

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基 金

2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12	投资组合报告附注	38
8	基金份额持有人信息	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2	期末上市基金前十名持有人	39
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	40
9	开放式基金份额变动	40
10	重大事件揭示	40
10.1	基金份额持有人大会决议	40
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	41
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4	基金投资策略的改变	41
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8	其他重大事件	42
11	备查文件目录	43
11.1	备查文件目录	43
11.2	存放地点	43
11.3	查阅方式	43

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达上证中盘 ETF
基金主代码	510130
交易代码	510130
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2010 年 3 月 29 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	79,885,089.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010 年 6 月 23 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资，即按照上证中盘指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生，基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	洪渊
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588

传真	020-85104666	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510620	100140
法定代表人	刘晓艳	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 36 楼
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

注：本基金场内注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司上海分公司，场外注册登记机构为易方达基金管理有限公司。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-21,352,161.26
本期利润	-66,308,679.54
加权平均基金份额本期利润	-0.8055
本期加权平均净值利润率	-24.83%
本期基金份额净值增长率	-19.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,522,355.72
期末可供分配基金份额利润	0.3195
期末基金资产净值	257,788,367.12

期末基金份额净值	3.2270
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.99%

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。

4.本基金已于 2010 年 5 月 28 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.34394741。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

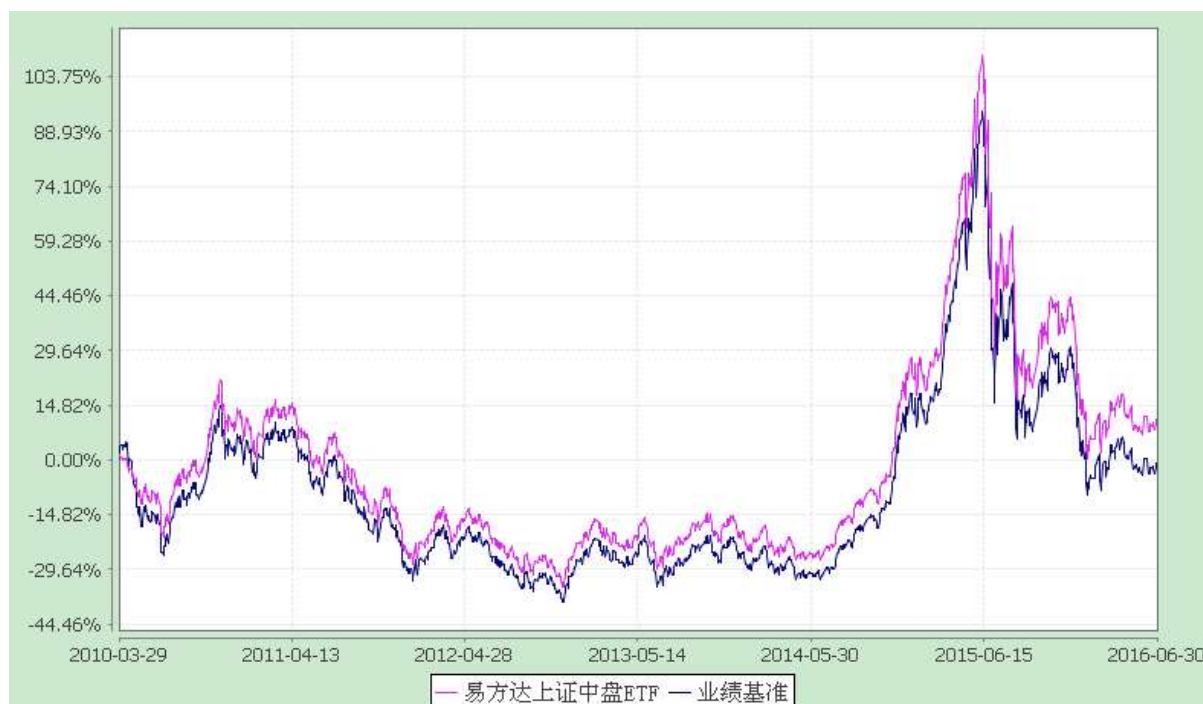
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.06%	1.07%	-0.85%	1.10%	0.79%	-0.03%
过去三个月	-3.37%	1.20%	-4.49%	1.21%	1.12%	-0.01%
过去六个月	-19.70%	2.10%	-21.01%	2.13%	1.31%	-0.03%
过去一年	-35.65%	2.63%	-37.55%	2.66%	1.90%	-0.03%
过去三年	55.14%	1.96%	48.16%	2.00%	6.98%	-0.04%
自基金合同生效起至今	10.99%	1.71%	-1.21%	1.76%	12.20%	-0.05%

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

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

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 3 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 10.99%，同期业绩比较基准收益率为 -1.21%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 1.2 亿元，旗下设有北京、广州、上海、成都、南京、大连分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持“在诚信规范的前提下，通过专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004 年 10 月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005 年 8 月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007 年 12 月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008 年 2 月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至 2016 年 6 月 30 日，易方达旗下共管理 92 只开放式基金、1 只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，管理公募基金总规模 4056.91 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

张胜记	本基金的基金经理、易方达 50 指数证券投资基金的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、指数与量化投资部总经理助理	2010-03-29	-	11 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理。
-----	---	------------	---	------	--

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 16 次，其中 13 次为指数及量化投资因投资策略

需要和其他组合发生的反向交易；3 次为不同基金经理管理的非指数基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 上半年，国内经济增速回升，国内生产总值 GDP 同比增长 6.7%，呈现弱复苏态势。1-6 月份全国固定资产投资同比增长 9.0%，房地产开发同比增长 6.1%，维持高位；规模以上工业增加值同比实际增长 6.0%，社会消费品零售总额同比增长 10.3%，保持稳定。居民消费价格指数（CPI）同比上涨 2.1%，工业生产者出厂价格指数（PPI）同比下降 4.8%，通胀处于较低水平。央行货币投放力度整体宽松，央行再次降低银行存款准备金率 0.5 个百分点、降低房地产首付比例等。广义货币供应量 M2 同比增长 11.8%，居民部分的中长期贷款强劲，反映出地产销售旺盛。报告期内，上证指数下跌 17.22%，创业板、中小板跌幅较大，上证中盘指数下跌 21.01%。从行业表现来看，食品饮料、有色金属、银行、家电等板块跌幅较小；交通运输、轻工、传媒、商业贸易等行业跌幅较大。

上证中盘 ETF 基金属于完全跟踪指数的证券投资基金。报告期内，本基金跟随指数的成分股变化进行日常调整操作，控制基金组合与指数权重基本一致。

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 3.2270 元，本报告期份额净值增长率为-19.70%，同期业绩比较基准收益率为-21.01%，年化跟踪误差 0.66%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股市涨跌是对宏观经济周期波动的反映，中国经济增长的波动幅度较大是决定 A 股市场大幅波动的主要原因。展望 2016 年下半年，宏观经济复苏缓慢，企业盈利处于低位，上市公司业绩整体难有较好表现。市场估值虽然已大幅回调，但结构性高估严重，小盘股估值仍远高于历史均值；证监会颁布借壳新规、严查并购重组，将对小盘股形成带来压力。另一方面，去杠杆的大背景下，股市流动性供给并不充裕；欧美发达国家金融政策面临变化，美联储加息、英国脱欧等将对发达国家股市、汇市产生冲击。A 股市场在目前水平上震荡企稳的可能性较大。

长期来看，推动我国经济增长的三大原动力依然存在。首先是制度改革，十八届三中全会明确中国在推进经济、文化、社会等领域的改革路线，有望释放出更多的生产力；第二是资源、技术与

人力资本等生产要素的升级还在持续；最后是我国处于快速的工业化、城市化以及区域经济一体化进程中，中长期经济增长前景良好，本基金对市场的长期走势保持乐观。作为完全被动投资基金，本基金下阶段将继续坚持完全复制基准指数的投资策略，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望上证中盘 ETF 为投资者分享中国经济的未来成长提供良好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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上证中盘交易型开放式指数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，易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的管理人——易方达基金管理有

限公司在易方达上证中盘交易型开放式指数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，易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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上证中盘交易型开放式指数证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,038,218.18	11,314,303.38
结算备付金		-	71,220.22
存出保证金		5,050.07	46,757.19
交易性金融资产	6.4.7.2	248,073,202.34	328,120,264.98
其中：股票投资		248,073,202.34	328,120,264.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		149,124.93	-
应收利息	6.4.7.5	1,722.42	2,319.43
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		258,267,317.94	339,554,865.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	150,569.64
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		106,107.49	144,999.30
应付托管费		21,221.52	28,999.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	92,771.35	118,967.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	258,850.46	410,000.00
负债合计		478,950.82	853,536.13
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	232,266,011.40	245,059,017.77
未分配利润	6.4.7.10	25,522,355.72	93,642,311.30
所有者权益合计		257,788,367.12	338,701,329.07
负债和所有者权益总计		258,267,317.94	339,554,865.20

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.2270 元，基金份额总额 79,885,089.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-65,037,848.30	261,965,514.02
1.利息收入		25,057.03	44,586.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,025.46	44,566.39
债券利息收入		31.57	20.16
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）		-20,108,795.72	470,482,838.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-22,902,815.49	467,411,854.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	26,649.43	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,767,370.34	3,070,983.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-44,956,518.28	-211,193,931.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,408.67	2,632,021.26
减：二、费用		1,270,831.24	3,764,316.57
1. 管理人报酬		665,024.71	1,709,616.21
2. 托管费		133,004.98	341,923.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	157,629.09	1,389,781.51
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	315,172.46	322,995.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-66,308,679.54	258,201,197.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-66,308,679.54	258,201,197.45

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	245,059,017.77	93,642,311.30	338,701,329.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-66,308,679.54	-66,308,679.54
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）	-12,793,006.37	-1,811,276.04	-14,604,282.41
其中：1.基金申购款	2,326,001.15	154,928.23	2,480,929.38

2.基金赎回款	-15,119,007.52	-1,966,204.27	-17,085,211.79
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）	232,266,011.40	25,522,355.72	257,788,367.12
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	599,771,971.16	144,089,268.41	743,861,239.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	258,201,197.45	258,201,197.45
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）	-294,236,923.39	-180,880,154.40	-475,117,077.79
其中：1.基金申购款	5,873,006,969.80	5,041,251,596.18	10,914,258,565.98
2.基金赎回款	-6,167,243,893.19	-5,222,131,750.58	-11,389,375,643.77
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）	305,535,047.77	221,410,311.46	526,945,359.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会证监许可[2009]1498 号《关于核准易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,752,478,065 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,000 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

为了与上证中盘指数进行对比，根据《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，易方达基金管理有限公司确定 2010 年 5 月 28 日为本基金的基金份额折算日。当日上证中盘指数收盘值为 2706.88 点，本基金资产净值为 2,562,624,152.24 元，折算前基金份额总额为 2,752,478,065 份，折算前基金份额净值为 0.931 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.34394741，折算后基金份额总额为 946,685,089 份，折算后基金份额净值为 2.707 元。易方达基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2010 年 5 月 31 日进行了变更登记。

6.4.2 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》、《易方达上证中盘交易型开放式指数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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	10,038,218.18
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	10,038,218.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	313,175,170.60	248,073,202.34	-65,101,968.26
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
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		313,175,170.60	248,073,202.34	-65,101,968.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,720.35
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.07
合计	1,722.42

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	92,771.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	92,771.35

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	208,850.46
其他应付款	50,000.00
合计	258,850.46

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,285,089.00	245,059,017.77
本期申购	800,000.00	2,326,001.15
本期赎回（以“-”号填列）	-5,200,000.00	-15,119,007.52
本期末	79,885,089.00	232,266,011.40

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	150,935,605.43	-57,293,294.13	93,642,311.30
本期利润	-21,352,161.26	-44,956,518.28	-66,308,679.54
本期基金份额交易产生的变动数	-7,485,049.99	5,673,773.95	-1,811,276.04
其中：基金申购款	1,425,488.84	-1,270,560.61	154,928.23
基金赎回款	-8,910,538.83	6,944,334.56	-1,966,204.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	122,098,394.18	-96,576,038.46	25,522,355.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	24,285.15
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	652.80
其他	87.51
合计	25,025.46

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-18,120,355.73
股票投资收益——赎回差价收入	-4,782,459.76
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-22,902,815.49

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	52,030,129.16
减：卖出股票成本总额	70,150,484.89
买卖股票差价收入	-18,120,355.73

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	17,085,211.79
减：现金支付赎回款总额	581,413.79
减：赎回股票成本总额	21,286,257.76
赎回差价收入	-4,782,459.76

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	344,681.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	318,000.00
减：应收利息总额	31.57
买卖债券差价收入	26,649.43

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,767,370.34
基金投资产生的股利收益	-

合计	2,767,370.34
----	--------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-44,956,518.28
——股票投资	-44,956,518.28
——债券投资	-
——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	-44,956,518.28

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益收入	2,408.67
其他	-
合计	2,408.67

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	157,629.09
银行间市场交易费用	-
合计	157,629.09

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	322.00

银行间账户维护费	6,000.00
上市费	29,835.26
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	315,172.46

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人
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、申购赎回代办证券公司
易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月
----	-------------------------	------------------------------

	30日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	665,024.71	1,709,616.21
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	133,004.98	341,923.23

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

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 3 个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金	60,422,316.00	75.64%	62,933,762.00	74.67%
广发证券	589,473.00	0.74%	1,057,524.00	1.25%

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

有关规定支付。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	10,038,218.18	24,285.15	21,222,105.97	35,414.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股流通受限	12.98	12.98	2,180	28,296.40	28,296.40	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600005	武钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	2.76	-	-	450,000	2,201,815.75	1,242,000.00	-

600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	4.90	-	-	550,700	3,778,213.81	2,698,430.00	-
600649	城投控股	2016-06-20	重大事项停牌	14.36	-	-	165,485	2,205,677.75	2,376,364.60	-
600773	西藏城投	2016-06-30	重大事项停牌	15.67	-	-	48,361	746,685.27	757,816.87	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	20.92	2016-07-01	23.01	7,210	25,018.70	150,833.20	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，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。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2015 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	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。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型的基金。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,038,218.18	-	-	-	10,038,218.18
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	5,050.07	-	-	-	5,050.07
交易性金融资产	-	-	-	248,073,202.34	248,073,202.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	149,124.93	149,124.93
应收利息	-	-	-	1,722.42	1,722.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,043,268.25	-	-	248,224,049.69	258,267,317.94
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	106,107.49	106,107.49
应付托管费	-	-	-	21,221.52	21,221.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	92,771.35	92,771.35
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	258,850.46	258,850.46
负债总计	-	-	-	478,950.82	478,950.82
利率敏感度缺口	10,043,268.25	-	-	247,745,098.87	257,788,367.12

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	11,314,303.38	-	-	-	11,314,303.38
结算备付金	71,220.22	-	-	-	71,220.22
存出保证金	46,757.19	-	-	-	46,757.19
交易性金融资产	-	-	-	328,120,264.98	328,120,264.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,319.43	2,319.43
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,432,280.79	-	-	328,122,584.41	339,554,865.20
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	-	-	-	150,569.64	150,569.64
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	144,999.30	144,999.30
应付托管费	-	-	-	28,999.88	28,999.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	118,967.31	118,967.31
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	410,000.00	410,000.00
负债总计	-	-	-	853,536.13	853,536.13
利率敏感度缺口	11,432,280.79	-	-	327,269,048.28	338,701,329.0

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	-	-
	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。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	248,073,202.34	96.23	328,120,264.98	96.88
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	248,073,202.34	96.23	328,120,264.98	96.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	12,417,966.59	16,487,235.10
	2.业绩比较基准下降 5%	-12,417,966.59	-16,487,235.10

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 240,847,757.67 元，属于第二层次的余额为 7,225,444.67 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 300,529,017.12 元，第二层次 27,591,247.86 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	248,073,202.34	96.05
	其中：股票	248,073,202.34	96.05
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,038,218.18	3.89
7	其他各项资产	155,897.42	0.06
8	合计	258,267,317.94	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,602,748.00	0.62
B	采矿业	14,920,520.39	5.79
C	制造业	84,508,317.28	32.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,758,555.33	8.44

E	建筑业	6,599,487.66	2.56
F	批发和零售业	13,428,685.59	5.21
G	交通运输、仓储和邮政业	16,664,905.94	6.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,793,606.01	5.35
J	金融业	36,392,310.96	14.12
K	房地产业	29,498,020.02	11.44
L	租赁和商务服务业	4,243,824.00	1.65
M	科学研究和技术服务业	1,221,914.10	0.47
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,886,421.46	0.73
S	综合	1,553,885.60	0.60
	合计	248,073,202.34	96.23

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	731,777	9,139,894.73	3.55
2	600276	恒瑞医药	156,247	6,267,067.17	2.43
3	600015	华夏银行	592,300	5,857,847.00	2.27
4	601939	建设银行	851,034	4,042,411.50	1.57
5	601009	南京银行	403,035	3,784,498.65	1.47
6	600570	恒生电子	54,789	3,658,261.53	1.42
7	601899	紫金矿业	1,051,400	3,543,218.00	1.37
8	600011	华能国际	465,676	3,501,883.52	1.36
9	601901	方正证券	456,300	3,495,258.00	1.36
10	600585	海螺水泥	221,800	3,224,972.00	1.25
11	601555	东吴证券	232,900	3,120,860.00	1.21
12	601099	太平洋	503,861	3,088,667.93	1.20
13	600547	山东黄金	78,901	3,070,037.91	1.19
14	600690	青岛海尔	338,300	3,004,104.00	1.17
15	600100	同方股份	197,194	2,950,022.24	1.14

16	600271	航天信息	122,944	2,926,067.20	1.14
17	600705	中航资本	497,600	2,925,888.00	1.13
18	600066	宇通客车	147,206	2,914,678.80	1.13
19	600703	三安光电	141,424	2,824,237.28	1.10
20	600009	上海机场	106,700	2,779,535.00	1.08
21	601198	东兴证券	111,000	2,712,840.00	1.05
22	600019	宝钢股份	550,700	2,698,430.00	1.05
23	600383	金地集团	249,485	2,584,664.60	1.00
24	600535	天士力	71,817	2,568,175.92	1.00
25	600115	东方航空	376,200	2,486,682.00	0.96
26	600886	国投电力	376,200	2,482,920.00	0.96
27	600089	特变电工	287,800	2,452,056.00	0.95
28	600196	复星医药	127,000	2,415,540.00	0.94
29	600340	华夏幸福	98,364	2,398,114.32	0.93
30	601888	中国国旅	54,100	2,379,318.00	0.92
31	600649	城投控股	165,485	2,376,364.60	0.92
32	600177	雅戈尔	170,143	2,346,271.97	0.91
33	600485	信威集团	129,600	2,312,064.00	0.90
34	601607	上海医药	127,869	2,308,035.45	0.90
35	600023	浙能电力	452,460	2,303,021.40	0.89
36	601600	中国铝业	607,660	2,290,878.20	0.89
37	600804	鹏博士	125,400	2,286,042.00	0.89
38	600369	西南证券	313,038	2,272,655.88	0.88
39	600118	中国卫星	65,707	2,207,755.20	0.86
40	600061	国投安信	123,000	2,191,860.00	0.85
41	600352	浙江龙盛	252,500	2,176,550.00	0.84
42	600406	国电南瑞	161,700	2,161,929.00	0.84
43	600489	中金黄金	191,287	2,150,065.88	0.83
44	600208	新湖中宝	504,531	2,134,166.13	0.83
45	600031	三一重工	422,200	2,119,444.00	0.82
46	600739	辽宁成大	135,720	2,113,160.40	0.82
47	601018	宁波港	425,800	2,107,710.00	0.82
48	600221	海南航空	654,882	2,075,975.94	0.81
49	600674	川投能源	243,918	2,014,762.68	0.78
50	600446	金证股份	55,500	1,995,225.00	0.77
51	601618	中国中冶	540,134	1,993,094.46	0.77
52	600741	华域汽车	139,912	1,960,167.12	0.76
53	601111	中国国航	283,400	1,915,784.00	0.74
54	600415	小商品城	301,700	1,864,506.00	0.72
55	601933	永辉超市	451,082	1,862,968.66	0.72
56	600663	陆家嘴	81,325	1,850,143.75	0.72
57	600018	上港集团	359,600	1,833,960.00	0.71
58	600085	同仁堂	60,910	1,814,508.90	0.70
59	600839	四川长虹	409,500	1,809,990.00	0.70

60	603993	洛阳钼业	431,000	1,788,650.00	0.69
61	600068	葛洲坝	306,300	1,782,666.00	0.69
62	600315	上海家化	59,825	1,725,353.00	0.67
63	600150	中国船舶	76,400	1,700,664.00	0.66
64	600583	海油工程	245,000	1,692,950.00	0.66
65	600153	建发股份	140,679	1,688,148.00	0.65
66	600079	人福医药	99,900	1,675,323.00	0.65
67	600816	安信信托	98,138	1,655,588.06	0.64
68	600219	南山铝业	220,200	1,629,480.00	0.63
69	600503	华丽家族	177,691	1,629,426.47	0.63
70	600157	永泰能源	413,490	1,629,150.60	0.63
71	600588	用友网络	81,256	1,590,992.48	0.62
72	600895	张江高科	85,945	1,553,885.60	0.60
73	600060	海信电器	86,942	1,537,134.56	0.60
74	600074	保千里	102,400	1,527,808.00	0.59
75	601106	中国一重	290,000	1,510,900.00	0.59
76	600688	上海石化	242,900	1,481,690.00	0.57
77	601333	广深铁路	376,100	1,470,551.00	0.57
78	600978	宜华生活	131,500	1,464,910.00	0.57
79	600332	白云山	59,400	1,463,616.00	0.57
80	600820	隧道股份	174,300	1,462,377.00	0.57
81	600376	首开股份	124,407	1,383,405.84	0.54
82	601258	庞大集团	503,000	1,383,250.00	0.54
83	600027	华电国际	271,000	1,341,450.00	0.52
84	600252	中恒集团	308,217	1,337,661.78	0.52
85	600158	中体产业	74,778	1,327,309.50	0.51
86	600737	中粮屯河	113,700	1,313,235.00	0.51
87	600490	鹏欣资源	163,975	1,310,160.25	0.51
88	601718	际华集团	171,000	1,306,440.00	0.51
89	600875	东方电气	132,826	1,304,351.32	0.51
90	600266	北京城建	104,344	1,303,256.56	0.51
91	600873	梅花生物	206,700	1,283,607.00	0.50
92	600643	爱建集团	127,322	1,243,935.94	0.48
93	600005	武钢股份	450,000	1,242,000.00	0.48
94	600362	江西铜业	91,933	1,239,256.84	0.48
95	601117	中国化学	218,900	1,210,517.00	0.47
96	600655	豫园商城	111,450	1,208,118.00	0.47
97	600645	中源协和	34,200	1,201,788.00	0.47
98	600704	物产中大	127,300	1,191,528.00	0.46
99	600037	歌华有线	77,200	1,174,212.00	0.46
100	601179	中国西电	227,300	1,152,411.00	0.45
101	600094	大名城	120,700	1,146,650.00	0.44
102	600372	中航电子	58,500	1,138,995.00	0.44
103	601633	长城汽车	133,676	1,128,225.44	0.44

104	600240	华业资本	110,457	1,106,779.14	0.43
105	601872	招商轮船	235,100	1,100,268.00	0.43
106	600160	巨化股份	100,500	1,068,315.00	0.41
107	601216	君正集团	140,464	1,049,266.08	0.41
108	601898	中煤能源	202,800	1,046,448.00	0.41
109	600516	方大炭素	114,370	1,045,341.80	0.41
110	600827	百联股份	85,626	1,034,362.08	0.40
111	600565	迪马股份	156,100	1,008,406.00	0.39
112	600633	浙报传媒	66,000	992,640.00	0.39
113	600021	上海电力	94,900	974,623.00	0.38
114	600959	江苏有线	66,400	926,944.00	0.36
115	601155	新城控股	98,500	912,110.00	0.35
116	600064	南京高科	60,000	897,000.00	0.35
117	600026	中海发展	151,600	894,440.00	0.35
118	601928	凤凰传媒	84,799	893,781.46	0.35
119	600108	亚盛集团	172,700	872,135.00	0.34
120	600325	华发股份	77,777	860,991.39	0.33
121	600067	冠城大通	115,468	832,524.28	0.32
122	601608	中信重工	144,400	775,428.00	0.30
123	600773	西藏城投	48,361	757,816.87	0.29
124	601118	海南橡胶	130,700	730,613.00	0.28
125	600639	浦东金桥	28,420	709,931.60	0.28
126	600998	九州通	36,500	639,115.00	0.25
127	600807	天业股份	48,900	592,668.00	0.23
128	600053	九鼎投资	14,300	495,209.00	0.19
129	600606	绿地控股	40,500	438,210.00	0.17
130	600466	蓝光发展	47,500	406,600.00	0.16
131	601611	中国核建	7,210	150,833.20	0.06
132	601127	小康股份	3,690	88,080.30	0.03
133	603958	哈森股份	2,073	30,058.50	0.01
134	601966	玲珑轮胎	2,180	28,296.40	0.01
135	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
136	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600015	华夏银行	6,070,551.71	1.79

2	601901	方正证券	3,406,662.78	1.01
3	600585	海螺水泥	3,353,902.00	0.99
4	600690	青岛海尔	3,238,453.00	0.96
5	600009	上海机场	2,976,157.65	0.88
6	601888	中国国旅	2,453,332.00	0.72
7	600061	国投安信	2,124,474.00	0.63
8	600446	金证股份	2,003,948.67	0.59
9	600018	上港集团	1,886,218.00	0.56
10	600900	长江电力	1,880,641.98	0.56
11	600150	中国船舶	1,716,528.21	0.51
12	600079	人福医药	1,684,908.89	0.50
13	600074	保千里	1,580,303.00	0.47
14	600978	宜华生活	1,503,404.11	0.44
15	601377	兴业证券	1,276,886.52	0.38
16	601198	东兴证券	1,251,553.00	0.37
17	600655	豫园商城	1,242,246.14	0.37
18	600704	物产中大	1,231,023.00	0.36
19	600737	中粮屯河	1,224,699.00	0.36
20	600565	迪马股份	1,050,739.00	0.31

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601377	兴业证券	5,153,421.00	1.52
2	600029	南方航空	2,967,773.00	0.88
3	601727	上海电气	2,721,118.50	0.80
4	600867	通化东宝	2,340,638.64	0.69
5	601788	光大证券	2,321,675.00	0.69
6	600660	福耀玻璃	2,309,633.20	0.68
7	600309	万华化学	2,097,767.58	0.62
8	601919	中国远洋	1,966,097.50	0.58
9	600718	东软集团	1,949,993.63	0.58
10	600256	广汇能源	1,591,825.00	0.47
11	601992	金隅股份	1,205,109.50	0.36
12	601929	吉视传媒	1,069,325.64	0.32
13	600435	北方导航	1,030,570.84	0.30
14	600170	上海建工	990,324.00	0.29
15	600316	洪都航空	941,448.51	0.28
16	600597	光明乳业	925,055.00	0.27
17	600717	天津港	889,386.50	0.26
18	601808	中海油服	886,623.12	0.26

19	601588	北辰实业	774,024.00	0.23
20	600340	华夏幸福	705,154.00	0.21

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	54,050,036.29
卖出股票收入（成交）总额	52,030,129.16

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 根据方正证券股份有限公司 2015 年 9 月 12 日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，因公司涉嫌未按规定对客户的信息进行审查和了解，被中国证监会予以警告及行政处罚。

本基金为指数型基金，方正证券系标的指数成份券，该股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除方正证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,050.07
2	应收证券清算款	149,124.93
3	应收股利	-
4	应收利息	1,722.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	155,897.42

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额 额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	中国工商银行股份有限公司一易方达上证中盘

						交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,804	44,282.20	63,605,553.00	79.62%	16,279,536.00	20.38%	60,422,316.00	75.64%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	汇丰人寿保险有限公司—平衡增长投资账户	811,000.00	1.02%
2	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L—FH002 沪	622,454.00	0.78%
3	广发证券股份有限公司	589,473.00	0.74%
4	浙江华浙白马房地产开发有限公司	375,590.00	0.47%
5	汇丰人寿保险有限公司—积极进取投资账户	257,498.00	0.32%
6	朱亦德	232,276.00	0.29%
7	戴玲	231,568.00	0.29%
8	曹蕾	217,889.00	0.27%
9	付莉	206,368.00	0.26%
10	国信证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	177,195.00	0.22%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金	60,422,316.00	75.64%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 3 月 29 日）基金份额总额	2,752,478,065.00
本报告期期初基金份额总额	84,285,089.00
本报告期基金总申购份额	800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	79,885,089.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2016 年 4 月 30 日发布公告，自 2016 年 4 月 30 日起聘任詹余引先生担任公司董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚先生不再担任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	103,525,817.38	100.00%	96,414.66	100.00%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 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
中泰证券	344,681.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-04
2	易方达基金管理有限公司关于在指数熔断情况下调整旗下部分基金场内申赎等业务开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-05
3	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-07
4	易方达基金管理有限公司关于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	2016-01-28

		人网站	
5	易方达基金管理有限公司关于停止办理旗下部分交易型开放式指数基金场外基金份额之间转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-21
6	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
7	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
8	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
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 基金增加华宝证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-16

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一六年八月二十四日