

信息披露 Disclosure

易方达中小板指数分级证券投资基金

2014 半年度报告摘要

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

关联方名称	金额单位:人民币元			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金余额的比例
—	—	—	—	—
关联方名称	金额单位:人民币元			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金余额的比例
广发证券	90,065.21	39.70%	\$2,569.60	100.00%

注:上述佣金按市场中间价计算,以扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。该等佣金以证券经纪商向基金公司一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元				
项目	2014年1月1日至2014年6月30日	本期	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间
当期发生的基础基金支付的管理费	74,716.37	74,716.37	60,161.01	60,161.01
其中:支付机构为券商支付管理费	43,610.51	43,610.51	181,353.34	181,353.34

注:基金管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年管理费率÷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

基金管理人每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元				
项目	2014年1月1日至2014年6月30日	本期	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间
当期发生的基础基金支付的托管费	74,716.37	74,716.37	13,673.39	13,673.39

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下:
H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

基金托管人每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

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 报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

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	占基金总份额的比例	持有的基金份额	占基金总份额的比例
广发证券	400,000.00	99%	400,000.00	1.92%

注:广发证券期末持有易基中小板A类(易基稳健)份额400,000份。广发证券持有份额占比较大,分别按应得比例的其他关联方投资本基金金额及更新的招募说明书的有关规定执行。

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	2014年1月1日至2014年6月30日	本期	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间
中国建设银行	4,893,258.00	16,025.21	6,796,889.89	34,596.64

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设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 本基金在承销期间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间参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联方事项的说明

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 因认购新股及增发证券于期末持有的流通受限证券
本基金无因认购新股/增发证券于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

(6) 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

根据公允价值计量时金融资产和负债的具体特征及其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的输入值,公允价值层级可分为:

第一级:直接计入损益的金融资产或金融负债上未经调整的报价;

第二级:直接或间接以价格或金额数据为基础的报价的推定可观察到的,除第一级中的市场报价的资产或负债的输入值;

第三级: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)。

自2014年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的其变动计入当期损益的金融资产中属于第一级至第三级公允价值计量的金融资产余额如下:

公允价值层级	公允价值	公允价值占基金资产净值的比例
第一级	761,738,401.15元	7.08%
第二级	694,694.91元	0.01%
第三级	694,694.91元	0.01%

自2014年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的其变动计入当期损益的金融负债中属于第一级至第三级公允价值计量的金融负债余额如下:

公允价值层级	公允价值	公允价值占基金资产净值的比例
第一级	4,424,440.03元	0.04%
第二级	285,387.86元	0.003%
第三级	—	—

对于非交易性金融资产、负债,如非货币性金融资产、停牌股票等,属于非公开交易等金融工具,其公允价值按照以下方法确定:

6.4.9.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券
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若。

(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结果具有重大意义的最低层次的输入值,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中未经调整的报价。
第二层级:除第一层级输入值外相关资产或负债的公允价值输入值。
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
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金额为¥1,728,401.37元,属于第二层级的金额为¥854,694.91元,无属于第三层级的金额(2013年12月31日:第一层级¥64,424,401.03元,第二层级¥262,367.86元,无属于第三层级的金额)。

(iii)公允价值输入值的敏感性分析
对于证券交易上市的市场,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,本基金公允价值输入值的相关资产或负债的公允价值输入值的第一层级,并视具体情况输入值的不同可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关资产或负债公允价值归属第二层级或第三层级。

(iv)第三层级公允价值输入值的不确定性
本基金本报告期末持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2013年年初:无);本基金本报告期内(2014年1月1日至2014年6月30日)公允价值输入值未发生重大变化。

(c) 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

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	64,593,096.48	92.91
2	固定收益投资	—	—
3	贵金属投资	64,593,096.48	92.91
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	4,893,258.00	7.04
7	其他各项资产	34,965.07	0.05
8	合计	69,521,315.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,159,077.19	1.68
B	采矿业	483,500.00	0.70
C	制造业	40,917,827.45	59.33
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	—	—
E	建筑业	2,940,797.49	4.26
F	交通运输、仓储和邮政业	3,655,341.58	5.30
G	信息传输、软件和信息技术服务业	5,611,247.27	8.14
H	住宿和餐饮业	1,822,015.80	2.64
I	金融业	1,439,960.82	2.14
K	房地产业	705,299.74	1.02
L	招商局和房地产业	980,838.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	404,340.00	0.59
O	卫生、社会保障和社会福利业	—	—
P	教育、体育和娱乐业	—	—
Q	其他行业	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
合计		58,680,285.48	85.09

7.2.2 积极投资报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	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	3,904,825.00	5.66
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储和邮政业	—	—
G	信息传输、软件和信息技术服务业	713,880.00	1.04
H	住宿和餐饮业	—	—
K	房地产业	—	—
L	招商局和房地产业	1,294,106.00	1.88
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	卫生、社会保障和社会福利业	—	—
P	教育、体育和娱乐业	—	—
Q	其他行业	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
合计		5,912,811.00	8.57

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	002024	苏宁云商	39,764	2,491,251.84	3.61
2	002415	海康威视	112,170	1,500,159.80	2.36
3	002241	歌尔声学	65,517	1,766,083.22	2.53
4	002594	比亚迪	35,618	1,691,088.22	2.45
5	002450	华谊兄弟	66,438	1,511,296.25	2.19
6	002230	科大讯飞	55,566	1,488,055.00	2.18
7	002535	欧陆电路	25,875	1,434,566.75	2.09
8	002065	新华传媒	71,340	1,434,556.00	2.08
9	002032	金禾科技	146,515	1,290,427.55	2.02
10	002036	大华股份	50,550	1,262,322.50	1.98

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读披露于www.efunds.com.cn网站的半年度报告全文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002465	海康威视	60,200	1,102,366.00	1.60
2	002400	广联股份	36,700	951,246.00	1.38
3	002476	立讯精密	28,300	786,554.00	1.14
4	002410	广联达	27,600	713,880.00	1.04
5	002701	华谊兄弟	51,300	631,321.00	0.92

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读披露于www.efunds.com.cn网站的半年度报告全文。

7.4.1 期末买入股票市值占基金净资产净值%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002465	海康威视	1,993,235.00	1.87
2	002400	广联股份	947,029.80	1.36
3	002475	立讯精密	781,480.00	1.12
4	002410	广联达	715,867.31	1.03
5	002071	奥康医疗	637,169.96	0.91
6	002049	南方铝箔	499,930.81	0.72
7	002573	国电高新	459,745.75	0.66
8	002653	海利科	342,335.22	0.49
9	002181	亨通光电	342,044.82	0.49
10	002456	欧陆电路	278,041.00	0.40
11	002229	鸿博股份	279,983.00	0.39
12	002414	高德红外	261,436.90	0.37
13	002045	东华软件	206,612.00	0.30
14	002024	苏宁云商	186,647.04	0.27
15	002415	海康威视	135,197.19	0.19
16	002183	华信通	130,147.00	0.18
17	002004	华信通	104,028.00	0.15
18	002594	比亚迪	100,405.00	0.14
19	002531	欧陆电路	92,767.00	0.13
20	002102	金禾科技	91,770.00	0.13

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 累计买入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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	440,190.00	0.63
2	002024	苏宁云商	335,373.00	0.48
3	002123	荣信股份	311,854.00	0.45
4	002412	宁波银行	309,905.00	0.44
5	002237	恒顺股份	295,712.00	0.42
6	002254	华信股份	294,173.00	0.42
7	002024	苏宁云商	253,680.50	0.36
8	002241	歌尔声学	244,858.00	0.36
9	002003	国电科技	245,466.00	0.35
10	002275	桂林三金	239,876.00	0.34
11	002128	露天矿业	218,384.00	0.31
12	002594	比亚迪	214,937.00	0.31
13	002637	航天长峰	204,367.00	0.29
14	002203	罗家股份	203,967.01	0.29
15	002154	恒卓 东	175,167.71	0.25
16	002450	华谊兄弟	168,681.00	0.24
17	002022	科陆电子	162,134.74	0.23
18	002146	宝发集团	156,206.00	0.22
19	002230	科大讯飞	147,698.72	0.21
20	002302	金利科技	146,591.00	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成本总额

买入股票成本(成交金额)	卖出股票成本(成交金额)
30,517,063.33	85,878,814.54

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
7.5.1 报告期末按品种分类的债券投资组合

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
7.6.1 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前十名资产支持证券投资明细
7.7.1 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
7.8.1 报告期末未持有贵金属
7.9 报告期末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
7.9.1 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
7.10.1 报告期末本基金未投资股指期货
7.10.2 报告期末本基金未投资股指期货

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
7.11.1 报告期末本基金未投资国债期货
7.11.2 报告期末本基金未投资国债期货

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 报告期内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证券中不存在被出具负面评价报告的情况。
7.12.3 报告期内本基金投资的前十名证券不存在被出具负面评价报告的情况。

8 基金投资组合信息
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

序号	名称	金额
1	存在担保基金	1,357.62
2	收取证券管理费	—
3	收取股利	—
4	收取利息	877.02
5	收取申购费	2,483.32
6	其他应收款	30,247.11
7	待摊费用	—
8	其他	34,965.07

7.12.3 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
7.12.5.1 期末指按投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明
7.12.5.2 期末指按投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明
7.12.5.3 期末指按投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明

8.2 期末前十名基金持有人
易方达中小板指数分级B