出现一系列利空之后，股价表现持续低迷。

从组合的结构来分析，2016 年初重点配置的计算机、传媒和医疗服务行业在 2015 年获得了较高的涨幅之后，由于未能提前减持，在 2016 年年初的熔断中股价下跌较多，造成组合回撤较大。春节过后，市场企稳，我们逐渐对组合配置进行了结构调整。在方向上，我们逐步减持了部分估值较高、且需要较长时间才能兑现盈利的计算机和传媒行业的个股；另一方面，我们增持了估值较低、盈利逐渐改善的家电和食品饮料行业的龙头公司股份。此外，我们对供需结构有望超预期好转的部分有色冶炼行业提高了配置，包括化工和铝等行业的相关个股。经过调整，组合的整体估值水平出现了较大的下降，风格也更加均衡。从结果来看，组合提高配置的行业和个股取得了较好的超额收益。

#### 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 1.5027 元，本报告期份额净值增长率为-26.01%，同期业绩比较基准收益率为-6.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 2017 年经济持续温和复苏，通胀整体温和。结构上看，地产投资增速可能持平、出

口可能回升、消费平稳。详细来看：第一，制造业投资预期弱复苏。广泛的证据表明去产能周期正在接近尾声、去库存周期到低谷并转入补库存。但考虑到提高产能利用率尚有空间、银行对产能过剩行业惜贷以及企业对经济增长前景信心不足，企业大规模扩产投资可能性仍不强。第二，预计 2017 年房地产投资增速 5%左右，经过 2016 年快速的库存去化后，房地产在建未售库存已经处于相当低的水平，施工面积可能有所回升，对应地产投资稳健。总需求温和复苏的情况下，物价水平的压力不大。政策层面，2017 年在国企改革（混改）、供给侧改革（农业）、去产能加码扩围、“一带一路”等方面的机会值得关注。从全球的角度分析，中美欧财政扩张共振可能构成市场的上行期权，全球扩张财政预期暂无法证伪，中国的“老路”，却是美欧的“新路”。目前来看，国内货币紧缩程度超预期将是市场的主要下行风险。

整体而言，我们认为 2017 年 A 股市场面临更大的国内外宏观经济和政策的不确定性，加上流动性收紧和无风险利率上行的预期，我们认为今年尤其是上半年的市场风险偏好难以出现大幅的提升，因此投资收益的来源主要是上市公司业绩的增长。因此，我们将组合配置的重点落在有较大确定性业绩增长的行业和个股上。从组合的结构分析，我们认为低估值的泛消费板块，包括食品饮料、医药及部分耐用消费品等在 2017 年仍然有较好的投资性价比，将是我们组合的基础配置。此外，我们认为供给侧改革及环保因素对资本品行业（包括钢铁、水泥及部分有色冶炼行业）供需关系改善的利好因素将持续，上述行业的部分龙头企业将在盈利上呈现较大的增长，因此我们预期将有较好的阶段性投资机会，所以我们计划上述资本品行业将在组合中占有一定配置比例。从全年的投资周期考虑，随着估值的下移以及业绩的增长，优质成长股的性价比将逐步显现，我们一方面将继续持有部分优质成长股的投资标的，另一方面，我们也密切关注部分优质成长股“跌”出来的投资机会。

由于前瞻性不够，加上组合整体风格偏成长，因此组合在年初回撤较大。我们未能积极有效的回避市场的系统性风险，组合全年出现了较大的跌幅，值得我们深刻反思。2017 年，尽管我们预期市场的不确定性更大，但因为大家更加谨慎的心态，所以我们认为有可能迎来一个较 2016 年更好的结果。新的一年，我们将更加勤勉，扎扎实实做好投资研究工作，尽心尽力做好组合管理，为投资者挽回损失，并创造投资收益。债券投资策略为继续持有短久期品种，并将结合下半年宏观经济形势，灵活调整持仓结构，提高组合的流动性。

#### 4.6 管理人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，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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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《易方达价值成长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 450,606,802.68 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成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达价值成长混合型证券投资基金 2016 年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 20716 号

易方达价值成长混合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价值成长混合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价值成长混合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，上述易方达价值成长混合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，公允反映了易方达价值成长混合型证券投资基金 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：易方达价值成长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	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	202,095,965.85	294,507,107.19
结算备付金		10,318,370.47	25,417,373.79
存出保证金		1,361,408.62	3,201,534.69
交易性金融资产	7.4.7.2	4,896,387,744.61	7,434,132,032.14
其中：股票投资		4,636,078,117.61	7,088,691,532.14
基金投资		-	-
债券投资		260,309,627.00	345,440,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	368,019,112.03	550,000,945.00
应收证券清算款		63,098,528.13	2,783,140.36
应收利息	7.4.7.5	2,680,528.85	6,011,146.85
应收股利		-	-
应收申购款		4,355,020.26	2,302,812.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>5,548,316,678.82</b>	<b>8,318,356,092.33</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		3,471,639.75	85,104,929.29
应付赎回款		3,436,957.23	14,242,970.39
应付管理人报酬		7,165,331.64	10,294,761.62
应付托管费		1,194,221.95	1,715,793.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,262,650.69	14,137,680.14
应交税费		690,125.60	690,125.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,915,805.87	1,952,939.59
<b>负债合计</b>		<b>22,136,732.73</b>	<b>128,139,200.22</b>
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,677,391,428.64	3,754,706,180.18

未分配利润	7.4.7.10	1,848,788,517.45	4,435,510,711.93
<b>所有者权益合计</b>		<b>5,526,179,946.09</b>	<b>8,190,216,892.11</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>5,548,316,678.82</b>	<b>8,318,356,092.33</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5027 元，基金份额总额 3,677,391,428.64 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	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
<b>一、收入</b>		<b>-1,957,520,478.76</b>	<b>7,176,600,214.75</b>
1.利息收入		13,552,615.31	24,632,450.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,041,093.08	5,342,810.92
债券利息收入		6,100,370.70	18,886,843.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,411,151.53	402,795.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-949,747,921.80	7,639,915,939.76
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-980,214,655.47	7,595,605,504.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-31,044.00	7,907,783.08
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	30,497,777.67	36,402,652.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,022,065,356.36	-491,019,276.03

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	740,184.09	3,071,100.36
<b>减：二、费用</b>		<b>137,062,985.32</b>	<b>292,791,844.25</b>
1. 管理人报酬		89,610,829.19	150,896,465.52
2. 托管费		14,935,138.17	25,149,410.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	32,041,178.31	114,972,436.24
5. 利息支出		-	1,257,224.12
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,257,224.12
6. 其他费用	7.4.7.19	475,839.65	516,307.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,094,583,464.08</b>	<b>6,883,808,370.50</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,094,583,464.08</b>	<b>6,883,808,370.50</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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）	3,754,706,180.18	4,435,510,711.93	8,190,216,892.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,094,583,464.08	-2,094,583,464.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-77,314,751.54	-41,531,927.72	-118,846,679.26

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	564,762,411.15	322,347,605.76	887,110,016.91
2.基金赎回款	-642,077,162.69	-363,879,533.48	-1,005,956,696.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-450,606,802.68	-450,606,802.68
五、期末所有者权益（基金净值）	3,677,391,428.64	1,848,788,517.45	5,526,179,946.09
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）	8,631,309,662.25	2,598,800,293.32	11,230,109,955.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,883,808,370.50	6,883,808,370.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-4,876,603,482.07	-5,047,097,951.89	-9,923,701,433.96
其中：1.基金申购款	1,658,510,172.18	1,911,667,291.56	3,570,177,463.74
2.基金赎回款	-6,535,113,654.25	-6,958,765,243.45	-13,493,878,897.70
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）	3,754,706,180.18	4,435,510,711.93	8,190,216,892.11

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

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

### 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》、《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)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基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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)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十二次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值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)基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(4)基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(5)每一基金份额享有同等分配权；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过

交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%

的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

#### 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	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	202,095,965.85	294,507,107.19
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	202,095,965.85	294,507,107.19

##### 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	4,780,989,508.10	4,636,078,117.61	-144,911,390.49	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	260,917,153.75	260,309,627.00	-607,526.75
	银行间市场	-	-	-
	合计	260,917,153.75	260,309,627.00	-607,526.75
资产支持证券	-	-	-	

基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,041,906,661.85	4,896,387,744.61	-145,518,917.24
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		6,212,554,549.02	7,088,691,532.14	876,136,983.12
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	15,417,264.00	15,001,500.00	-415,764.00
	银行间市场	329,613,780.00	330,439,000.00	825,220.00
	合计	345,031,044.00	345,440,500.00	409,456.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,557,585,593.02	7,434,132,032.14	876,546,439.12

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末	
	2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	368,019,112.03	-
合计	368,019,112.03	-
项目	上年度末	
	2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	-	-
银行间市场	550,000,945.00	-
合计	550,000,945.00	-

#### 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	79,495.10	123,887.26
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	4,643.30	11,437.80
应收债券利息	2,292,541.14	5,838,905.01
应收买入返售证券利息	303,236.71	35,476.08
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	612.60	1,440.70
合计	2,680,528.85	6,011,146.85

#### 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	4,253,965.91	14,134,176.54
银行间市场应付交易费用	8,684.78	3,503.60
合计	4,262,650.69	14,137,680.14

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00	1,500,000.00
应付赎回费	2,805.87	22,939.59
预提费用	413,000.00	430,000.00
其他应付款	-	-
合计	1,915,805.87	1,952,939.59

#### 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	3,754,706,180.18	3,754,706,180.18
本期申购	564,762,411.15	564,762,411.15
本期赎回（以“-”号填列）	-642,077,162.69	-642,077,162.69
本期末	3,677,391,428.64	3,677,391,428.64

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	5,637,368,920.91	-1,201,858,208.98	4,435,510,711.93
本期利润	-1,072,518,107.72	-1,022,065,356.36	-2,094,583,464.08
本期基金份额交易产生的变动数	-51,565,989.76	10,034,062.04	-41,531,927.72
其中：基金申购款	734,399,291.20	-412,051,685.44	322,347,605.76
基金赎回款	-785,965,280.96	422,085,747.48	-363,879,533.48
本期已分配利润	-450,606,802.68	-	-450,606,802.68
本期末	4,062,678,020.75	-2,213,889,503.30	1,848,788,517.45

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	4,820,007.81	4,829,797.65
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	186,646.01	442,431.77
其他	34,439.26	70,581.50
合计	5,041,093.08	5,342,810.92

#### 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	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
卖出股票成交总额	10,914,054,901.24	42,021,073,228.87
减：卖出股票成本总额	11,894,269,556.71	34,425,467,724.62
买卖股票差价收入	-980,214,655.47	7,595,605,504.25

#### 7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	354,723,000.00	1,291,150,234.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	345,031,044.00	1,251,609,518.21
减：应收利息总额	9,723,000.00	31,632,933.16
买卖债券差价收入	-31,044.00	7,907,783.08

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	30,497,777.67	36,402,652.43
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	30,497,777.67	36,402,652.43

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	-1,022,065,356.36	-491,019,276.03
——股票投资	-1,021,048,373.61	-489,331,678.21
——债券投资	-1,016,982.75	-1,687,597.82
——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	-1,022,065,356.36	-491,019,276.03

## 7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	740,184.09	3,052,507.55
其他	-	18,592.81
合计	740,184.09	3,071,100.36

## 7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	32,041,178.31	114,965,886.24



银行间市场交易费用	-	6,550.00
合计	32,041,178.31	114,972,436.24

#### 7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	113,000.00	130,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	25,439.65	44,757.42
银行间账户维护费	36,000.00	40,500.00
其他	1,400.00	1,050.00
合计	475,839.65	516,307.42

#### 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
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。

#### 7.4.10 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

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	524,225,492.57	2.46%	5,233,673,443.37	7.10%

##### 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

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	419,380.80	2.18%	337,449.37	7.93%
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	4,186,940.47	6.42%	366,102.35	2.59%

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。

##### 7.4.10.2 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	89,610,829.19	150,896,465.52
其中：支付销售机构的客户维护费	14,105,835.49	23,913,613.34

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。

**7.4.10.2.2 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	14,935,138.17	25,149,410.95

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。

**7.4.10.3 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**

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。

## 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

## 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		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	
	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	202,095,965.85	4,820,007.81	294,507,107.19	4,829,797.65

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。

## 7.4.10.6 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	615,049	5,879,868.44
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
-	-	-	-	-	-

## 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 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	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注

		场 内	场 外	红数				
1	2016-01-20	-	2016-01-20	1.200	181,170,368.56	269,436,434.12	450,606,802.68	-
合计				1.200	181,170,368.56	269,436,434.12	450,606,802.68	-

## 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
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	-
300010	立思 辰	2016-07-07	2017-07-07	非公 开发 行流 通受 限	17.81	16.62	4,998,712	89,027,060.7 2	83,078,593. 44	-
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	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股 流通 受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
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。

#### 7.4.12.2 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
000710	天兴仪表	2016-12-29	重大事项 停牌	47.41	2017-01-04	52.15	1,098,896	26,954,195.01	52,098,659.36	-
300100	双林股份	2016-11-07	重大事项 停牌	34.00	2017-01-25	30.60	7,250,190	289,078,916.81	246,506,460.00	-
600763	通策医疗	2016-12-19	重大事项	33.54	2017-01-03	34.80	3,500,000	87,337,373.5	117,390,000.	-

			停牌					7	00	
600768	宁波富邦	2016-03-31	重大事项 停牌	24.42	2017-03-14	24.00	1,330,600	27,150,963.53	32,493,252.00	-
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项 停牌	177.97	2017-03-13	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-

#### 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。

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

##### 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，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 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 0.02%(2015 年 12 月 31 日：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	261,402,575.33	351,279,405.01
合计	261,402,575.33	351,279,405.01

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

#### 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	1,199,592.81	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,199,592.81	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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 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日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	202,095,965.85	-	-	-	202,095,965.85
结算备付金	10,318,370.47	-	-	-	10,318,370.47
存出保证金	1,361,408.62	-	-	-	1,361,408.62
交易性金融资产	259,116,000.00	1,193,627.00	-	4,636,078,117.61	4,896,387,744.61
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	368,019,112.03	-	-	-	368,019,112.03
应收证券清算款	-	-	-	63,098,528.13	63,098,528.13
应收利息	-	-	-	2,680,528.85	2,680,528.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,355,020.26	4,355,020.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	840,910,856.97	1,193,627.00	-	4,706,212,194.85	5,548,316,678.82
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	-	-	-	3,471,639.75	3,471,639.75
应付赎回款	-	-	-	3,436,957.23	3,436,957.23
应付管理人报酬	-	-	-	7,165,331.64	7,165,331.64
应付托管费	-	-	-	1,194,221.95	1,194,221.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,262,650.69	4,262,650.69
应交税费	-	-	-	690,125.60	690,125.60
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,915,805.87	1,915,805.87
负债总计	-	-	-	22,136,732.73	22,136,732.73
利率敏感度缺口	840,910,856.97	1,193,627.00	-	4,684,075,462.12	5,526,179,946.09
<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	294,507,107.19	-	-	-	294,507,107.19
结算备付金	25,417,373.79	-	-	-	25,417,373.79
存出保证金	3,201,534.69	-	-	-	3,201,534.69
交易性金融资产	345,440,500.00	-	-	7,088,691,532.14	7,434,132,032.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	550,000,945.00	-	-	-	550,000,945.00
应收证券清算款	-	-	-	2,783,140.36	2,783,140.36
应收利息	-	-	-	6,011,146.85	6,011,146.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,302,812.31	2,302,812.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,218,567,460.67	-	-	7,099,788,631.66	8,318,356,092.33

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

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 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	378,419.04	359,949.83
2.市场利率上升25个基点	-377,316.96	-359,154.75	

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 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	4,636,078,117.61	83.89	7,088,691,532.14	86.55
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,636,078,117.61	83.89	7,088,691,532.14	86.55

#### 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%	348,362,597.51	411,662,193.52
2.业绩比较基准下降 5%	-348,362,597.51	-411,662,193.52	

#### 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 4,104,309,512.80 元，属于第二层次的余额为 792,078,231.81 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 5,857,601,112.65 元，第二层次 1,576,530,919.49 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 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	4,636,078,117.61	83.56
	其中：股票	4,636,078,117.61	83.56

2	固定收益投资	260,309,627.00	4.69
	其中：债券	260,309,627.00	4.69
	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	368,019,112.03	6.63
	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	212,414,336.32	3.83
7	其他各项资产	71,495,485.86	1.29
8	合计	5,548,316,678.82	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	-	-
B	采矿业	107,034,385.04	1.94
C	制造业	3,189,204,133.77	57.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,827,695.41	1.77
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	108,040,000.00	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	99,474,114.68	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,900,285.64	4.21
J	金融业	129,922,721.44	2.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	77,750,000.00	1.41

M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	329,777,189.40	5.97
R	文化、体育和娱乐业	223,152,000.00	4.04
S	综合	40,980,000.00	0.74
	合计	4,636,078,117.61	83.89

## 8.3 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	000333	美的集团	11,542,593	325,154,844.81	5.88
2	000568	泸州老窖	9,200,000	303,600,000.00	5.49
3	300100	双林股份	7,250,190	246,506,460.00	4.46
4	300010	立思辰	13,998,712	232,658,593.44	4.21
5	600409	三友化工	20,000,000	187,800,000.00	3.40
6	300015	爱尔眼科	6,199,906	185,377,189.40	3.35
7	002699	美盛文化	5,000,000	169,000,000.00	3.06
8	002409	雅克科技	6,800,000	168,640,000.00	3.05
9	601600	中国铝业	39,001,000	164,584,220.00	2.98
10	600699	均胜电子	4,925,229	162,975,827.61	2.95
11	002032	苏泊尔	4,300,719	150,181,107.48	2.72
12	600763	通策医疗	3,500,000	117,390,000.00	2.12
13	000858	五粮液	2,922,700	100,774,696.00	1.82
14	300238	冠昊生物	3,005,213	100,223,853.55	1.81
15	000089	深圳机场	12,433,082	99,464,656.00	1.80
16	000401	冀东水泥	8,301,468	98,787,469.20	1.79
17	000421	南京公用	10,999,975	97,789,777.75	1.77
18	000651	格力电器	3,500,550	86,183,541.00	1.56
19	600062	华润双鹤	3,801,117	84,498,830.91	1.53
20	002142	宁波银行	5,018,446	83,506,941.44	1.51
21	603338	浙江鼎力	1,555,300	81,046,683.00	1.47
22	002707	众信旅游	5,000,000	77,750,000.00	1.41
23	601567	三星医疗	6,000,000	68,880,000.00	1.25
24	600519	贵州茅台	199,920	66,803,268.00	1.21
25	000513	丽珠集团	983,688	58,529,436.00	1.06
26	600547	山东黄金	1,541,404	56,276,660.04	1.02

27	002262	恩华药业	2,681,216	56,037,414.40	1.01
28	603989	艾华集团	1,501,101	55,255,527.81	1.00
29	600180	瑞茂通	4,000,000	54,160,000.00	0.98
30	000802	北京文化	2,800,000	54,152,000.00	0.98
31	600739	辽宁成大	3,000,000	53,880,000.00	0.97
32	000911	南宁糖业	3,000,000	53,730,000.00	0.97
33	002242	九阳股份	2,905,387	52,384,127.61	0.95
34	000710	天兴仪表	1,098,896	52,098,659.36	0.94
35	300129	泰胜风能	5,799,919	50,749,291.25	0.92
36	600276	恒瑞医药	1,010,670	45,985,485.00	0.83
37	600887	伊利股份	2,477,300	43,600,480.00	0.79
38	600701	*ST 工新	3,000,000	40,980,000.00	0.74
39	600585	海螺水泥	2,379,514	40,356,557.44	0.73
40	000930	中粮生化	2,969,388	39,908,574.72	0.72
41	300078	思创医惠	1,539,936	39,899,741.76	0.72
42	002508	老板电器	1,002,406	36,888,540.80	0.67
43	600768	宁波富邦	1,330,600	32,493,252.00	0.59
44	601009	南京银行	2,850,000	30,894,000.00	0.56
45	300436	广生堂	499,970	27,018,378.80	0.49
46	300347	泰格医药	1,000,000	27,010,000.00	0.49
47	601699	潞安环能	3,164,300	25,472,615.00	0.46
48	000937	冀中能源	3,751,500	25,285,110.00	0.46
49	002008	大族激光	1,000,000	22,600,000.00	0.41
50	600997	开滦股份	2,102,500	15,032,875.00	0.27
51	600104	上汽集团	464,800	10,899,560.00	0.20
52	603766	隆鑫通用	400,000	8,312,000.00	0.15
53	000661	长春高新	70,000	7,829,500.00	0.14
54	601818	光大银行	2,000,000	7,820,000.00	0.14
55	600015	华夏银行	700,000	7,595,000.00	0.14
56	002572	索菲亚	140,000	7,582,400.00	0.14
57	002434	万里扬	399,947	6,399,152.00	0.12
58	000418	小天鹅 A	190,000	6,140,800.00	0.11
59	300068	南都电源	280,000	5,395,600.00	0.10
60	002019	亿帆医药	350,000	5,351,500.00	0.10
61	600521	华海药业	208,000	4,582,240.00	0.08
62	603866	桃李面包	99,982	4,389,209.80	0.08
63	603823	百合花	36,764	1,203,653.36	0.02
64	603660	苏州科达	26,007	837,945.54	0.02
65	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.00
66	603986	兆易创新	1,133	201,640.01	0.00
67	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
68	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
69	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
70	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00



71	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
72	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
73	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
74	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
75	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
76	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
77	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
78	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
79	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
80	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
81	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
82	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
83	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
84	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
85	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
86	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
87	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
88	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
89	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
90	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
91	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
92	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

#### 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	000333	美的集团	374,527,028.78	4.57
2	000568	泸州老窖	305,561,131.46	3.73
3	300100	双林股份	293,186,429.29	3.58
4	000651	格力电器	221,867,329.00	2.71
5	000911	南宁糖业	210,984,933.25	2.58
6	601600	中国铝业	181,134,698.74	2.21
7	600409	三友化工	175,029,581.35	2.14
8	002699	美盛文化	168,910,019.18	2.06
9	002032	苏泊尔	167,472,472.26	2.04
10	000858	五粮液	153,212,621.59	1.87
11	002409	雅克科技	152,259,453.07	1.86
12	600547	山东黄金	152,135,904.72	1.86
13	300238	冠昊生物	135,978,840.02	1.66

14	600519	贵州茅台	124,908,272.22	1.53
15	600136	当代明诚	123,625,129.06	1.51
16	002242	九阳股份	122,684,100.25	1.50
17	002196	方正电机	122,002,375.93	1.49
18	002142	宁波银行	120,007,089.31	1.47
19	600114	东睦股份	118,555,738.32	1.45
20	000421	南京公用	115,639,139.32	1.41

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	002690	美亚光电	293,684,613.78	3.59
2	300133	华策影视	276,905,074.63	3.38
3	000651	格力电器	223,788,065.69	2.73
4	600271	航天信息	202,823,535.80	2.48
5	002450	康得新	177,842,092.19	2.17
6	600160	巨化股份	169,317,851.71	2.07
7	600763	通策医疗	163,937,348.91	2.00
8	600570	恒生电子	162,428,858.84	1.98
9	000911	南宁糖业	156,191,463.06	1.91
10	300236	上海新阳	137,417,349.36	1.68
11	000998	隆平高科	126,093,456.67	1.54
12	600236	桂冠电力	123,875,566.99	1.51
13	000333	美的集团	122,959,761.89	1.50
14	600547	山东黄金	121,084,162.88	1.48
15	600715	文投控股	120,660,785.55	1.47
16	002312	三泰控股	116,710,370.81	1.42
17	002196	方正电机	111,793,550.87	1.36
18	600519	贵州茅台	110,373,039.01	1.35
19	000858	五粮液	109,291,552.59	1.33
20	600114	东睦股份	106,245,739.54	1.30

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	10,462,704,515.79
卖出股票收入（成交）总额	10,914,054,901.24

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	259,116,000.00	4.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	0.00	-
	其中：政策性金融债	0.00	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,193,627.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	260,309,627.00	4.71

### 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	2,600,000	259,116,000.00	4.69
2	120001	16 以岭 EB	10,550	1,193,627.00	0.02

### 8.7 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。

### 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	1,361,408.62
2	应收证券清算款	63,098,528.13
3	应收股利	-
4	应收利息	2,680,528.85
5	应收申购款	4,355,020.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,495,485.86

**8.12.4 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。

**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	300100	双林股份	246,506,460.00	4.46	重大事项停牌
2	300010	立思辰	83,078,593.44	1.50	非公开发行流通受限

## § 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
235,649	15,605.38	16,037,780.42	0.44%	3,661,353,648.22	99.56%

## 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	59,104.86	0.0016%

## 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(2007年4月2日)基金份额总额	10,874,939,465.41
本报告期期初基金份额总额	3,754,706,180.18
本报告期基金总申购份额	564,762,411.15
减：本报告期基金总赎回份额	642,077,162.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,677,391,428.64

## § 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 10 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 113,000.00 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	
招商证券	2	902,274,464.63	4.24%	840,288.45	4.37%	-
中金公司	2	1,454,721,590.54	6.84%	1,354,785.33	7.04%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

中信证券	3	2,935,930.54	0.01%	2,734.25	0.01%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	4,176,525,381.51	19.64%	3,889,604.07	20.22%	-
瑞银证券	1	1,107,195,686.08	5.21%	1,031,126.09	5.36%	-
新时代证券	1	1,580,287,249.69	7.43%	1,471,718.78	7.65%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	965,727,762.12	4.54%	899,383.60	4.67%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	159,210,665.96	0.75%	148,273.29	0.77%	-
东兴证券	1	1,016,569,722.40	4.78%	946,735.02	4.92%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	1,560,565,569.45	7.34%	1,291,115.87	6.71%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	21,436,375.43	0.10%	19,963.69	0.10%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	2,553,240,570.52	12.00%	2,377,836.38	12.36%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	1,968,929,043.88	9.26%	1,833,668.77	9.53%	-
中泰证券	2	365,372,348.60	1.72%	340,269.35	1.77%	-
海通证券	2	249,198,674.92	1.17%	232,080.12	1.21%	-
广州证券	2	2,246,512,657.02	10.56%	1,808,765.70	9.40%	-
广发证券	1	524,225,492.57	2.46%	419,380.80	2.18%	-
华创证券	2	415,488,155.14	1.95%	332,390.46	1.73%	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少安信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司各一个交易单元,新增华创证券有限责任公司一个交易单元,天源证券经纪有限公司更名为九州证券股份有限公司。

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

的信息服务；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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	259,862,200.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	700,000,000.00	100.00%	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-



华宝证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-

### 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	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-04
2	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-05
3	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-06
4	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-07
5	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-08
6	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-14
7	易方达价值成长混合型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-18
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加包商银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-20
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-20
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加昆仑银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-26

11	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-27
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中经北证为销售机构、参加中经北证申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中证金牛为销售机构、参加中证金牛申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
14	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
15	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-29
16	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-23
17	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-26
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加恒丰银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-29
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加德州银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-02
20	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-05
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加富济财富为销售机构、参加富济财富申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-08
22	易方达基金管理有限公司关于在大同证券推出旗下部分开放式基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-10
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加德州银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-23
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加同花顺费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-25

25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-30
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加好买基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-07
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江泰隆商业银行为销售机构、参加浙江泰隆商业银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-08
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中正达广为销售机构、参加中正达广申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-21
29	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-21
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中国邮政储蓄银行为销售机构、参加中国邮政储蓄银行定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-22
31	易方达基金管理有限公司关于旗下基金投资基金管理人非控股股东承销证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-22
32	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加锦州银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-22
33	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-28
34	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
35	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
36	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
37	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-04
38	易方达基金管理有限公司关于官方淘宝店关闭服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05

39	易方达基金管理有限公司关于网上直销支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05
40	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加云南红塔银行为销售机构、参加云南红塔银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-09
41	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-10
42	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加民生银行直销银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-13
43	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加徽商期货为销售机构、参加徽商期货申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-18
44	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-19
45	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
46	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大智慧为销售机构、参加大智慧申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
47	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰金融为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
48	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加川财证券为销售机构、参加川财证券申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-27
49	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大连银行为销售机构、参加大连银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-31
50	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鼎信汇金为销售机构、参加鼎信汇金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-01
51	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加鑫鼎盛费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-20
52	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加余杭农村商业银行作为销售机构、参加余杭农村商业银行申购与定期定额投资	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

	费率优惠活动的公告		
53	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-30
54	易方达基金管理有限公司关于在官方京东店开展基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-30
55	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
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德州银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-06
57	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	2016-07-07
58	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放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	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-07
59	易方达基金管理有限公司关于旗下易方达价值成长混合型证券投资基金获配立思辰（300010）非公开发行 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	2016-07-09
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昆山农村商业银行销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-15
61	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	2016-07-21
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
63	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
64	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加九台农商银行销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-29
65	易方达基金管理有限公司关于在新浪仓石开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务、参加新浪仓石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	2016-07-29
66	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2016-08-05

	金服申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	理人网站	
67	易方达基金管理有限公司关于汉口银行暂停旗下部分开放式基金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	2016-08-09
68	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
69	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
70	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加东证期货为销售机构、参加东证期货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	2016-09-01
71	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
72	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加金百临为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-06
73	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
74	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
75	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加天津农商银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-21
76	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
77	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与云南红塔银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-30
78	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阳农商银行为销售机构、参加富阳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	2016-10-14
79	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	2016-10-19

80	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
81	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与钱景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	2016-10-26
82	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加弘业期货为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-11-04
83	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与新浪仓石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	2016-11-15
84	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
85	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
86	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
87	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
88	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
89	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加萧山农商银行为销售机构、参加萧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	2016-12-07
90	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
91	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
92	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
93	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

94	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加恒丰银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-30
95	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
96	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
97	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农业银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	2016-12-30
98	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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准易方达价值成长混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达价值成长混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 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。



二〇一七年三月三十一日