# 易方达科翔股票型证券投资基金

## 2014 半年度 报告摘要

2014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：二〇一四年八月二十七日

### 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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2014年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

### 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 易方达科翔股票 |
| 基金主代码 | 110013 |
| 交易代码 | 110013 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年11月13日 |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 433,864,171.51份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于红利股，追求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，追求更高收益，回避市场风险。 |
| 业绩比较基准 | 80%×中证红利指数收益率+中债总指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。 |

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 | 赵会军 |
| | 联系电话 | 020-38797888 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | csc@efunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400 881 8088 | 95588 |
| 传真 | | 020-38799488 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 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 |

### 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(2014年1月1日至2014年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 8,297,572.18 |
| 本期利润 | -11,258,091.69 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0411 |
| 本期基金份额净值增长率 | -4.62% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2014年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4911 |
| 期末基金资产净值 | 536,802,053.78 |
| 期末基金份额净值 | 1.237 |

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.本基金已于2008年12月12日对原基金科翔退市时的基金份额进行了拆分，基金拆分比例为1:1.340278796。

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 | 4.30% | 0.69% | 1.05% | 0.72% | 3.25% | -0.03% |
| 过去三个月 | 6.45% | 0.88% | 0.09% | 0.76% | 6.36% | 0.12% |
| 过去六个月 | -4.62% | 1.21% | -0.61% | 0.86% | -4.01% | 0.35% |
| 过去一年 | 7.58% | 1.24% | 1.46% | 0.98% | 6.12% | 0.26% |
| 过去三年 | 2.96% | 1.27% | -20.82% | 1.04% | 23.78% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 78.93% | 1.34% | 22.52% | 1.29% | 56.41% | 0.05% |

3.2.2 自基金转型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

易方达科翔股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2008年11月13日至2014年6月30日）

注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为三个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十一部分二、投资范围，四、投资策略和五、投资限制）的有关约定。

2.本基金由原基金科翔于2008年11月13日转型而来。

3.自基金转型至报告期末，基金份额净值增长率为78.93%，同期业绩比较基准收益率为22.52%。

### 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、上海分公司和香港子公司、资产管理子公司。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2014年6月30日，易方达旗下共管理57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，资产管理总规模近2400亿元。

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 | | |
| 陈皓 | 本基金的基金经理、易方达平稳增长证券投资基金的基金经理 | 2014-05-10 | - | 7年 | 硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理。 |
| 付浩 | 本基金的基金经理 | 2011-01-01 | 2014-05-10 | 17年 | 硕士研究生，曾任广东粤财信托投资有限公司国际金融部职员，深圳和君创业研究咨询有限公司管理咨询项目经理，湖南证券投资银行总部项目经理，融通基金管理有限公司研究策划部研究员，易方达基金管理有限公司基金经理助理、易方达策略成长证券投资基金的基金经理、科瑞证券投资基金的基金经理。 |

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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5次，为纯被动指数基金因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

2014年年初的A股市场依然维持去年小盘、主题的投资风格。3月份开始，由于地产景气度下行，投资者对经济的预期极度悲观，市场风格开始转换，蓝筹股相对收益明显，而创业板指数一度下跌超过20%。直到中央开始出台各项"微刺激"政策，经济数据出现企稳迹象，到5月中下旬小盘股才开始逐步反弹。

由于中国经济增长中枢下移的趋势刚刚开始，中长期预期仍不清晰，但短期来看下行风险又比较有限，因此市场主题投资的结构性特征愈发明显。在存量博弈的A股，资金不断从过去几年表现优异的基金重仓股流出，追逐增速更高、空间更大的个股，教育、信息安全、新能源汽车等板块表现优异。另外，去年跌幅较大、几乎已被机构投资者抛弃的白酒、地产板块也迎来了一波收益可观的估值修复行情。

整个上半年，上证综指、深成指分别下跌3.20%、9.59%，创业板指数冲高回落，上涨了7.69%。

本基金前期以消费医药等蓝筹成长股为核心仓位，在年初白马股下跌过程中净值跌幅较大。后来在5月份做了较为明显的风格切换和个股调仓，大幅提升了软件、医药等中小市值成长股的比重，同时参与了部分主题投资，在市场反弹的过程中取得了一定的效果。

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1.237元，本报告期份额净值增长率为-4.62%，同期业绩比较基准收益率为-0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对下半年的市场，我们看法相对保守。由于地产的拖累，经济超预期上行有一定难度，且央行持续释放流动性的概率也不大。经过前期的调整，白马股的估值虽已降至合理水平，但能否取得绝对收益仍有疑问。而主题投资类的个股尽管拥有较大的市值空间，但是经过前期的上涨，股价已经透支太多，风险收益比已经明显降低。

因此三季度本基金将以中性偏低的仓位，更加注重风险收益比，同时进一步提升个股投资的准确性，争取为持有人带来一定的绝对收益。

综上所述，本基金希望通过管理人积极、勤勉的努力，为投资者奉献更加持续、稳定的回报。

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签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施的利润分配金额为15,592,820.41元。

### 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对易方达科翔股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，易方达科翔股票型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达科翔股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达科翔股票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15,592,820.41元。

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科翔股票型证券投资基金2014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：易方达科翔股票型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 31,623,221.09 | 14,652,495.35 |
| 结算备付金 | 2,241,308.81 | 747,616.13 |
| 存出保证金 | 295,456.96 | 243,431.81 |
| 交易性金融资产 | 411,930,897.61 | 341,662,914.14 |
| 其中：股票投资 | 386,883,897.61 | 325,273,914.14 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 25,047,000.00 | 16,389,000.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 118,014,459.01 | - |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 644,085.82 | 279,707.82 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 147,979.18 | 125,119.12 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 564,897,408.48 | 357,711,284.37 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2014年6月30日 | 上年度末 2013年12月31日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 23,961,836.65 | - |
| 应付赎回款 | 812,820.06 | 378,547.46 |
| 应付管理人报酬 | 491,290.66 | 440,899.70 |
| 应付托管费 | 81,881.78 | 73,483.29 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 759,754.45 | 661,178.38 |
| 应交税费 | 813,062.36 | 813,062.36 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 1,174,708.74 | 1,350,567.19 |
| 负债合计 | 28,095,354.70 | 3,717,738.38 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 323,711,328.39 | 194,511,437.31 |
| 未分配利润 | 213,090,725.39 | 159,482,108.68 |
| 所有者权益合计 | 536,802,053.78 | 353,993,545.99 |
| 负债和所有者权益总计 | 564,897,408.48 | 357,711,284.37 |

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.237元，基金份额总额433,864,171.51份。

6.2 利润表

会计主体：易方达科翔股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -5,630,794.06 | 36,693,052.62 |
| 1.利息收入 | 678,893.06 | 367,096.30 |
| 其中：存款利息收入 | 171,154.16 | 95,949.36 |
| 债券利息收入 | 273,405.63 | 229,789.09 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 234,333.27 | 41,357.85 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 13,215,262.84 | 39,453,230.10 |
| 其中：股票投资收益 | 12,286,640.35 | 37,683,683.47 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 36,200.00 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 892,422.49 | 1,769,546.63 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -19,555,663.87 | -3,175,843.78 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 30,713.91 | 48,570.00 |
| 减：二、费用 | 5,627,297.63 | 5,436,928.42 |
| 1.管理人报酬 | 2,497,526.69 | 2,459,161.48 |
| 2.托管费 | 416,254.45 | 409,860.16 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 2,517,513.22 | 2,371,796.08 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 196,003.27 | 196,110.70 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -11,258,091.69 | 31,256,124.20 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -11,258,091.69 | 31,256,124.20 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达科翔股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014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) | 194,511,437.31 | 159,482,108.68 | 353,993,545.99 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -11,258,091.69 | -11,258,091.69 |
| 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) | 129,199,891.08 | 80,459,528.81 | 209,659,419.89 |
| 其中：1.基金申购款 | 152,126,219.74 | 95,865,044.98 | 247,991,264.72 |
| 2.基金赎回款 | -22,926,328.66 | -15,405,516.17 | -38,331,844.83 |
| 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) | - | -15,592,820.41 | -15,592,820.41 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 323,711,328.39 | 213,090,725.39 | 536,802,053.78 |
| 项目 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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) | 213,368,634.11 | 111,901,966.92 | 325,270,601.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 31,256,124.20 | 31,256,124.20 |
| 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) | -18,451,029.37 | -12,170,174.36 | -30,621,203.73 |
| 其中：1.基金申购款 | 21,715,650.89 | 13,840,235.50 | 35,555,886.39 |
| 2.基金赎回款 | -40,166,680.26 | -26,010,409.86 | -66,177,090.12 |
| 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) | - | -11,400,195.68 | -11,400,195.68 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 194,917,604.74 | 119,587,721.08 | 314,505,325.82 |

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：叶俊英，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

易方达科翔股票型证券投资基金（简称"本基金"）由科翔证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1221号文《关于核准科翔证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》，科翔证券投资基金由封闭式基金转型为开放式基金，调整存续期限，终止上市交易，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为"易方达科翔股票型证券投资基金"。自2008年11月13日科翔证券投资基金在深圳证券交易所终止上市之日起，由《科翔证券投资基金基金合同》修订而成的《易方达科翔股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，注册登记机构为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")。

根据《易方达科翔股票型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》的有关规定，易方达基金管理有限公司于2008年12月12日对原基金科翔退市时的基金份额进行了份额拆分，拆分比例为1:1.340278796，并由注册登记机构进行了持有人份额的登记确认。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称"企业会计准则"）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2 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、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 |

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,497,526.69 | 2,459,161.48 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 229,036.26 | 219,968.92 |

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×1.5%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 416,254.45 | 409,860.16 |

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×0.25%/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；由基金管理人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 47,973,806.65 | 47,973,806.65 |
| 期间申购/买入总份额 | 181,667,217.18 | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 229,641,023.83 | 47,973,806.65 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 52.93% | 18.36% |

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

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末2014年6月30日 | | 上年度末2013年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 粤财信托 | 1,782,570.80 | 0.41% | 1,782,570.80 | 0.68% |
| 广发证券 | 2,034,821.38 | 0.47% | 2,034,821.38 | 0.78% |

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。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 | 31,623,221.09 | 156,169.94 | 32,183,575.08 | 83,059.44 |

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期 2014年1月1日至2014年6月30日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位：股/张) | 总金额 |
| 广发证券 | 600978 | 宜华木业 | 配股发行 | 120,000 | 483,600.00 |
| 广发证券 | 600089 | 特变电工 | 配股发行 | 197,604 | 1,363,467.60 |
| 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位：股/张) | 总金额 |
| - | - | - | - | - | - |

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.1受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 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 |
| 300387 | 富邦股份 | 2014-06-26 | 2014-07-02 | 新股流通受限 | 20.48 | 20.48 | 10,943 | 224,112.64 | 224,112.64 | - |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300253 | 卫宁软件 | 2014-05-28 | 重大事项 | 43.92 | 2014-08-01 | 37.50 | 319,250 | 12,880,630.43 | 14,021,460.00 | - |
| 002551 | 尚荣医疗 | 2014-06-12 | 重大事项 | 34.01 | - | - | 236,922 | 7,157,777.47 | 8,057,717.22 | - |
| 300199 | 翰宇药业 | 2014-02-20 | 重大事项 | 24.40 | 2014-08-20 | 29.00 | 360,000 | 5,865,680.70 | 8,784,000.00 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)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。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014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级的余额为356,020,720.39元，属于第二层级的余额为55,910,177.22元，无属于第三层级的余额(2013年12月31日：第一层级322,140,414.14元，第二层级19,522,500.00元，无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等交易不活跃情况、或属于非公开发行等情况，本基金于上述事项影响期间不将相关股票的公允价值列入第一层级；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级或第三层级。

(iv)第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金本报告期初未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2013年期初：同)；本基金本期净转入/(转出)第三层级0.00元(2013年度：无)。

(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 | 386,883,897.61 | 68.49 |
| | 其中：股票 | 386,883,897.61 | 68.49 |
| 2 | 固定收益投资 | 25,047,000.00 | 4.43 |
| | 其中：债券 | 25,047,000.00 | 4.43 |
| | 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 | 118,014,459.01 | 20.89 |
| | 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 | 33,864,529.90 | 5.99 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,087,521.96 | 0.19 |
| 8 | 合计 | 564,897,408.48 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 2,853,514.95 | 0.53 |
| B | 采矿业 | 1,390,400.00 | 0.26 |
| C | 制造业 | 260,883,761.94 | 48.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,726,821.46 | 2.00 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 14,580,000.00 | 2.72 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,037,044.03 | 0.38 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 83,126,214.43 | 15.49 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 8,520,740.80 | 1.59 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,126,400.00 | 0.40 |
| 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 | 639,000.00 | 0.12 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 386,883,897.61 | 72.07 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300238 | 冠昊生物 | 539,804 | 27,454,431.44 | 5.11 |
| 2 | 600967 | 北方创业 | 2,184,354 | 27,413,642.70 | 5.11 |
| 3 | 300170 | 汉得信息 | 1,977,918 | 25,515,142.20 | 4.75 |
| 4 | 600867 | 通化东宝 | 1,795,968 | 23,401,463.04 | 4.36 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 600,000 | 19,872,000.00 | 3.70 |
| 6 | 600351 | 亚宝药业 | 1,603,171 | 14,749,173.20 | 2.75 |
| 7 | 000963 | 华东医药 | 270,000 | 14,580,000.00 | 2.72 |
| 8 | 300253 | 卫宁软件 | 319,250 | 14,021,460.00 | 2.61 |
| 9 | 300207 | 欣旺达 | 423,042 | 12,352,826.40 | 2.30 |
| 10 | 300003 | 乐普医疗 | 539,999 | 11,285,979.10 | 2.10 |

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

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 | 300238 | 冠昊生物 | 35,064,470.63 | 9.91 |
| 2 | 600967 | 北方创业 | 29,440,377.48 | 8.32 |
| 3 | 300170 | 汉得信息 | 24,294,600.88 | 6.86 |
| 4 | 600867 | 通化东宝 | 22,554,849.97 | 6.37 |
| 5 | 300315 | 掌趣科技 | 22,024,682.54 | 6.22 |
| 6 | 300017 | 网宿科技 | 16,884,910.35 | 4.77 |
| 7 | 600587 | 新华医疗 | 16,535,792.24 | 4.67 |
| 8 | 600517 | 置信电气 | 15,625,649.89 | 4.41 |
| 9 | 600315 | 上海家化 | 15,460,300.53 | 4.37 |
| 10 | 600196 | 复星医药 | 15,436,941.48 | 4.36 |
| 11 | 600351 | 亚宝药业 | 14,561,437.41 | 4.11 |
| 12 | 000538 | 云南白药 | 14,292,772.04 | 4.04 |
| 13 | 300253 | 卫宁软件 | 12,880,630.43 | 3.64 |
| 14 | 300058 | 蓝色光标 | 12,844,201.47 | 3.63 |
| 15 | 600763 | 通策医疗 | 12,467,136.19 | 3.52 |
| 16 | 600887 | 伊利股份 | 11,888,856.69 | 3.36 |
| 17 | 300207 | 欣旺达 | 11,677,081.38 | 3.30 |
| 18 | 000513 | 丽珠集团 | 11,371,433.57 | 3.21 |
| 19 | 600624 | 复旦复华 | 11,230,134.32 | 3.17 |
| 20 | 002701 | 奥瑞金 | 10,914,307.87 | 3.08 |
| 21 | 000712 | 锦龙股份 | 10,789,032.96 | 3.05 |
| 22 | 002551 | 尚荣医疗 | 10,788,708.87 | 3.05 |
| 23 | 300003 | 乐普医疗 | 10,689,655.38 | 3.02 |
| 24 | 002609 | 捷顺科技 | 10,548,723.28 | 2.98 |
| 25 | 300226 | 上海钢联 | 10,515,287.18 | 2.97 |
| 26 | 002236 | 大华股份 | 10,257,922.59 | 2.90 |
| 27 | 600583 | 海油工程 | 10,064,881.81 | 2.84 |
| 28 | 600109 | 国金证券 | 9,908,725.89 | 2.80 |
| 29 | 000858 | 五粮液 | 9,663,098.00 | 2.73 |
| 30 | 000963 | 华东医药 | 9,286,521.67 | 2.62 |
| 31 | 600585 | 海螺水泥 | 9,199,677.49 | 2.60 |
| 32 | 002390 | 信邦制药 | 9,108,490.91 | 2.57 |
| 33 | 002008 | 大族激光 | 8,938,341.29 | 2.53 |
| 34 | 300142 | 沃森生物 | 8,352,867.70 | 2.36 |
| 35 | 600436 | 片仔癀 | 8,314,205.38 | 2.35 |
| 36 | 000049 | 德赛电池 | 8,239,441.97 | 2.33 |
| 37 | 002030 | 达安基因 | 7,571,940.63 | 2.14 |
| 38 | 300008 | 上海佳豪 | 7,476,621.93 | 2.11 |
| 39 | 002065 | 东华软件 | 7,133,018.21 | 2.02 |

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 | 000538 | 云南白药 | 37,713,201.86 | 10.65 |
| 2 | 002236 | 大华股份 | 26,807,923.69 | 7.57 |
| 3 | 002400 | 省广股份 | 22,088,000.96 | 6.24 |
| 4 | 300017 | 网宿科技 | 21,854,862.15 | 6.17 |
| 5 | 002008 | 大族激光 | 21,717,708.26 | 6.14 |
| 6 | 300315 | 掌趣科技 | 21,569,791.66 | 6.09 |
| 7 | 000049 | 德赛电池 | 20,644,911.49 | 5.83 |
| 8 | 300058 | 蓝色光标 | 17,203,741.93 | 4.86 |
| 9 | 002415 | 海康威视 | 16,889,249.63 | 4.77 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 16,339,760.08 | 4.62 |
| 11 | 600517 | 置信电气 | 15,834,414.50 | 4.47 |
| 12 | 600196 | 复星医药 | 15,275,046.01 | 4.32 |
| 13 | 600481 | 双良节能 | 13,890,538.66 | 3.92 |
| 14 | 600315 | 上海家化 | 13,398,594.67 | 3.78 |
| 15 | 600600 | 青岛啤酒 | 13,147,244.62 | 3.71 |
| 16 | 600089 | 特变电工 | 12,948,321.38 | 3.66 |
| 17 | 002701 | 奥瑞金 | 11,056,724.59 | 3.12 |
| 18 | 600624 | 复旦复华 | 10,949,863.97 | 3.09 |
| 19 | 002456 | 欧菲光 | 10,320,961.51 | 2.92 |
| 20 | 600983 | 合肥三洋 | 10,005,029.26 | 2.83 |
| 21 | 600763 | 通策医疗 | 9,868,245.10 | 2.79 |
| 22 | 300238 | 冠昊生物 | 9,632,661.11 | 2.72 |
| 23 | 600109 | 国金证券 | 9,571,479.46 | 2.70 |
| 24 | 600583 | 海油工程 | 9,479,625.92 | 2.68 |
| 25 | 000858 | 五粮液 | 9,136,927.55 | 2.58 |
| 26 | 000998 | 隆平高科 | 8,696,426.47 | 2.46 |
| 27 | 600585 | 海螺水泥 | 8,414,276.51 | 2.38 |
| 28 | 002202 | 金风科技 | 8,363,846.80 | 2.36 |
| 29 | 300142 | 沃森生物 | 8,029,066.73 | 2.27 |
| 30 | 000895 | 双汇发展 | 7,994,656.50 | 2.26 |
| 31 | 300228 | 富瑞特装 | 7,990,597.69 | 2.26 |
| 32 | 002019 | 鑫富药业 | 7,704,463.00 | 2.18 |
| 33 | 300273 | 和佳股份 | 7,444,277.18 | 2.10 |
| 34 | 600436 | 片仔癀 | 7,439,491.03 | 2.10 |
| 35 | 600597 | 光明乳业 | 7,341,383.73 | 2.07 |
| 36 | 000423 | 东阿阿胶 | 7,136,266.01 | 2.02 |

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 | 873,137,480.89 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 804,194,063.90 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 25,047,000.00 | 4.67 |
| | 其中：政策性金融债 | 25,047,000.00 | 4.67 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 25,047,000.00 | 4.67 |

7.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 140410 | 14农发10 | 150,000 | 15,045,000.00 | 2.80 |
| 2 | 130236 | 13国开36 | 100,000 | 10,002,000.00 | 1.86 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 295,456.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 644,085.82 |
| 5 | 应收申购款 | 147,979.18 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,087,521.96 |

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300253 | 卫宁软件 | 14,021,460.00 | 2.61 | 重大事项停牌 |

### 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 22,732 | 19,086.05 | 241,579,860.07 | 55.68% | 192,284,311.44 | 44.32% |

注：持有人户数含未确权的原持有人户数。

8.2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 | 364,033.19 | 0.0839% |

8.3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 |

### 9开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2008年11月13日)基金份额总额 | 800,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 260,719,874.82 |
| 本报告期基金总申购份额 | 203,874,989.68 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 30,730,692.99 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 433,864,171.51 |

### 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称"中国工商银行"）工作需要，周月秋同志不再担任资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使中国工商银行资产托管部总经理部分业务授权职责。

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 | |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | 1,380,718,771.20 | 82.46% | 1,257,006.59 | 82.46% | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | 104,553,301.07 | 6.24% | 95,184.80 | 6.24% | - |
| 申银万国 | 1 | 146,708,555.44 | 8.76% | 133,563.53 | 8.76% | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | 13,624,949.04 | 0.81% | 12,404.22 | 0.81% | - |
| 中信建投 | 2 | 28,797,189.61 | 1.72% | 26,217.04 | 1.72% | - |

注：a) 本报告期内本基金无新增和减少交易单元。

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

1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；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。

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 |
| 长江证券 | - | - | 460,000,000.00 | 100.00% | - | - |

易方达基金管理有限公司

二〇一四年八月二十七日