易方达行业领先企业混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

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：二〇一六年三月二十五日

§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3月22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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达行业领先混合
基金主代码	110015
交易代码	110015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月26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	368,038,722.73份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在优化行业资产配置的基础上，从行业领先企业中精选行业龙头与高成长企业进行投资，力求基金资产的长期增值。
投资策略	在行业配置的基础上，本基金将从各细分行业中选择行业领先企业，然后从行业领先企业中选择行业龙头企业和具有较高成长性的公司，构造股票组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
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。

注：2015年7月25日，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金变更基金类别并由"易方达行业领先企业股票型证券投资基金"更名为"易方达行业领先企业混合型证券投资基金"。

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	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	254,985,623.49	127,289,369.81	201,234,802.87
本期利润	322,115,344.40	-6,593,071.48	280,278,998.19
加权平均基金份额本期利润	0.7671	-0.0095	0.2996
本期基金份额净值增长率	68.26%	1.06%	29.11%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	1.0201	0.3363	0.2562
期末基金资产净值	827,220,399.18	643,160,595.24	1,230,048,927.06
期末基金份额净值	2.248	1.336	1.349

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。

3.2 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
过去三个月	27.51%	2.39%	13.66%	1.34%	13.85%	1.05%
过去六个月	-8.62%	3.32%	-12.53%	2.14%	3.91%	1.18%
过去一年	68.26%	2.90%	5.37%	1.99%	62.89%	0.91%
过去三年	119.55%	1.96%	39.58%	1.43%	79.97%	0.53%
过去五年	61.80%	1.71%	17.08%	1.29%	44.72%	0.42%
自基金合同生效起至今	146.11%	1.65%	45.29%	1.32%	100.82%	0.33%

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

易方达行业领先企业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
（2009年3月26日至2015年12月31日）

注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为146.11%，同期业绩比较基准收益率为45.29%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达行业领先企业混合型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	–	–	–	–	–
2014年	0.260	12,364,461.24	11,175,790.37	23,540,251.61	–
2013年	0.100	4,094,192.11	6,180,582.37	10,274,774.48	–
合计	0.360	16,458,653.35	17,356,372.74	33,815,026.09	–

§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2015年12月31日，易方达旗下共管理88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8269.58亿元。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
冯波	本基金的基金经理、研究部总经理	2010-01-01	–	14年	硕士研究生，曾任广东发展银行行员，易方达基金管理有限公司市场拓展部研究员、市场拓展部副经理、市场部大区销售经理、北京分公司副总经理、研究部行业研究员、基金经理助理、研究部总经理助理、研究部副总经理，易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则，及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制，共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；投资指令统一集中至交易部，按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则，公平分配投资指令；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易执行功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对我司旗下所有投资组合2015年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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11次，其中8次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3次为不同基金经理管理的组合间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。

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

2015年A股市场波动剧烈。上半年，投资者对中国经济前景保持乐观，资金持续流入股票市场，股票指数大幅上扬，上证指数及创业板指数分别上涨32.23%和94.23%。投资者对经济转型的乐观预期，导致符合新经济方向的行业表现优异，市场气氛高度活跃，风险偏好不断飙升。值得注意的是，在本轮上涨过程中，融资和配资资金对市场起到了重要的推动作用，市场上涨过程中积累了较大的估值泡沫。6月份，主要经济数据表现较为疲弱，经济下行压力较大，股市前期积累的巨大泡沫在资本市场快速去杠杆的过程中爆破，指数出现了罕见的急速下跌。在三季度单季度内，上证指数下跌28.63%，创业板指数下跌27.14%，市场更一度出现极度恐慌情绪，导致流动性缺失。进入四季度，资本市场在三季度急速下跌后逐步企稳。央行的年内第五次降息降准，和"十三五"规划所提出的保障经济增长底线6.5%，对资本市场信心起到了一定的提振作用。上证指数反弹近16%，新兴经济及中小市值股票再次表现活跃，创业板指数反弹30.32%。

资产配置上，本基金上半年维持了较高的股票仓位，结构上持续降低价值类个股的比例，加大对新兴成长类品种的配置，以增强组合的进攻性，取得了较好的效果。面对三季度市场的快速调整，本基金降低了整体仓位，并减持了部分高估值成长股，增持了部分低估值蓝筹股，力求提升组合防御性。但由于本基金对短期指数急速下跌的速度和力度准备不足，反应速度有所滞后，导致净值回撤较大。进入四季度，A股市场重新进入平稳状态，本基金恢复到中性股票仓位，配置上逐步减持了防御性较强的地产、银行、家电等行业，重新增加互联网医疗、传媒、云计算等新兴产业的配置比例，从防御状态转向平衡偏进攻状态，调整效果不俗，获得较大相对收益。

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2.248元，本报告期份额净值增长率为68.26%，同期业绩比较基准收益率为5.37%。

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2016年，中国经济继续面临经济增速放缓和结构转型的挑战。同时美国进入加息周期，人民币贬值压力不断加大，对中国经济增长构成压力。另一方面，中国新经济行业的快速发展，创新商业模式加速迭代，为经济转型提供强劲支持。传统经济受经济增速放缓压力较大，但随着供给侧改革的逐步落实，钢铁、煤炭等长期产能过剩行业的竞争格局将有望得到改善。

资本市场方面，政府一直对资本市场高度关注及呵护，强调完善资本市场功能和促进资本市场繁荣，预计宽松的货币政策将得到延续，市场流动性将继续充裕。通货膨胀维持低位等正面因素，均有利于市场向好。

另一方面，大量限售股的解禁，注册制的加速推进，及上海战略新兴板成立等因素，将导致资本市场供给端压力持续存在。

综合来看，我们认为2016年资本市场震荡幅度及频率都将加剧，细分行业的选择和风险控制将成为制胜关键。

在下一阶段的资产配置上，我们将保持相对灵活的股票仓位，积极进行结构调整。重点关注以下行业和个股的投资机会：一是行业成长性较好的互联网经济；二是以医疗、教育、文娱为代表的现代服务业；三是受益于供给侧改革的行业，如钢铁、煤炭等行业；四是具备核心竞争能力、价值低估的成长性企业。

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

根据相关法律法规及《易方达行业领先企业混合型证券投资基金基金合同》，本基金本报告期内应分配利润37,545,104.38元，本报告期未进行利润分配；本基金本报告期应分配尚未实施的利润为37,545,104.38元；本基金已于2016年1月19日进行了利润分配，每10份基金份额派发红利1.10元，总分配金额为41,390,577.88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行业领先企业混合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，易方达行业领先企业混合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行业领先企业混合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，易方达行业领先企业混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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行业领先企业混合型证券投资基金2015年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 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计了2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达行业领先企业混合型证券投资基金
报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：		
银行存款	29,224,012.83	33,889,623.74
结算备付金	2,263,785.08	2,310,189.88
存出保证金	587,238.54	315,735.43
交易性金融资产	796,548,747.98	613,761,292.12
其中：股票投资	756,456,747.98	573,733,292.12
基金投资	–	–
债券投资	40,092,000.00	40,028,000.00
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	–	–
应收证券清算款	23,723,892.96	6,613,133.26
应收利息	528,976.89	814,128.12
应收股利	–	–
应收申购款	609,303.86	532,562.07
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	853,485,958.14	658,236,664.62
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	21,924,835.38	1,889,525.04
应付赎回款	1,219,746.21	9,913,394.55
应付管理人报酬	1,029,669.67	869,969.47
应付托管费	171,611.60	144,994.89
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	1,529,522.21	1,858,423.68
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	390,173.89	399,761.75
负债合计	26,265,558.96	15,076,069.38
所有者权益：		
实收基金	368,038,722.73	481,299,942.87
未分配利润	459,181,676.45	161,860,652.37
所有者权益合计	827,220,399.18	643,160,595.24
负债和所有者权益总计	853,485,958.14	658,236,664.62

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值2.248元，基金份额总额368,038,722.73份。

7.2 利润表

会计主体：易方达行业领先企业混合型证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	348,336,266.69	16,866,498.63
1.利息收入	1,841,438.12	2,735,433.10
其中：存款利息收入	623,783.34	390,386.03
债券利息收入	1,217,654.78	2,072,476.72
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	272,570.35
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以"-"填列）	278,229,411.86	147,649,733.22
其中：股票投资收益	276,428,630.86	140,544,960.10
基金投资收益	–	–
债券投资收益	196,623.84	121,650.00
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	1,604,157.16	6,983,123.12
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	67,129,720.91	-133,882,441.29
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）	1,135,695.80	363,773.60
减：二、费用	26,220,922.29	23,459,570.11
1. 管理人报酬	12,754,173.62	13,237,987.50
2. 托管费	2,125,695.52	2,206,331.17
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	10,902,194.08	7,532,586.98
5. 利息支出	2,271.99	45,449.36
其中：卖出回购金融资产支出	2,271.99	45,449.36
6. 其他费用	436,587.08	437,215.10
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	322,115,344.40	-6,593,071.48
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	322,115,344.40	-6,593,071.48

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达行业领先企业混合型证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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）	481,299,942.87	161,860,652.37	643,160,595.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	322,115,344.40	322,115,344.40
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）	-113,261,220.14	-24,794,320.32	-138,055,540.46
其中：1.基金申购款	559,618,751.95	734,983,593.84	1,294,602,345.79
2.基金赎回款	-672,879,972.09	-759,777,914.16	-1,432,657,886.25
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）	368,038,722.73	459,181,676.45	827,220,399.18
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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）	912,039,324.13	318,009,602.93	1,230,048,927.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-6,593,071.48	-6,593,071.48
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）	-430,739,381.26	-126,015,627.47	-556,755,008.73
其中：1.基金申购款	67,405,054.80	19,471,499.64	86,876,554.44
2.基金赎回款	-498,144,436.06	-145,487,127.11	-643,631,563.17
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）	–	-23,540,251.61	-23,540,251.61
五、期末所有者权益（基金净值）	481,299,942.87	161,860,652.37	643,160,595.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]第1315号《关于核准易方达行业领先企业股票型证券投资基金募集的批复》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《易方达行业领先企业股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达行业领先企业股票型证券投资基金基金合同》于2009年3月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,091,745,438.87份基金份额，其中认购资金利息折合528,965.17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，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。

2015年7月25日，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金变更基金类别并由"易方达行业领先企业股票型证券投资基金"更名为"易方达行业领先企业混合型证券投资基金"。

7.4.2 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》、《易方达行业领先企业混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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。

7.4.4 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

除下述事项外，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。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.2差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）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。

（2）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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。

（5）基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

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
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	–	–	285,531,194.85	5.86%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
–	–	–	–	–
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	229,015.15	5.34%	224,143.93	12.06%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券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务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,754,173.62	13,237,987.50
其中：支付销售机构的客户维护费	2,098,745.60	2,313,202.76

注：本基金的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为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,125,695.52	2,206,331.17

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的2.5‰的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×2.5‰÷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两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.8.4.2 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

无。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国工商银行	29,224,012.83	564,903.49	33,889,623.74	362,808.64

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。

7.4.8.6 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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 基金在承销期内买入 数量（单位：股/张）	总金额
–	–	–	–	–	–
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 基金在承销期内买入 数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	600089	特变电工	配股发行	1,390,697	9,595,809.30

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
000971	高升控股	2015-09-21	复牌交易不活跃	34.96	2015-12-31	26.39	349,929	7,817,887.48	12,233,517.84	注
300036	超图软件	2015-10-30	重大事项停牌	43.18	2016-01-15	35.11	450,000	15,490,615.78	19,431,000.00	–
300063	天龙集团	2015-12-22	重大事项停牌	43.33	–	–	350,000	9,127,321.77	15,165,500.00	–
300366	创意信息	2015-12-29	重大事项停牌	77.70	–	–	100,000	6,852,578.33	7,770,000.00	–
600645	中源协和	2015-12-30	重大事项停牌	65.01	2016-01-04	63.90	199,937	11,685,964.30	12,997,904.37	–

注：该股票在本期末虽已复牌但交易不活跃、流通仍受限，因而未采用市价估值。7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31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。

7.4.10 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)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2015年12月31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688,858,825.77元，属于第二层次的余额为107,689,922.21元，无属于第三层次的余额(2014年12月31日：第一层次491,156,430.43元，第二层次122,604,861.69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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金于2015年3月19日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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2015年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014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。

§8 投资组合报告

8.1 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	756,456,747.98	88.63
	其中：股票	756,456,747.98	88.63
2	固定收益投资	40,092,000.00	4.70
	其中：债券	40,092,000.00	4.70
	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	31,487,797.91	3.69
7	其他各项资产	25,449,412.25	2.98
8	合计	853,485,958.14	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	222,045,918.37	26.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	9,378,000.00	1.13
F	批发和零售业	25,760,106.00	3.11
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	407,170,819.24	49.22
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	12,997,904.37	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	7,827,000.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	71,277,000.00	8.62
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	756,456,747.98	91.45

8.3 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	300188	美亚柏科	799,860	40,552,902.00	4.90
2	300379	东方通	329,200	40,389,548.00	4.88
3	600756	浪潮软件	700,000	36,001,000.00	4.35
4	300333	兆日科技	743,000	35,664,000.00	4.31
5	300359	全通教育	410,000	35,309,200.00	4.27
6	600763	通策医疗	700,000	34,314,000.00	4.15
7	300078	思创医惠	650,000	31,720,000.00	3.83
8	002153	石基信息	200,000	30,200,000.00	3.65
9	002280	联络互动	458,622	28,159,390.80	3.40
10	300383	光环新网	500,000	27,855,000.00	3.37

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网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300059	东方财富	190,120,997.71	29.56
2	000002	万 科Ａ	79,235,068.24	12.32
3	600037	歌华有线	75,025,904.92	11.67
4	300359	全通教育	73,759,114.25	11.47
5	000651	格力电器	62,316,725.70	9.69
6	300036	超图软件	52,888,743.26	8.22
7	002390	信邦制药	46,865,073.62	7.29
8	300182	捷成股份	39,804,252.87	6.19
9	002170	芭田股份	39,673,706.71	6.17
10	600576	万家文化	38,064,409.12	5.92
11	600831	广电网络	37,561,298.97	5.84
12	300104	乐视网	36,818,820.51	5.72
13	300379	东方通	36,794,926.30	5.72
14	600645	中源协和	36,504,053.47	5.68
15	300383	光环新网	34,684,021.74	5.39
16	300188	美亚柏科	34,248,308.31	5.33
17	601288	农业银行	34,091,638.41	5.30
18	002153	石基信息	33,399,293.81	5.19
19	300033	同花顺	33,344,145.17	5.18
20	300086	康芝药业	33,215,590.08	5.16
21	300439	美康生物	32,776,083.68	5.10
22	002551	尚荣医疗	31,747,820.23	4.94
23	600804	鹏博士	31,638,448.60	4.92
24	600756	浪潮软件	31,420,671.95	4.89
25	002462	嘉事堂	31,002,376.29	4.82
26	300358	楚天科技	30,380,737.80	4.72
27	002215	诺 普 信	30,002,376.70	4.66
28	000623	广州浪奇	29,922,877.59	4.65
29	600446	金证股份	29,593,178.57	4.60
30	002642	荣之联	29,575,993.86	4.60
31	300333	兆日科技	29,339,724.00	4.56
32	002612	朗姿股份	28,295,305.00	4.40
33	300341	麦迪电气	27,843,441.55	4.33
34	002030	达安基因	27,371,060.98	4.26
35	000078	海王生物	27,183,931.38	4.23
36	002280	联络互动	27,106,546.04	4.21
37	300347	泰格医药	27,074,503.12	4.21
38	300078	思创医惠	25,626,694.85	3.98
39	002236	大华股份	25,206,138.24	3.92
40	300271	华宇软件	25,077,778.96	3.90
41	002029	七 匹 狼	24,289,694.96	3.78
42	601601	中国太保	23,889,296.66	3.71
43	002055	得润电子	23,677,983.00	3.68
44	000760	斯太尔	23,587,099.00	3.67
45	002488	金固股份	22,936,537.03	3.57
46	000705	浙江震元	22,794,867.58	3.54
47	002332	仙琚制药	22,630,820.83	3.52
48	000718	苏宁环球	22,316,811.72	3.47
49	002045	国光电器	22,231,383.33	3.46
50	600730	中国高科	22,038,607.12	3.43
51	600562	国睿科技	21,431,073.62	3.33
52	300392	腾信股份	21,426,788.40	3.33
53	601567	三星医疗	21,350,296.62	3.32
54	601336	新华保险	21,211,209.30	3.30
55	600549	厦门钨业	20,976,637.15	3.26
56	002658	雪迪龙	20,731,734.24	3.22
57	002385	大北农	20,544,075.72	3.19
58	603588	高能环境	20,520,512.00	3.19
59	300192	科斯伍德	19,969,022.24	3.10
60	002657	中科金财	19,364,249.10	3.01
61	300244	迪安诊断	19,350,215.87	3.01
62	300027	华谊兄弟	19,138,473.31	2.98
63	002572	索菲亚	19,055,291.01	2.96
64	300077	国民技术	18,700,953.53	2.91
65	300247	乐金健康	18,687,518.00	2.91
66	002292	奥飞动漫	17,865,728.06	2.78
67	002400	省广股份	16,814,634.64	2.61
68	300047	天源迪科	16,649,134.00	2.59
69	600306	商业城	16,500,547.78	2.57
70	002063	远光软件	16,452,412.44	2.56
71	300136	信维通信	16,331,685.53	2.54
72	300431	暴风科技	16,321,785.17	2.54
73	603108	润达医疗	16,294,114.84	2.53
74	601166	兴业银行	16,152,522.02	2.51
75	002197	证通电子	16,124,063.60	2.51
76	300207	欣旺达	15,917,775.06	2.47
77	603598	引力传媒	15,823,877.79	2.46
78	000524	岭南控股	15,446,468.08	2.40
79	002037	久联发展	15,350,694.15	2.39
80	600366	宁波韵升	15,318,667.82	2.38
81	300195	长荣股份	15,283,677.35	2.38
82	300160	秀强股份	15,210,082.99	2.36
83	300369	绿盟科技	15,207,657.91	2.36
84	002113	天润控股	15,045,822.00	2.34
85	601628	中国人寿	14,783,870.00	2.30
86	603009	北特科技	14,620,323.00	2.27
87	002654	万润科技	14,365,119.80	2.23
88	300168	万达信息	14,115,427.45	2.19
89	002709	天赐材料	14,031,512.00	2.18
90	002368	太极股份	14,009,635.00	2.18
91	000892	*ST星美	14,007,604.59	2.18
92	300043	互动娱乐	13,985,037.68	2.17
93	002467	二六三	13,897,687.00	2.16
94	603001	奥康国际	13,627,964.10	2.12
95	600763	通策医疗	13,514,706.26	2.10
96	600519	贵州茅台	12,974,712.44	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。

8.4.2 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	300059	东方财富	176,977,355.34	27.52
2	300359	全通教育	133,183,042.78	20.71
3	000002	万 科Ａ	84,916,559.08	13.20
4	000651	格力电器	80,971,135.04	12.59
5	600446	金证股份	74,698,393.55	11.61
6	002390	信邦制药	64,221,108.72	9.99
7	600037	歌华有线	62,651,150.78	9.74
8	600645	中源协和	60,299,775.38	9.38
9	601318	中国平安	53,992,618.20	8.39
10	002462	嘉事堂	48,032,734.03	7.47
11	300033	同花顺	45,286,957.33	7.04
12	002170	芭田股份	45,206,564.90	7.03
13	300182	捷成股份	45,174,466.08	7.02
14	300104	乐视网	45,103,764.12	7.01
15	600887	伊利股份	41,314,577.62	6.42
16	300086	康芝药业	37,627,846.57	5.85
17	002551	尚荣医疗	37,616,804.59	5.85
18	601601	中国太保	36,598,179.70	5.69
19	600831	广电网络	36,428,002.01	5.66
20	601567	三星医疗	35,554,908.76	5.53
21	300036	超图软件	34,975,980.34	5.44
22	601336	新华保险	34,829,333.54	5.42
23	002029	七 匹 狼	34,405,113.70	5.35
24	600576	万家文化	34,070,890.41	5.30
25	601288	农业银行	33,317,284.86	5.18
26	300063	天龙集团	33,291,062.12	5.18
27	300358	楚天科技	33,049,766.18	5.14
28	000718	苏宁环球	32,526,952.37	5.06
29	002215	诺 普 信	31,692,837.47	4.93
30	600804	鹏博士	30,961,483.13	4.81
31	000024	招商地产	30,298,761.82	4.71
32	600066	宇通客车	29,460,832.17	4.58
33	002385	大北农	29,169,246.54	4.54
34	300439	美康生物	29,010,644.36	4.51
35	000524	岭南控股	27,732,113.96	4.31
36	002236	大华股份	26,721,544.73	4.15
37	000078	海王生物	26,212,258.84	4.08
38	300168	万达信息	26,020,480.54	4.05
39	002030	达安基因	24,464,702.67	3.80
40	300392	腾信股份	24,368,841.53	3.79
41	002332	仙琚制药	24,292,348.63	3.78
42	300271	华宇软件	24,207,192.21	3.76
43	300136	信维通信	23,173,602.87	3.60
44	600730	中国高科	22,148,822.51	3.44
45	002045	国光电器	22,052,135.00	3.43
46	600048	保利地产	22,033,820.10	3.43
47	300231	银信科技	21,855,742.00	3.40
48	002488	金固股份	21,686,128.24	3.37
49	603001	奥康国际	21,022,416.92	3.27
50	002631	德尔未来	20,776,476.39	3.23
51	002612	朗姿股份	20,553,154.86	3.20
52	002448	中原内配	19,611,862.88	3.05
53	600549	厦门钨业	19,571,596.73	3.04
54	000831	五矿稀土	19,374,091.07	3.01
55	002153	石基信息	18,597,277.78	2.89
56	000786	北新建材	18,531,547.73	2.88
57	300242	明家科技	18,519,796.35	2.88
58	002657	中科金财	18,516,842.00	2.88
59	300297	蓝盾股份	18,497,789.84	2.88
60	002572	索菲亚	18,400,387.84	2.86
61	002658	雪迪龙	18,380,538.59	2.86
62	300207	欣旺达	18,377,548.81	2.86
63	600562	国睿科技	18,232,671.12	2.83
64	600366	宁波韵升	17,454,325.48	2.71
65	002642	荣之联	17,403,379.50	2.71
66	601166	兴业银行	17,241,707.81	2.68
67	002400	省广股份	17,011,608.02	2.65
68	002666	德联集团	16,967,779.60	2.64
69	000705	浙江震元	16,891,074.68	2.63
70	300077	国民技术	16,833,634.37	2.62
71	002197	证通电子	16,825,151.01	2.62
72	300015	爱尔眼科	16,806,232.85	2.61
73	600306	商业城	16,772,813.40	2.61
74	300341	麦迪电气	16,622,019.00	2.58
75	300027	华谊兄弟	16,245,595.13	2.53
76	000523	广州浪奇	16,189,400.16	2.52
77	600763	通策医疗	15,919,823.10	2.48
78	601628	中国人寿	15,733,632.00	2.45
79	002063	远光软件	15,688,620.35	2.44
80	600855	航天长峰	15,637,461.17	2.43
81	002366	台海核电	15,563,935.20	2.42
82	002055	得润电子	15,489,896.10	2.41
83	000977	浪潮信息	15,375,354.53	2.39
84	002175	东方网络	15,355,499.40	2.39
85	002113	天润控股	14,719,528.20	2.29
86	603598	引力传媒	14,668,708.42	2.28
87	000151	中成股份	14,643,359.50	2.28
88	300349	金卡股份	14,431,786.40	2.24
89	600511	国药股份	14,394,949.41	2.24
90	002672	东江环保	14,212,415.82	2.21
91	603009	北特科技	14,208,770.00	2.21
92	002654	万润科技	14,166,468.12	2.20
93	300065	海兰信	14,131,027.32	2.20
94	603588	高能环境	13,846,440.80	2.15
95	000783	长江证券	13,842,521.75	2.15
96	300159	新研股份	13,640,147.12	2.12
97	300043	互动娱乐	13,486,584.37	2.10
98	300431	暴风科技	13,379,867.20	2.08
99	002690	美亚光电	13,232,998.92	2.06
100	300367	东方网力	12,999,230.33	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。8.4.3 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	3,605,812,907.08
卖出股票收入（成交）总额	3,766,632,402.99

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。

8.5 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	40,092,000.00	4.85
	其中：政策性金融债	40,092,000.00	4.85
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	40,092,000.00	4.85

8.6 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	150416	15农发16	400,000	40,092,000.00	4.85

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3 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	587,238.54
2	应收证券清算款	23,723,892.96
3	应收股利	–
4	应收利息	528,976.89
5	应收申购款	609,303.86
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	25,449,412.25

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
19,341	19,028.94	42,470,816.68	11.54%	325,567,906.05	88.46%

9.2 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	407,767.02	0.1108%

9.3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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年3月26日)基金份额总额	4,091,745,438.87
本报告期期初基金份额总额	481,299,942.87
本报告期基金总申购份额	559,618,751.95
减：本报告期基金总赎回份额	672,879,972.09
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	368,038,722.73

§11 重大事件揭示

11.1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。

11.2 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

2015年6月2日，本基金管理人完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任总经理刘晓艳。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未有重大变化。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续7年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为86,000.00元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
招商证券	2	171,935,449.29	2.33%	156,529.80	2.45%	–
中金公司	2	1,197,646,982.95	16.25%	1,090,338.93	17.09%	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
德邦证券	1	182,970,515.08	2.48%	161,910.94	2.54%	–
华西证券	1	468,679,078.60	6.36%	374,942.32	5.88%	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–
中信证券	3	162,088,545.12	2.20%	147,566.11	2.31%	–
华安证券	1	32,915,871.79	0.45%	30,653.98	0.48%	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	2	–	–	–	–	–
瑞银证券	1	247,515,831.71	3.36%	228,878.90	3.59%	–
新时代证券	1	56,990,369.73	0.77%	53,075.38	0.83%	–
东兴证券	1	70,061,137.12	0.95%	65,020.07	1.02%	–
东海证券	1	6,750,816.10	0.09%	5,400.65	0.08%	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	2	–	–	–	–	–
西部证券	1	–	–	–	–	–
国金证券	2	772,443,188.37	10.48%	621,238.91	9.74%	–
兴业证券	2	753,759,296.11	10.22%	694,762.38	10.89%	–
民生证券	1	345,942,534.87	4.69%	318,824.91	5.00%	–
华宝证券	1	–	–	–	–	–
山西证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
中投证券	1	78,461,027.91	1.06%	71,430.55	1.12%	–
江海证券	1	–	–	–	–	–
中泰证券	2	168,265,363.35	2.28%	153,187.77	2.40%	–
光大证券	1	131,537,319.40	1.78%	105,229.86	1.65%	–
中银国际	1	–	–	–	–	–
东北证券	1	–	–	–	–	–
广州证券	2	1,898,221,874.00	25.75%	1,526,929.26	23.94%	–
华创证券	1	403,282,813.94	5.47%	369,679.81	5.80%	–
方正证券	1	100,150,720.02	1.36%	92,038.50	1.44%	–
天源证券	1	–	–	–	–	–
广发证券	2	–	–	–	–	–
海通证券	2	122,475,665.61	1.66%	111,501.67	1.75%	–
财富证券	1	–	–	–	–	–
国元证券	1	–	–	–	–	–
申万宏源	1	–	–	–	–	–

注：a）本报告期内本基金减少渤海证券股份有限公司一个交易单元，新增华西证券股份有限公司一个交易单元；齐鲁证券有限公司更名为中泰证券股份有限公司，宏源证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

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。

11.7.2 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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
德邦证券	–	–	–	–	–	–
华西证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
华安证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
瑞银证券	645,284.90	100.00%	–	–	–	–
新时代证券	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–
东海证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
华宝证券	–	–	–	–	–	–
山西证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
江海证券	–	–	–	–	–	–
中泰证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
天源证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
财富证券	–	–	–	–	–	–
国元证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–

易方达基金管理有限公司
二〇一六年三月二十五日