金额单位:人民币元

基金管理人:易方达基金管理有限公司基金托管人:中国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

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的招募说明书及其更新。 本半年度报告撤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	2 坐並同月			
基金简称	35577 11096	易方达策略成长二号混合			
基金主代码		112002			
交易代码		112002			
基金运作方式		契约型开放式			
基金合同生效日		2006年8月16日			
基金管理人		易方达基金管理有限公司			
基金托管人		中国银行股份有限公			
报告期末基金份额点	总额	2,350,357,234.27 份			
基金合同存续期		不定期			
2.2 基金产品	品说明				
投资目标		本基金通过投资兼具较高内在价值和良好成长性的股票,积极把握股票市场波动所带来获利机会,努力为基金份额持有人追求较高的中长期资本增值。			
投资策略	对稳定的资产配置 力量为依托,通过 成长性的股票,并	本基金投资的总体原则是在价值区域内把握波动,在波动中实现研究的 盤价"。基金采 对稳定的势产配置警路。避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。同时,以趋厚的 力量为保托,通过以价值成长比率 PPG )分核心的系统方法前途出海其段高价在价值及 成长性的股票,并通过对相关行业和上市公司成长率变化的动态预测,积极把握行业体 一条物币违规运动所带来的逐渐解制会。从基金特有人追求挖窗中。当购收备及长期除出格性			

» spacy Amery m.	基金。		
2.3 基金管	理人和基金托	管人	
IJ	ίΒ	基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
	姓名	张南	王永民
信息披露负责人	联系电话	020-38797888	010-66594896
, ,	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	feid@bankofehina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
tt:dr		020.20700400	010 66504042

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网加 基金半年度报告备置地点

3 主要财务指标和基金净值表现

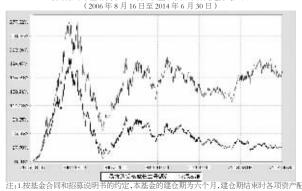
3.1.1 期间数据和指标	报告期 2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	240,532,528.29
本期利润	-230,510,767.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0898
本期基金份额净值增长率	-5.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0966
期末基金资产净值	3,456,339,715.54
期末基金份额净值	1.471

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

3.2 基金净值表现

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	收益率的比较 业绩比较基准 收益率标准差 ④	1)-3)	2-4
过去一个月	2.58%	0.81%	0.42%	0.51%	2.16%	0.30%
过去三个月	1.80%	0.92%	0.82%	0.58%	0.98%	0.34%
过去六个月	-5.10%	1.13%	-1.91%	0.67%	-3.19%	0.46%
过去一年	7.22%	1.09%	3.37%	0.74%	3.85%	0.35%
过去三年	5.00%	1.03%	-16.79%	0.83%	21.79%	0.20%
自基金合同生效起 至今	179.95%	1.51%	28.20%	1.30%	151.75%	0.21%
3.2.2 自基金动的比较	合同生效以来	K基金份额累	计净值增长率	※変动及其与同	司期业绩比较	基准收益率

易方达策略成长二号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



置比例符合基金合同(第十四部分(二)投资范围、(四)投资策略和(七)投资禁止行为与限制) 2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为179.95%,同期业绩比较基准收益率为

## 4 管理人报告

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
乘"取信于市场,取信于社会"的宗旨。坚持"在诚信规范的前提下,通过专业化运作和别为合疾
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(QDI)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3 7 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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

的基金经里研究 福祉经理 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万业协会《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》等有关注律法规及基金合同、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应用基金资产,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
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积度管理制度,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横块,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。
4.32 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是超过访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。

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。
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费表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运费表现的说明
4.2 工业品还是消费品增速都出现一定程度的下降,一季度PML发电量等经济数据增速下降尤为明显。一季度政府采取定向放松和微调的方式刺激经济。PMI指数显示经济出现温和复苏。上半年经济活动当中的两个特别情况是。首先,与往年不同的是今年房地产销售持续低迷、使得国内制造业"去产能"和"去杠杆"的进程更加缓慢。其次,后周期的大众消费品收入增速也开始变度。在宏观经济增速级设的背景下、社会资本从前几年的资源品和工业品发步加速流向上外级变度。在宏观经济增速级设的背景下、社会资本从前几年的资源品和工业品发步加速流向发步级的发行。在实现方面,在一级市场也表现为多数行业股票指数表现低迷,而少数高增长行业。在二级市场也表现为多数行业股票指数表现低迷,而少数高增长行业的估值水平被资金不断治高,投资者的风险偏好也在不断提高,诸如基因检测、游戏等不确定性很高的行业得到市场的热捧。 性很高的行业得到市场的热捧。

在基金在上半年配置保持稳健的操作风格,组合构造以"大健康、大消费"为核心配置,继续持有医药和消费品,适当降低传统制造业的配置,增持包括新能源汽车在内的一些新兴产业。 4.42 报告期内基金的业绩表现 最至报告期末,本基金份额净值为1.471元,本报告期份额净值增长率为-5.10%,同期业绩比

截至报告期末,本基金份额净值为 1.471 元,全放百州1700(平10-10) 1.470 元,200 较基相收益率为 -1.91%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望 2014 年下半年、经济增长依然存在压力,预计政府主要依靠改革释放增长动力,同时有可能采取"降息降准"的方式对经济进行微调。但经济的温和复苏并不会改变经济转型的大格局,房地产销售形势是判断近期经济走势的重要变量。从目前房地产价格和消费者信心来看,预计房地产销售不容乐观。这势必影响到这一轮经济复苏的力度。同时也影响到地方政府债务问题和利率的,对投资产业链的相关行业依然保持董慎,适当关注一些由于供给压缩从而使得供需格局变率的以对投资产业链的相关行业依然保持董慎,适当关注一些由于供给压缩从而使得供需格局变率的工业品。与此同时,消费品和医药行业经过上半年的调整,市场预期也回落到较低的水平,但龙头公司的核心竞争力并没有发生变化、对于这类企业我们将继续坚定持有。此外、对于新兴行业的成长股,由于过多的资金追逐使得这些公司总体估值水平过高,需要去伪存真发现真正的成长股,同时还要证水、等待会话的出价。

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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对易方达策略成长二号混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

行了应尽的义务。
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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额性生工4年经6至34

八州通时(T/A)。 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 本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融

# 易方达策略成长二号混合型证券投资基金

工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。 6 半年度财务会计报告(未经审计)

···· 吳 吳 吳 吳 会计主体: 易方达策略成长二号混合型证券投资基金 报告截止日: 2014 年 6 月 30 日

	本期末	- 早祉:人民印 ├年度末
资产	2014年 6 月 30 日	2013年12月31日
资产:		
银行存款	80,314,026.42	46,718,326.86
结算备付金	402,166.57	3,548,429.14
存出保证金	573,989.48	575,609.16
交易性金融资产	3,131,443,879.65	4,386,033,419.94
其中:股票投资	2,961,269,879.65	4,046,091,019.94
基金投资	_	_
债券投资	170,174,000.00	339,942,400.00
资产支持证券投资	_	_
贵金属投资	_	-
衍生金融资产	_	-
买人返售金融资产	249,741,238.07	356,518,038.51
应收证券清算款	_	18,581,887.23
应收利息	5,734,391.32	7,004,915.85
应收股利	_	_
应收申购款	108,510.47	346,053.15
递延所得税资产	_	_
其他资产	_	_
资产总计	3,468,318,201.98	4,819,326,679.84
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	_	4,141.72
应付赎回款	3,708,759.28	7,785,823.37
应付管理人报酬	4,179,135.92	6,039,085.12
应付托管费	696,522.65	1,006,514.17
应付销售服务费	_	_
应付交易费用	636,667.32	1,621,666.40
应交税费	1,803,754.10	1,803,754.10
应付利息	_	_
应付利润	_	_
递延所得税负债	_	_
其他负债	953.647.17	1,160,980.62
负债合计	11,978,486.44	19,421,965.50
所有者权益:	11,070,100.11	,.21,700.00
实收基金	2,350,357,234.27	3,097,631,487.87
未分配利润	1,105,982,481.27	1,702,273,226.47
所有者权益合计	3,456,339,715.54	4,799,904,714.34
负债和所有者权益总计	3,468,318,201.98	4,819,326,679.84
	0日,基金份额净值 1.471 元,基金	

6.2 利润表 会计主体:易方达策略成长二号混合型证券投资基金 本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

13843311	-73	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	-193,559,323.23	311,607,885.85		
1.利息收入	7,406,470.59	6,165,409.09		
其中:存款利息收入	710,598.64	603,909.93		
债券利息收入	5,572,406.03	4,707,954.08		
资产支持证券利息收入	-	-		
买人返售金融资产收入	1,123,465.92	853,545.08		
其他利息收入	-	-		
2.投资收益 假失以""填列)	269,082,789.73	2,675,707.31		
其中:股票投资收益	231,812,493.06	-26,141,475.57		
基金投资收益	-	-		
债券投资收益	-609,629.73	-805,039.86		
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	37,879,926.40	29,622,222.74		
3.公允价值变动收益 钡失以""号填列)	-471,043,295.35	302,739,731.33		
4.汇兑收益 {损失以 ="号填列)	-	-		
5.其他收入 { 损失以 ""号填列)	994,711.80	27,038.12		
减:二、费用	36,951,443.83	39,647,117.65		
1.管理人报酬	28,365,444.56	30,239,773.63		
2.托管费	4,727,574.10	5,039,962.36		
3.销售服务费	-	-		
4.交易费用	3,612,682.51	4,117,121.46		
5.利息支出	-	-		
其中:卖出回购金融资产支出	-	-		
6.其他费用	245,742.66	250,260.20		
三、利润总额 (亏损总额以""号填列)	-230,510,767.06	271,960,768.20		
减:所得税费用	-	-		
四、净利润(净亏损以""号填列)	-230,510,767.06	271,960,768.20		

		单位:人民币:	
2014	本期 年1月1日至2014年6月30	E E	
实收基金	未分配利润	所有者权益合计	
3,097,631,487.87	1,702,273,226.47	4,799,904,714.3	
-	-230,510,767.06	-230,510,767.00	
-747,274,253.60	-365,779,978.14	-1,113,054,231.7-	
28,455,586.74	13,959,998.10	42,415,584.84	
-775,729,840.34	-379,739,976.24	-1,155,469,816.5	
-	-		
2,350,357,234.27	1,105,982,481.27	3,456,339,715.5	
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	
2,989,252,726.00	847,628,866.22	3,836,881,592.22	
-	271,960,768.20	271,960,768.20	
-33,721,311.30	-19,932,737.07	-53,654,048.3	
179,045,654.80	64,589,949.56	243,635,604.36	
-212,766,966.10	-84,522,686.63	-297,289,652.73	
-	-		
2,955,531,414.70	1,099,656,897.35	4,055,188,312.05	
	实收基金 3.097,631,487.87 - -747,274,253.60 28,455,586.74 -775,729,840.34 - 2,350,357,234.27 2013 实收基金 2,989,252,726.00 - - -33,721,311.30 179,045,654.80 -212,766,966.10	本期 2014年 1 月 1 日至2014年 6 月 30 実改基金 未分配利润 3,097,631,487.87 1,702,273,226.47	

报表附注为财务报表的组成部分。 本报告61至64,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

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 8.7 法策略成长二号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") 证据基金字(2006)150 号文件(关于核准易方达策略成长二号混合型证券投资基金募集的批复)和《关于易方达策略成长二号混合型证券投资基金募集的批复)和《关于易方达策略成长二号混合型证券投资基金募集时间安排的确认图》(基金等集的批复)和《关于易产达策略成长二号混合型证券投资基金募集时间安排的确认图》(基金部国(2006)186 号)的核准,由易方达基金管理有限公司按照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达路晚成长二号混合型证券投资基金会合同》向社会公开募集。经向中国证券投资基金法》和《易方达路路位等。 经申请证券投资基金份额。 本基金基金合同于 2006 年 08 月 16 日正式生效、基金合同生效日的基金份额总额为 3.657,110,813,08 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,注册登记机构分易方达基金管理有限公司,注册登记机构分易方达基金管理有限公司,扩展登记机构分易方达基金管理有限公司,并是分价有限公司。本教学和发表按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则》——基本准则》和 38 项具体会计推则,其后颁布的应用指南、源释设为生物,发促发基金业协会修订并发布的《证券投资基金台总披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金台总披露等》(证券投资基金信息披露等加大法》、《证券投资基金信息披露等编报规则》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等编报规则》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等和发生。《全计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露等编报规则》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等》、《证券投资基金信息披露等》、《证书报表附注的编制及披露》、《证书报表附注的编制及按露》、《证书报表附注的编制及按露》、《证书报表附述,《证书报表》、《证书报表明表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书报表记录》、《证书记录》、证书记录》、《证书记录》、《证书记录》、证书记录》、证书记录》、《证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、证书记录》、

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对情况等有关信息。
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 税项

6.4.6.1 印代配 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,暂备企业的证据

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)目号文《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、债务的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税;根据财政部、国家税务总局财税分[2005][03]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。

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问基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴

2014 半年度 报告摘要

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,其股息红利所得金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、营藏按 50%计人应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂减按 25%计人应纳税所得额。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、未报告期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
中国银行股份有限公司 (以下简称 中国银行")	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
注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业务	款订立。
(40 木坦生期及上午度可以期间的关联方式目	

0.4.8 平100亩州及上牛皮可比期间的关联 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

金额单位:人民币元 +及りに別同 2013年1月1日至2013年6月30日 2014年1月1日至2014年6月30日 关联方名称 成交金额 成交金额

6.4.8.1.2 权证 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

6.4.8.1.3 应义下大	<b>状</b> 刀的'用金					
			金	· 额单位:人民币元		
			本期			
关联方名称		2014年1月1	日至2014年6月30日			
大吹刀石帆	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余額	占期末应付佣金总 额的比例		
广发证券	445,954.26	23.37%	236,828.41	37.93%		
	上年度可比期间					
关联方名称	2013年1月1日至2013年6月30日					
大吹刀石帆	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余額	占期末应付佣金总 额的比例		
广发证券	270,960.69	11.09%	21,976.78	1.62%		
注:上述佣金按市場	汤佣金率计算,以扣附	自中国证券到	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	商承扣的证券结算及	《除基金后的》	争额列示。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

6.4.8.2.1 基金管理费		单位:人民币5
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	28,365,444.56	30,239,773.63
其中:支付销售机构的客户维护费	2,703,962.28	2,991,036.65
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=E×1.5%/ 3年-大叔 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十个工作日内 从基金资产中一次性支付给基金管理人。 6.48.2.2 基金托管费

单位:人民币元 2014年1月1日至2014年6月30 2013年1月1日至2013年6月30 4,72,734-10] 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% 当年天教 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

上 方削一日的基金資产申值 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十个工作日内 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 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 +40亿世纪专行。

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 6.4.8.4.2 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

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

				中世:八尺川川			
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			
中国银行	80,314,026.42	693,218.97	73,766,688.92	579,624.89			
注:本基金的银行存款由基金托管人中国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							
木其全木均生期及上午申	可い相同また	承绌 加力 糸 口 土 旺	古承绌证券				

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流涌受限证券 金额单位:人民币元 12.20 12.20

期末 估值总额 成本总额 江淮汽 2014-车 04-14 重大事项 10.24 2014-07-11 11.22 9,900,000 91,621,959.31

6.49.3. 别杰顶券正凹购父易平下为东州的顶券 6.49.3.1 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。 6.49.3.2 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。

(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

(5)於公元501萬(4) 無所並能上來 仍金離工具公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的輸入值,公允价值层级可分为: 報上层级,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

(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 2.858.933.879.65 元. 属于第二层级的余额为 271.550,000.00 元. 无属于第三层 级的余额约。2858.938.1000.00 元. 无属于第二层级的余额为 271.550,000.00 元. 无属于第三层 级的余额(2013 年 12 月 31 日 : 第一层级 4,047,102,419.94 元. 第二层级 338,931,000.00 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

(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人第一层级;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 本基金本报告期初末特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 等转入/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

	其中:股票				2,961,269,879.0	65	85.38
2	固定收益投资				170,174,000.0	00	4.91
	其中:债券				170,174,000.0	00	4.91
	资产支持证券					-	_
3	贵金属投资					-	-
4	金融衍生品投资					-	-
5	买人返售金融	资产			249,741,238.0	07	7.20
	其中:买断式回	]购的买人返售金融资产	bs.			-	-
6	银行存款和结算	算备付金合计			80,716,192.9	99	2.33
7	其他各项资产				6,416,891.2	27	0.19
8	合计				3,468,318,201.9	98	100.00
7.2 报	告期末按行业	2分类的股票投资组	EI 合				
代码	行业类别			2	允价值 玩)	占差	基金资产净值比例 %)
A	农、林、牧、渔业	4			-		-
В	采矿业				-		-
С	制造业				2,394,384,679.26		69.28
D	电力、热力、燃	气及水生产和供应业		30,556,829.04			0.88
E	建筑业				-		-
F	批发和零售业			233,360,376.50			6.75
G	交通运输、仓储	皆和邮政业		-			-
Н	住宿和餐饮业				-		-
I	信息传输、软件	:和信息技术服务业			10,835,394.85		0.31
J	金融业				-		-
K	房地产业				90,612,000.00		2.62
L	租赁和商务服务	务业		168,864,600.00			4.89
M	科学研究和技术	术服务业		-			-
N	水利、环境和公	共设施管理业		-			-
0	居民服务、修理	即和其他服务业		-			_
P	教育			-			-
Q	卫生和社会工作			32,656,000.00			0.94
R	文化、体育和娱乐业			-		-	
S	综合	综合			-		-
	合计				2,961,269,879.65		85.68
7.3 期	末按公允价值	[占基金资产净值]	比例大小扌	非序的	前十名股票投资	明细	
							金额单位:人民币:
/묵	股票代码	股票名称	数量	(BG)	公允价值		占基金资产净值比例
1	10C7T(1CH)						

311,328,000.0 600887 9,400,000 000651 002400 6.870.000 168,864,600,00 4.89 600315 4,408,10 161,556,865.00 300147 600066 154,163,250.0 8,800,000 宇通客车 142,032,000.0 600535 000895 3,550,000 137,633,500.00

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 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净 值比例 %)
1	600580	卧龙电气	79,225,539.32	1.65
2	603288	海天味业	48,116,184.18	1.00
3	600517	置信电气	44,881,462.67	0.94
4	002390	信邦制药	43,672,803.36	0.91
5	002385	大北农	38,373,832.29	0.80
6	002206	海利得	37,855,598.13	0.79
7	000669	金鸿能源	37,666,848.41	0.78
8	300222	科大智能	37,601,497.42	0.78
9	000538	云南白药	27,015,480.51	0.56
10	000895	双汇发展	26,403,357.40	0.55
11	000501	鄂武商 A	22,666,404.22	0.47
12	600887	伊利股份	20,171,246.16	0.42
13	002427	尤夫股份	18,592,237.51	0.39
14	002215	诺普信	17,619,875.12	0.37
15	000651	格力电器	17,436,890.95	0.36
16	000661	长春高新	15,130,664.25	0.32
17	600884	杉杉股份	12,683,309.72	0.26
18	600511	国药股份	10,182,177.38	0.21
19	002437	誉衡药业	10,181,834.35	0.21
20	002065	东华软件	9,481,623.44	0.20
注.可	人全知按正寺市る	ぐ会姉(成な角体振じ)	成态数量)情别 不老虑相关态	易费田

在: 天人壶额按头类成父壶额(成父单)[乘以成父数重]填列,不考虑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

			35	到甲世:人民用刀
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	000651	格力电器	219,383,876.82	4.57
2	000963	华东医药	111,384,224.96	2.32
3	600887	伊利股份	88,373,111.78	1.84
4	600600	青岛啤酒	87,221,381.06	1.82
5	300206	理邦仪器	62,877,130.89	1.31
6	600340	华夏幸福	62,040,842.80	1.29
7	002081	金螳螂	59,797,788.47	1.25
8	002215	诺普信	53,618,782.30	1.12
9	000729	燕京啤酒	50,488,395.51	1.05
10	600276	恒瑞医药	49,205,731.84	1.03
11	600066	宇通客车	46,970,444.43	0.98
12	000538	云南白药	46,778,745.83	0.97
13	002391	长青股份	41,296,642.35	0.86
14	600517	置信电气	41,287,122.81	0.86
15	601208	东材科技	40,822,448.03	0.85
16	600309	万华化学	38,042,079.00	0.79
17	000028	国药一致	35,280,635.02	0.74
18	600418	江淮汽车	33,683,849.23	0.70
19	600690	青岛海尔	29,421,327.78	0.61

300273 和能股份 26,405,801.29 会额按买卖成交金额(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

i.	中世:八尺川
买人股票成本 成交 )总额	626,174,847.46
卖出股票收入 娀交 贮额	1,470,079,033.68
注: "买人股票成本" 或 "卖出股票收入" 均接	5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	

债券名称 数量(张) 14国开 04

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 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 本基金本报告期末末持有贵金属。 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区债期货交易情况说明 本基金本报告期末未投资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 投资银分份告悔许

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

制日前一年內受到公开谴责。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

5,734,391.3 6,416,891.2

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

0.1 州水坐亚闪电	KIJ.H /C) 3X/X	14.H	/\>0129			1	分额单位:6	
		持有人结构						
持有人户数(户)	户均持有的基金		机构投资者		个人投资者		ž	
1寸有八/女(/-)	份额		持有份额	占总份额比 例	抖	持有份额	占总份额比 例	
115,303	20,384.13	8	34,458,712.54	1.47%	2,	315,898,521.73	98.53%	
8.2 期末基金管理	人的从业人员	持有四	本基金的情况					
项目			持有份额总数(分) 占基金总份			份额比例		
基金管理人所有从业人员持有本基金			449,578.48 0.01919					
8.3 期末基金管理	人的从业人员	持有四	下放式基金位	分额总量区间	的情况	兄		
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		10~50						

9 开放式基金份额变动 单位:份 基金合同生效日 2006年8月16日)基金 3,097,631,487.8 775,729,840.3 本报告期期末基金份额总额 2,350,357,234.27 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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。 2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任中国

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,目2014年2月13日起, 予股份有限公司行长。 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 基金投资策略的变变 本报告期内本基金的投资策略去有重大变化。

105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。 106 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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

券商名称		股票交易		应支付该券商的佣金		位:人民市	
	交易单 元数量	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	备注	
中信建投	1	-	-	-	-	-	
广发证券	2	489,843,245.87	23.37%	445,954.26	23.37%	-	
中信证券	2	254,967,366.17	12.17%	232,121.22	12.17%	-	
国泰君安	2	-	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	-	
银河证券	1	-	-	-	-	-	
中金公司	1	-	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	-	
申银万国	1	616,512,950.46	29.42%	561,275.78	29.42%	-	
招商证券	1	115,880,239.47	5.53%	105,497.64	5.53%	-	
高华证券	1	120,797,208.37	5.76%	109,973.83	5.76%	-	
国元证券	1	-	-	-	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	-	
产品证券	1	407 970 166 97	22.750	452 260 81	22.750		

广州证券 1 497.870,166.87 23.75% 453,260.81 23.75% - 注:a) 本报告期内本基金无新增交易单元,减少日信证券有限责任公司一个交易单: 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:

6 盆並又勿爭儿的功息伊程庁如下:
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

10.7.2 茲並作	1用证券公司>	(勿毕儿近1.	1共他此分12	. 页的用亿	金额单	单位:人民币元
	债券交	债券交易 债		购交易	权证交	易
券商名称	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
广州证券	1,007,065.21	100.00%	-	-	-	-
					日七十十十	笠田 ち四ハヨ

二〇一四年八月二十七日