易方达科翔股票型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

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:二〇一五年八月二十六日

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2015年8月20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2015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	1,062,169,364.58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	蒋松云
	联系电话	020-38797888	010-66106799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38799488	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(2015年1月1日至2015年6月30日)
本期已实现收益	746,021,229.16
本期利润	476,620,240.22
加权平均基金份额本期利润	0.6273
本期基金份额净值增长率	84.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.6066
期末基金资产净值	2,863,470,752.88
期末基金份额净值	2.696

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。

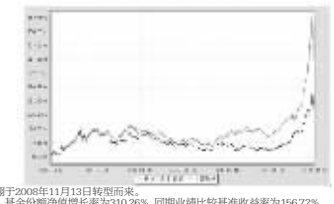
3.2 基金净值表现

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	-17.65%	3.65%	-3.75%	2.85%	-13.90%	0.80%
过去三个月	26.28%	3.16%	18.52%	2.19%	7.76%	0.97%
过去六个月	84.65%	2.53%	38.88%	1.84%	45.77%	0.69%
过去一年	129.28%	1.99%	104.22%	1.45%	25.06%	0.54%
过去三年	170.75%	1.54%	91.25%	1.21%	79.50%	0.33%
自基金合同生效起至今	310.26%	1.46%	156.72%	1.32%	153.54%	0.14%

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2015年6月30日)



注:1.本基金由原基金科翔于2008年11月13日转型而来。

2.自基金转型至报告期末,基金份额净值增长率为310.26%,同期业绩比较基准收益率为156.72%。

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多个子公司。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6月30日,易方达旗下共管理82只开放式基金、15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634.85亿元。

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、易方达价值精选股票型证券投资基金的基金经理、易方达新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达国防军工混合型证券投资基金的基金经理、投资一部副总经理	2014-05-10	-	8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、投资一部总经理助理。

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。

3.为加强基金流动性管理,本基金女排了相关助理协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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,并围绕交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为指令的基本原则,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36次,其中10次为为指数组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易;1次为不同基金经理管理的非指数基金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。

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业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为2.696元,本报告期份额净值增长率为84.65%,同期业绩比较基准收益率为38.88%。

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2015年下半年,宏观经济预计依然偏弱,积极的财政政策配合宽松的货币供应将成为稳增长的主要动力。但是资本市场经历了短期巨幅调整后,"救市"政策的效应需要一段时间逐步显现,投资者的风险偏好等行为方式可能短期发生变化,预期三季度市场波动可能加剧,但是鉴于目前国外监管政策的协调两在合理区间以及限分优质成长股估值调整后风险逐步释放,市场仍然存在结构性机会。

目前资金层面的变化以及政策效果对于股市的影响较为显著,但是从中长期看,我们仍然坚信转型和创新是本轮牛市的核心和主线,大的机会仍然存在于新兴成长的行业中。

基于以上判断,本基金将在下半年适度做出结构调整,保持合理仓位,依据盈利成长性和稳定性的原则,兼顾短、中、长期的投资机会与风险分散布局,保持组合的流动性和稳定性,并继续依据审慎的分析研究在新兴行业中寻找能超越周期的个股,在合适的价位大胆买入并长期持有,分享本轮中国经济升级转型的收益。

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,指导和监督各个估值流程。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

本基金本报告期内实施的利润分配金额为43,867,561.53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,不存在任何相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43,867,561.53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2015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:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:		
银行存款	507,047,147.96	75,054,866.43
结算备付金	28,568,616.34	4,436,994.45
存出保证金	1,427,152.22	539,685.87
交易性金融资产	2,837,361,108.62	796,421,249.25
其中:股票投资	2,677,252,808.62	750,355,732.61
基金投资	-	-
债券投资	160,108,300.00	45,065,516.64
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	-	18,654,841.26
应收利息	1,337,896.83	1,309,732.22
应收股利	-	-
应收申购款	25,373,207.24	641,111.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,401,115,129.21	896,058,480.79
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30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	105,193,152.11	2,326,584.83
应付赎回款	413,198,498.22	9,064,538.51
应付管理人报酬	5,061,930.19	1,208,101.16
应付托管费	841,988.39	201,350.22
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	9,837,023.87	2,501,288.80
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	2,708,721.19	1,388,673.65
负债合计	537,644,376.33	17,493,699.53
所有者权益:		
实收基金	792,581,465.15	426,900,542.00
未分配利润	2,070,889,287.73	451,664,339.26
所有者权益合计	2,863,470,752.88	878,564,881.26
负债和所有者权益总计	3,401,115,129.21	896,058,480.79

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值2.696元,基金份额总额1,062,169,364.58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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一.收入	516,415,874.37	-5,630,794.06
1.利息收入	2,066,935.92	678,893.06
其中:存款利息收入	556,419.64	171,154.16
债券利息收入	1,441,764.28	273,405.63
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	68,752.00	234,333.27
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	779,256,844.35	13,215,262.84
其中:股票投资收益	777,371,329.56	12,286,640.35
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-104,030.29	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	1,989,545.08	892,422.49
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-269,400,988.94	-19,565,663.87
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	4,493,083.04	30,713.91
减:二.费用	39,795,634.15	5,627,297.63
1. 管理人报酬	14,093,289.11	2,497,526.69
2. 托管费	2,348,881.52	416,254.45
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	23,150,435.82	2,517,513.22
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	203,027.70	196,003.27
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	476,620,240.22	-11,258,091.69
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	476,620,240.22	-11,258,091.69

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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	426,900,542.00	451,664,339.26	878,564,881.26
二.本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	476,620,240.22	476,620,240.22
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	365,680,923.15	1,186,472,269.78	1,552,153,192.93
其中:1.基金申购款	1,369,765,585.05	3,876,840,111.23	5,246,605,696.28
2.基金赎回款	-1,004,084,661.90	-2,690,367,841.45	-3,694,452,503.35
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)	-	-43,867,561.53	-43,867,561.53
五.期末所有者权益(基金净值)	792,581,465.15	2,070,889,287.73	2,863,470,752.88

项目	上年度可比期间 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(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(净值减少以"-"号填列)	129,199,891.08	80,459,628.81	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

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:刘晓艳,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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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(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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》和《企业会计准则第30号——财务报表列报》等7项会计准则,上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1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。

6.4.5.2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

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

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

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。

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,免征营业税。

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。

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

个人所得税税率为20%。

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个人所得税。基金从上市公司分配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,减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,减按25%计入应纳税所得额。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
当期发生的基金应支付的管理费	14,093,289.11	2,497,526.69	
其中:支付销售机构的客户维护费	2,071,604.07	229,036.26	

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的15%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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,348,881.52	416,254.45

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;由基金托管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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
期初持有的基金份额	181,667,217.18	47,973,806.65
期间申购/买入总份额	64,976,567.48	181,667,217.18
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	90,000,000.00	-
期末持有的基金份额	156,643,784.66	229,641,023.83
期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.75%	52.93%

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2015年6月30日		上年度末2014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	0.17%	1,782,570.80	0.31%
广发证券	2,034,821.38	0.19%	2,034,821.38	0.36%

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	507,047,147.96	448,925.51	31,623,221.09	156,169.94

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,按银行间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 2015年1月1日至2015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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2015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

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。

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
000669	金鸿能源	2015-04-30	重大事项	37.72	2015-07-23	33.95	1,000,000	27,207,270.98	37,720,000.00	-
000782	美达股份	2015-06-08	重大事项	28.35	-	-	2,882,085	71,327,820.77	81,707,109.75	-
002589	瑞康医药	2015-05-21	重大事项	104.25	-	-	99,977	8,650,796.90	10,422,602.25	-
002682	龙洲股份	2015-06-25	配股停牌	29.70	2015-07-03	21.83	450,070	11,944,275.00	13,367,079.00	-
002741	光华科技	2015-06-02	重大事项	70.04	2015-08-05	63.04	228,100	15,668,698.00	15,976,124.00	-
300007	汉威电子	2015-06-29	重大事项	74.72	2015-08-24	67.25	110,178	11,242,431.36	8,232,500.16	-
300096	易联众	2015-06-28	重大事项	39.55	-	-	100,000	3,940,569.42	3,955,000.00	-
300212	易华录	2015-06-30	重大事项	59.94	2015-07-13	54.00	10,000	773,000.00	599,400.00	-
300287	飞利信	2015-06-02	重大事项	54.26	-	-	700,000	18,409,952.13	37,982,000.00	-
300294	博雅生物	2015-04-23	重大事项	75.46	-	-	100,000	6,454,239.50	7,546,000.00	-
600558	大西洋	2015-03-25	重大事项	19.50	2015-07-20	17.55	399,948	7,925,747.88	7,798,986.00	-
600978	宜华木业	2015-06-18	重大事项	22.44	-	-	1,350,000	26,161,985.29	30,294,000.00	-

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2015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2015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)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次的余额为2,421,652,007.46元,属于第二层次的余额为415,709,101.16元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次639,308,612.85元,第二层次156,112,636.40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;开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6月30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。

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	2,677,252,808.62	78.72
	其中:股票	2,677,252,808.62	78.72
2	固定收益投资	160,108,300.00	4.71
	其中:债券	160,108,300.00	4.71
	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	535,615,764.30	15.75
7	其他各项资产	28,138,256.29	0.83
8	合计	3,401,115,129.21	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	-	-
B	采矿业