（上接B70版）

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系人：单丙烨
电话：021-20691832
传真：021-20691861
客服电话：400-820-2899
公司网站：www.erichfund.com
(139) 创金启富
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人：梁蓉
联系人：张旭
电话：010-66154828
传真：010-88067526
客户服务电话：400-6262-818
公司网站：www.5irich.com
(140) 泛华普益
注册地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址：四川省成都市锦江区下东大街216号喜年广场A座1502室
法定代表人：于海锋
联系人：邓鹏
联系电话：028-86745400
客户服务电话：4008-588-588
传真：028-82000996-805
公司网址：www.pyfund.cn
(141) 海银基金
注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼
法定代表人：刘惠
联系人：刘艳妮
电话：021-80133827
传真：021-80133413
客户服务电话：400-808-1016
公司网站：www.fundhaiyin.com
(142) 好买基金
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
联系电话：021-20613600
客户服务电话：400-700-9665
传真：021-68596916
网址：www.ehowbuy.com
(143) 和讯信息
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：于杨
电话：021-20835779
传真：021-20835879
客户服务电话：400-920-0022
公司网站：http://licaike.hexun.com/
(144) 恒天明泽
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人：梁越
联系人：马鹏程
电话：010-57756074
传真：010-57756199
客户服务电话：4008-980-618
公司网站：www.chtfund.com
(145) 汇付金融
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19层
法定代表人：冯修敏
联系人：陈云卉
电话：021-33323999
传真：021-33323837
客户服务电话：400-820-2819
公司网站：fund.bundtrade.com
(146) 积木基金
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号温特莱中心16层
法定代表人：董浩
联系人：于婷婷
电话：010-56409010
客户服务电话：400-068-1176
公司网站：www.jimufund.com
(147) 济安财富
注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号 财富中心A座46层 济安财富
法定代表人：杨健
联系人：李海燕
电话：010-65309516
传真：010-65330699
客户服务电话：400-075-6663（济安财富官网） 400-071-6766（腾讯财经）
公司网站：www.jianfortune.com
(148) 金观诚
注册地址：杭州拱墅区登云路43号金诚集团（锦昌大厦）1幢10楼1001室
办公地址：杭州拱墅区登云路55号金诚集团（锦昌大厦）
法定代表人：徐黎云
联系人：来舒岚
电话：0571-88337888
传真：0571-88337666
客户服务电话：4000680058
公司网站：http://www.jincheng-fund.com/
(149) 久富财富
注册地址：上海市浦东新区莱阳路2819号1幢109室
办公地址：上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人：赵惠蓉
联系人：徐金华
电话：021-68685825
传真：021-68682297
客户服务电话：400-021-9898
公司网站：www.jfcta.com
(150) 凯石财富
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：李晓明
电话：021-63333319
传真：021-63332523
客户服务电话：4000 178 000
公司网站：www.lingxianfund.com
(151) 利得基金
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈继伟
联系人：徐鹏
电话：86-021-50583533
传真：86-021-50583633
客户服务电话：4000676266
公司网站：www.leadfund.com.cn
(152) 联泰资产
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法定代表人：燕斌
联系人：凌秋艳
电话：021-52822063
传真：021-52975270
客户服务电话：400-046-6788
公司网站：www.66zichan.com
(153) 陆金所资管
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客户服务电话：4008219031
公司网站：www.lufunds.com
(154) 诺亚正行
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人：汪静波
联系人：张裕
电话：021-38509680
传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399
公司网站：www.noah-fund.com
(155) 钱景财富
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号丹棱SOHO大厦1幢9层1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号丹棱SOHO大厦1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
联系人：高静
电话：010-57418829
传真：010-57569671
客户服务电话：400-893-6885
公司网站：www.qianjing.com www.niuji.net
(156) 深圳新兰德
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：杨懿
联系人：张燕
电话：010-83363099
传真：010-83363010
客户服务电话：400-166-1188
公司网站：http://8.jrj.com.cn
(157) 晟视天下
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人：蒋煜
联系人：徐长征、周超
电话：01058170943、010-58170953
传真：01058170800
客户服务电话：4008188866
公司网站：www.shengshiview.com
(158) 数米基金
注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼
法定代表人：陈柏青
联系人：韩爱彬
联系电话：0571-81137494
客户服务电话：4000-766-123
传真：0571-26697013
网址：http://www.fund123.cn/
(159) 天天基金
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
联系电话：021-54509998
客户服务电话：400-1818-188
传真：021-64385308
网址：www.1234567.com.cn
(160) 同花顺
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人：凌顺平
联系人：吴强
联系电话：0571-88911818
客户服务电话：4008-773-772
传真：0571-86800423
网址：www.5ifund.com
(161) 万银财富
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座3201
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：王斐
联系人：付少帅
电话：010-59497361
传真：010-64788016
客服电话：400-059-8888
公司网站：http://www.wy-fund.com
(162) 鑫鼎盛
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
法定代表人：陈洪生
联系人：梁云波
电话：0592-3122757
传真：0592-3122701
客户服务电话：0592-3122716
公司网站：www.xds.com.cn
基金销售网站：www.dkhs.com.cn
(163) 新浪仓石
注册地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室
办公地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦903室
法定代表人：张琪
联系人：付文红
客户服务电话：010-62675369
邮箱：fund@staff.sina.com.cn
网址：http://www.xincai.com/
(164) 一路财富
注册地址：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：刘栋栋
电话：010-88312877
传真：010-88312099
客户服务电话：400-001-1566
公司网站：www.yilucaifu.com
(165) 宜投基金销售
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室
办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405
法定代表人：华建强
联系人：刘娜
电话：0755-23919658
传真：0755-88603185
客户服务电话：4008-955-811
公司网站：www.yitfund.com
(166) 宜信普泽
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：王巨明
电话：010-52855713
传真：010-85894285
客户服务电话：400-6099-200
公司网站：www.yixinfund.com
(167) 盈米财富
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
电话：020-89629019
传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066
公司网站：www.yingmi.cn
(168) 增财基金
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人：罗细安
联系人：史丽丽
电话：010-67000988
传真：010-67000988-6000
客户服务电话：400-001-8811
公司网站：www.zcvc.com.cn
(169) 展恒基金
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人：闫振杰
联系人：王琳
联系电话：010-62020088
客户服务电话：400-888-6661
传真：010-62020355
网址：www.myfund.com
(170) 中国国际期货
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
法定代表人：王兵
联系人：孟夏
电话：010-59539861
传真：010-59539806
客户服务电话：95162
公司网站：http://www.cifco.net/
(171) 中期资产
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢2层
法定代表人：姜新
联系人：侯英建
电话：010-65807865
传真：010-65807864
客户服务电话：95162
公司网站：www.cifcofund.com
(172) 中信建投期货
注册地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B，名义层11-A，8-B4，9-B、C
办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大楼11楼
法定代表人：彭文德
联系人：刘芸
电话：023-86769637
传真：023-86769629
客户服务电话：400-8877-780
公司网站：www.cfc108.com
(173) 中信期货
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：洪诚
电话：0755-23953913
传真：0755-83217421
客户服务电话：400-990-8826
公司网站：http://www.citicsf.com/
(174) 众禄金融
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客户服务电话：4006-788-887
公司网站：www.zlfund.cn www.jjmmw.com
（二）基金注册登记机构
易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
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
法定代表人：刘晓艳
电话：400 881 8088
传真：020-38799249
联系人：余贤高
（三）律师事务所和经办律师
律师事务所：北京市金杜律师事务所
地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层
负责人：王玲
电话：010-58785588
传真：010-58785599
经办律师：靳庆军、宋萍萍
联系人：王玲
（四）会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人：李丹
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
经办注册会计师：陈玲、沈兆杰
联系人：沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称：易方达中小盘混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

通过投资具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票，力求在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的股票、债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金各类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的60%—95%；债券、资产支持证券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，其中，基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资中小盘股票的资产不低于股票资产的80%。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金为混合基金，基金各类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的60%—95%；债券、资产支持证券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，其中，基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资中小盘股票的资产不低于股票资产的80%。

在以上战略性资产配置的基础上，本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，进行战术性资产配置，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。

在资产配置中，本基金主要考虑（1）宏观经济因素，包括GDP增长率及其构成、CPI、市场利率水平变化、货币政策等，以判断经济周期对市场的影响；（2）微观经济因素，包括各行业主要企业的盈利变化情况及其盈利预期；（3）市场因素，包括股票及债券市场的涨跌、市场整体估值水平、大类资产的预期收益率水平及其历史比较、市场资金供求关系及其变化；（4）政策因素，与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。

本基金在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

2、股票投资策略

在股票资产方面，本基金采取“自下而上”的策略，投资具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票。

（1）中小盘股票的定义

基金管理人每季度末对中国A股市场的股票按流通市值自小到大进行排序，累计流通市值占A股总流通市值2/3的股票，称为中小盘股票。在此期间对于未纳入最近一次排序范围的股票（如新股、恢复上市股票等），如果其流通市值（对未上市新股而言为本基金管理人预计的流通市值）可满足以上标准，也称为中小盘股票。基金因所持有股票价格的相对变化而导致中小盘股票投资比例低于基金合同规定的范围，本基金管理人将根据市场情况，本着投资者利益最大化的原则，适时予以调整，最长不超过3个月。

上述所称的流通市值指的是在上海和深圳证券交易所上市流通的股本乘以收盘价。当权威的证券数据服务机构能够提供可供投资者在公开股票市场上买卖的自由流通股本数据时，本基金管理人可采取自由流通股本乘以收盘价计算流通市值，并提前公告具体的计算方法。

（2）中小盘股票的选股标准

本基金管理人采取案头分析与实地调研等方法，对拟投资的上市企业经营情况进行透彻的分析，包括统计分析行业数据、走访上市公司及其上下游企业、调研公司的竞争对手、与公司经营管理层和员工谈话等，按以下标准选出本基金的备选股票。

（3）具有较高成长性

本基金主要投资具有较高成长性的企业。较高成长性指的是企业未来一年净利润增长率高于上市公司平均水平、行业平均水平和GDP增长率。本基金管理人将重点投资未来一年有爆发性增长或未来两年甚至更长时间可持续增长的企业，而且短期或长期增长率位居备选企业前列的公司。

企业业绩短期的爆发性增长指的是企业未来一年净利润增长率远高于以往的平均水平，其原因主要包括：产能大幅提高，并有相应的市场需求；技术水平出现突破性进展；行业景气回升，产品价格和毛利率大幅提高；资产重组、收购兼并等。

企业业绩的持续增长指的是企业净利润的增长可持续到未来两年甚至更长时间，其动力主要来自：行业处于成长周期或者出现行业景气；公司通过改进管理来降低能耗和生产成本，提高产能利用率；企业加大营销力度，开拓新市场；开发与引进新技术；新建产能以及收购外部生产能力等。

1）在细分行业具有较强的竞争优势

本基金优先投资细分行业的龙头企业，即在细分行业中市场占有率及盈利能力综合指标位居前列的企业，也包括经过快速成长即将成为细分行业龙头的企业；而且该行业具有较大的发展空间，行业景气度较高；

公司盈利能力较强，销售毛利率或净资产收益率位居行业前列，因企业独特的竞争优势，企业的高盈利水平有望长期保持；

公司拥有一只管理能力较强的经营团队，管理层稳定、团结、敬业、专业、诚信，能带领企业不断成长，而且公司制定了对管理层有效激励约束的薪酬制度；

经营管理机制灵活，能根据市场变化及时调整经营战略，并充分考虑了产业发展的规律和企业的竞争优势；已形成或初步形成较完备的生产管理、成本管理、薪酬管理、技术开发管理、营销管理的制度体系；

营销机制灵活，具有较强的市场开拓能力；

通过自主开发或引进先进技术，在某一领域形成技术领先优势；

公司财务稳健，相对同行业企业，资产负债率、短期偿债能力都处于合理水平，应收账款周转率较高、坏账率较低。

2）具有较好的公司治理机制，关心社会股东利益

公司具有较好的治理结构，公司管理层关心社会股东利益，关联交易按公平价格或有利于社会股东的价格成交并充分披露，在股息分派、融资、收购兼并、高管及员工的股权激励等政策制定中都充分考虑到将社会股东的利益放在首位。

（4）评估中小盘股票的估值水平

本基金管理人将根据企业所处的行业，选择适当的估值方法，对备选的中小盘股票价值进行动态评估。本基金将关注国外市场上同类企业在类似发展阶段的估值水平，以判断该企业的估值是否处于合理区间。

中小盘股票往往具有较高的估值水平，本基金将重点考察所投资的股票价值是否被过分高估从而隐含较高风险。

（5）股票组合的构造

本基金管理人根据对中小盘股票的成长性、公司竞争优势、估值水平和行业前景的综合判断，进行股票组合的构造。在股票组合的构造中，将充分考虑中小盘备选股票的流动性以及波动性，注意分散投资。

3、其他投资策略

本基金投资可转债主要为了获取可转债低风险下的超额收益。投资策略主要包括：投资具有较高成长性或正股价格被低估的中小盘公司发行的可转债；投资折价交易或底价溢价率较低的转债，在接近强制赎回点时卖出；及时把握可转债与股票的套利机会；根据中签率预测和模型定价结果，积极参与可转债新券申购等。本基金管理人将动态监控转债发行主体的信用状况，及时抛售主体信用状况有恶化迹象的可转换债券。

当股票及转债市场风险加大时，本基金可投资货币市场工具及除可转债以外的债券，其主要目的是在保持灵活性的同时获得一定收益，以便未来及时把握重大的投资机会。

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。

九、基金的业绩比较基准

45%X天相中盘指数收益率+35%X天相小盘指数收益率+20%X中债总指数收益率

十、基金的风险收益特征

本基金是混合基金，理论上其风险收益水平高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。

十一、基金投资组合报告(未经审计)

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告有关数据的期间为2015年7月1日至2015年9月30日。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	741,040,900.54	78.35
	其中：股票	741,040,900.54	78.35
2	固定收益投资	40,110,000.00	4.24
	其中：债券	40,110,000.00	4.24
	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	163,099,800.35	17.24
7	其他资产	1,558,947.36	0.16
8	合计	945,809,648.25	100.00

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	654,046,406.39	71.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,965,460.75	4.24
E	建筑业	772,800.00	0.08
F	批发和零售业	231,500.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,530,430.60	2.34
J	金融业	-	-
K	房地产业	219,000.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	25,275,302.80	2.75
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	741,040,900.54	80.65

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000550	江铃汽车	3,500,000	90,440,000.00	9.84
2	600066	宇通客车	4,700,000	88,360,000.00	9.62
3	000858	五 粮 液	4,000,000	86,640,000.00	9.43
4	600887	伊利股份	5,200,000	79,976,000.00	8.70
5	600519	贵州茅台	380,000	72,317,800.00	7.87
6	000568	泸州老窖	2,900,000	59,566,000.00	6.48
7	600872	中炬高新	3,900,000	56,589,000.00	6.16
8	000333	美的集团	1,800,045	45,415,135.35	4.94
9	600418	江淮汽车	2,000,043	26,560,571.04	2.89
10	002672	东江环保	1,400,045	24,976,802.80	2.72

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,110,000.00	4.37
	其中：政策性金融债	40,110,000.00	4.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,110,000.00	4.37

5、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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150307	15进出07	200,000	20,104,000.00	2.19
2	150416	15农发16	200,000	20,006,000.00	2.18

6、报告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、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、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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、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。

10、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。

11、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	813,075.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	524,124.99
5	应收申购款	221,746.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,558,947.36

(4) 报告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。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000858	五 粮 液	86,640,000.00	9.43	重大事项停牌

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

本基金合同生效日为2008年6月19日，基金合同生效以来（截至2015年12月31日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

阶段	净值增长率①	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
基金合同生效至2008年12月31日	-0.41%	0.84%	-26.21%	2.52%	25.80%	-1.68%
2009年1月1日至2009年12月31日	74.72%	1.79%	87.62%	1.70%	-12.90%	0.09%
2010年1月1日至2010年12月31日	14.57%	1.60%	0.39%	1.33%	14.18%	0.27%
2011年1月1日至2011年12月31日	-27.27%	1.28%	-23.34%	1.12%	-3.93%	0.16%
2012年1月1日至2012年12月31日	5.25%	1.23%	3.60%	1.11%	1.65%	0.12%
2013年1月1日至2013年12月31日	9.61%	1.12%	4.77%	1.09%	4.84%	0.03%
2014年1月1日至2014年12月31日	31.43%	1.13%	36.52%	0.90%	-5.09%	0.23%
2015年1月1日至2015年12月31日	25.79%	2.11%	28.76%	2.11%	-2.97%	0.00%
基金合同生效至2015年12月31日	176.53%	1.47%	98.76%	1.51%	77.77%	-0.04%

十三、费用概览

（一）与基金运作相关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）因基金的证券交易或结算而产生的费用；

（4）基金合同生效以后的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；

（7）基金的资金汇划费用；

（8）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%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 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）本章第（一）节“与基金运作相关的费用”中“基金费用的种类”的第（3）到第（7）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

本条第（一）款约定以外的其他费用，以及基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

（1）申购费率

本基金申购费率如下表所示：

本基金对通过本公司直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

通过基金管理人的直销中心申购本基金的特定投资群体申购费率为：

申购金额M（元）（含申购费）	申购费率
M<100万	0.15%
100万≤M<500万	0.12%
500万≤M<1000万	0.03%
M≥1000万	1000元/笔

其他投资者申购本基金的申购费率为：

申购金额M（元）（含申购费）	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<500万	1.2%
500万≤M<1000万	0.3%
M≥1000万	1000元/笔

（2）申购费的收取方式和用途

本基金采用金额申购、前端收费的形式收取申购费用，投资者如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

基金的申购费由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不计入基金财产。

（3）申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

对于1000万元（含）以上的申购，净申购金额=申购金额-绝对数额的申购费金额

申购费以人民币元为单位，四舍五入，保留至小数点后二位；申购份数按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

2、赎回费用

（1）赎回费率

本基金的赎回费率根据持有期限的不同分为三档。持有期限的起始日为基金权益登记日。

持有时间（天）	赎回费率
0-364	0.5%
365-729	0.25%
730及以上	0%

（2）赎回费的收取和用途

本基金的赎回费由赎回人承担，赎回费的25%归入基金财产，余额为注册登记费和其他手续费。

（3）赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，其中：

赎回总额=赎回数量×T日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回总额、赎回费用以人民币元为单位，四舍五入，保留小数点后两位。

3、转换费率

目前，基金管理人已开通了本基金与旗下部分开放式基金之间的转换业务，具体实施办法和转换费率详见相关公告。基金转换费用由投资者承担，基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中转出基金赎回费按照基金合同、更新的招募说明书及最新的相关公告约定的比例归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，转换费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。

4、投资者通过本公司网上交易系统（www.efunds.com.cn）进行申购、赎回和转换的交易费率，请具体参照我公司网站上的相关说明。

5、基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整上述费率。上述费率如发生变更，基金管理人应最迟于新的费率实施前2个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费率，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别的费率优惠活动。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及《易方达中小盘混合型证券投资基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2015年8月1日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“三、基金管理人”部分，更新了部分内容。

2、在“四、基金托管人”部分，根据最新资料进行了更新。

3、在“五、相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构和会计师事务所信息。

4、在“八、基金份额的申购、赎回”部分，更新了部分内容。

5、在“九、基金转换”部分，更新了部分内容。

6、在“十一、基金的投资”部分，补充了本基金2015年第3季度投资组合报告的内容。

7、在“十二、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩数据。

8、在“十六、基金的费用与税收”部分，更新了部分内容。

9、在“二十三、对基金份额持有人的服务”部分，更新了部分内容。

10、在“二十四、其他应披露事项”部分，根据相关公告的内容进行了更新。

易方达基金管理有限公司

2016年2月2日

证券代码：000038　　证券简称：深大通　　公告编号：2016-009

深圳大通实业股份有限公司关于董事会秘书、财务总监辞职的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

近日，公司董事会收到王小连女士、王立平女士的辞职报告。

王小连女士因个人原因辞去公司董事会秘书职务。王小连女士辞职后不再担任公司任何职务。王小连女士未持有公司股票。

王立平女士因个人原因辞去公司财务总监职务。王立平女士辞职后仍担任公司非独立董事职务。王立平女士未持有公司股票。

根据《公司章程》规定，为了不影响公司的正常运行，公司尽快召开董事会选举新任财务总监及董事会秘书或由其他高管代行董事会秘书职责。

公司董事会对王小连女士、王立平女士在任职期间为公司所做出的贡献表示衷心的感谢！

特此公告

深圳大通实业股份有限公司董事会

二〇一六年二月一日

证券代码：000038　　证券简称：深大通　　公告编号：2016-010

深圳大通实业股份有限公司第八届董事会第二十五次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2016年01月28日，深圳大通实业股份有限公司（以下简称"公司"）董事会以电子邮件的形式发出第八届董事会第二十五次会议通知。2016年02月01日上午10点第八届董事会第二十五次会议以通讯表决形式召开。本次会议由董事长召集，会议应参加董事7人，实际参加7人。会议召开的时间、地点及方式符合《公司法》、《公司章程》及《董事会议事规则》的有关规定。会议审议通过了以下议案：

议案一：关于聘任李建立先生为公司财务总监的议案

鉴于现任财务总监王立平女士已辞去财务总监职务，因此，董事会提名李建立先生为公司财务总监。任期与本届董事会任期一致。（简历见附件）

表决结果：7票同意，0票反对，0票弃权。

议案二：关于由董事长许亚楠先生代行董事会秘书职责的议案

鉴于现任董事会秘书王小连女士已辞去董事会秘书职务，因此，由董事长许亚楠先生代行董事会秘书职责，直至公司正式聘任董事会秘书。

特此公告

深圳大通实业股份有限公司董事会

二〇一六年二月一日

附简历：

李建立，男，1982年生。研究生学历，会计师，国际高级财务管理师（SIFM），注册财务管理师（CMA）。2004年-2015年历任海尔集团洗衣机本部成本主管、财务经理、海尔集团洗碗机本部财务总监、海尔集团泰国工厂财务总监、海尔集团欧美大区财务总监、海尔消费金融有限公司财务总监。

李建立先生未持有本公司股票，与上市公司、控股股东及实际控制人及持有公司百分之五以上股份的股东、实际控制人无关联关系，未曾受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所惩戒。符合《公司法》等相关法律、法规和规定要求的任职条件。

证券代码：000519　　证券简称：江南红箭　　公告编号：2016-4

湖南江南红箭股份有限公司第九届董事会第十七次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

湖南江南红箭股份有限公司（以下简称"公司"或"江南红箭"）第九届董事会第十七次会议通知已于2016年1月30日以邮件和口头通知的方式向全体董事发出，会议于2016年2月1日以通讯方式召开。公司董事会成员9人，实际参与表决董事9人，分别为隋建辉、李玉顺、牛建伟、卢灿华、申兴良、温振祥、李志宏、韩赤风、郑锦桥。会议的召开符合《中华人民共和国公司法》、《公司章程》的有关规定。

会议审议通过了《关于聘任公司董事会秘书的议案》。

同意聘任温振祥先生担任董事会秘书。相关独立董事的独立意见于同日刊登在巨潮资讯网www.cninfo.com.cn上。

表决结果：赞成票9票，反对票0票，弃权票0票。

具体内容详见《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上的公告。

特此公告。

湖南江南红箭股份有限公司

董事会

2016年2月2日

证券代码：000519　　证券简称：江南红箭　　公告编号：2016-5

湖南江南红箭股份有限公司关于聘任董事会秘书的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

湖南江南红箭股份有限公司（以下称"公司"）第九届董事会第十七次会议于2016年2月1日以通讯方式召开，本次会议以9票同意，0票反对，0票弃权，审议并通过了《关于聘任公司董事会秘书的议案》。公司第九届董事会决定聘任温振祥先生担任公司董事会秘书。现将相关情况公告如下：

一、个人简介

温振祥，男，1964年10月出生，本科学历，高级工程师、会计师。曾任河南北方红阳工业集团有限公司总经理助理、资产运营部部长，豫西工业集团有限公司董事会秘书、总法律顾问、资本运营部部长等职务。现任湖南江南红箭股份有限公司董事、总法律顾问，郑州红宇专用汽车有限公司董事，南阳北方向东工业有限公司董事，南阳北方红宇机电制造有限公司董事等职务。

温振祥先生已于2015年10月30日取得了深圳证券交易所颁发的董事会秘书资格证书。公司已将温振祥的任职材料报送深圳证券交易所审核，深圳证券交易所对其任职资料审核后无异议。

温振祥先生未持有本公司股份；与公司其他董事、监事、高级管理人员及持有公司百分之五以上股份的股东、实际控制人之间存在关联关系；未受过中国证监会及其他有关部门的处罚和证券交易所的惩戒。不存在《深圳证券交易所股票上市规则》第 3.2.4 条所规定的不得担任上市公司董事会秘书的情形。不存在2014年八部委联合印发的《"构建诚信 惩戒失信"合作备忘录》规定的"失信被执行人为自然人的，不得担任企业的法定代表人、董事、监事、高级管理人员"的情形。

二、联系方式：

电话：0377-83880269

传真：0377-83882888

电子邮箱：wzx5103@163.com

通信地址：河南省南阳市仲景北路1669号中南钻石有限公司院内

特此公告。

湖南江南红箭股份有限公司

董事会

2016年2月2日

证券代码：000687　　证券简称：华讯方舟　　公告编号：2016-012

华讯方舟股份有限公司关于控股股东部分股份办理股票质押式回购交易的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

华讯方舟股份有限公司（以下简称“公司”）于2016年1月29日接到公司控股股东深圳市华讯方舟科技有限公司（以下简称“华讯科技”）的通知，华讯科技将其所持有的公司部分股份办理了股票质押式回购交易业务，相关质押登记手续已办理完毕。具体事项如下：

一、股东股份质押的基本情况

1、股东股份被质押基本情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	质押股数	初始交易日	购回交易日	质权人	本次质押占其所持股份比例	用途
深圳市华讯方舟科技有限公司	公司第一大股东	15,000,000	2016-01-28	2018-04-26	长江证券（上海）资产管理有限公司	6.65%	补充经营流动资金
合计	——	200,695,802	——	——	——	88.92%	——

2、股东股份累计被质押的情况

截止本公告披露日，华讯科技直接持有公司股份225,695,802股，占公司总股本的29.80%；华讯科技持有公司股份累计质押200,695,802股，占公司总股本的26.50%。

二、备查文件

1、《长江证券股份有限公司股票质押式回购交易业务协议》；

2、中国证券登记结算有限责任公司股份冻结明细。

特此公告。

华讯方舟股份有限公司

董 事 会

2016年2月1日

证券代码：002194　　证券简称：武汉凡谷　　公告编号：2016-003

武汉凡谷电子技术股份有限公司关于全资子公司完成工商注册登记的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、情况概述

武汉凡谷电子技术股份有限公司（以下简称"公司"）于2015年12月19日召开第五届董事会第九次（临时）会议审议通过了《关于在苏州设立子公司的议案》，同意公司出资 2000 万人民币在江苏苏州设立全资子公司（以下简称"苏州凡谷"）。具体内容详见 2015 年 12 月 21日刊载在《证券时报》、《证券日报》、《中国证券报》、《上海证券报》和巨潮资讯网（ http://www.cninfo.com.cn ）上的《武汉凡谷电子技术股份有限公司关于在苏州设立子公司的公告》（公告编号：2015-071）。

二、成立情况

近日，公司接到通知，苏州凡谷已完成工商注册登记并已取得由江苏省苏州工业园区工商行政管理局颁发的《营业执照》，现将相关情况公告如下：

名称：苏州凡谷电子技术有限公司

统一社会信用代码：91320594MA1MEYWG29

类型：有限责任公司（法人独资）

住所：苏州工业园区新平街388号腾飞科技园21幢08层01、02、16、17、18、19室

法定代表人：颜玮

注册资本：2000万元人民币

经营范围：通讯、电子、计算机软件开发及技术服务；通信设备制造；线路安装；仪器仪表、电子元器件、计算机销售；从事上述商品及技术的进出口业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

特此公告。

武汉凡谷电子技术股份有限公司

董 事 会

二〇一六年二月二日

证券代码：002417　　证券简称：*ST元达　　公告编号：2016-006

福建三元达通讯股份有限公司关于申请延期回复非公开发行股票反馈意见的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

福建三元达通讯股份有限公司（以下简称"公司"）于 2016 年 1 月 18 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）出具的《中国证监会行政许可项目审查反馈意见通知书》（153601 号）（以下简称"《反馈意见》"）。中国证监会依法对公司提交的《福建三元达通讯股份有限公司非公开发行股票申请文件》进行了审查，要求公司和保荐机构就有关问题作出书面说明和解释，并在30日内向中国证监会行政许可审查部门提交书面回复意见。

收到《反馈意见》后，公司立即会同各中介机构积极就相关问题进行核查，准备回复工作。因《反馈意见》所涉及的事项需要履行相应的决策程序，相关核查工作、材料补充工作等事项需要一定的时间，为切实稳妥地做好反馈意见的回复工作，经公司与中介机构审慎协商，于2016年2月1日向中国证监会提交了延期回复非公开发行股票申请文件反馈意见的申请。公司将于2016年3月15日前完成反馈意见的回复工作。

延期回复期间，公司将会同中介机构尽早完成反馈意见的回复工作，在反馈回复材料准备齐全后及时履行相关信息披露义务并向中国证监会报送相关文件。

公司本次非公开发行股票事项尚需取得中国证监会核准后方可实施。公司将根据该事项实际进展情况，及时履行信息披露义务，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

福建三元达通讯股份有限公司

董 事 会

2016 年2月2日

股票代码：000585　　股票简称：东北电气　　公告编号：2016-018

东北电气发展股份有限公司关于筹划重大资产重组进展及继续停牌的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

东北电气发展股份有限公司（以下简称"公司"）因筹划重大资产重组事宜，根据《深圳证券交易所股票上市规则》及有关规定，经公司申请，公司股票（A股股票简称：东北电气，A股股票代码：000585）自2015年11月30日开市时起停牌，并预计在2016年2月29日前披露重大资产重组信息。公司已于2016年1月4日、1月11日、1月18日和1月25日发布了股票交易停牌公告（详见指定信息披露媒体）。

2016年1月22日，股份转让双方已经办理完毕股份转让的过户登记手续。同时，上市公司拟将附属子公司新东北电气（锦州）电力电容器有限公司的股权投资等资产出售，拟购买智能软件开发和智能硬件研发、生产，移动互联网业务相关公司的股权。

为维护投资者利益，避免公司股价异常波动，根据《深圳证券交易所股票上市规则》及有关规定，经公司申请，公司A股股票自2016年1月26日开市时起继续停牌，敬请广大投资者注意投资风险。停牌期间，公司严格按照相关规定，每五个交易日发布一次重大资产重组事项的进展公告。

特此公告

东北电气发展股份有限公司董事会

二〇一六年二月一日