易方达中小盘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	易方达中小盘股票
基金主代码	110011
交易代码	110011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月19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司
报告期末基金份额总额	379,788,320.82份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	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,以谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	45%×天相中盘指数收益率+35%×天相小盘指数收益率+20%×中债总指数收益率
风险收益特征	本基金是主动股票型基金,理论上其风险收益水平高于混合型基金和债券基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	王永民
	联系电话	020-38797888	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38799488	010-66594942

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	480,790,837.17
本期利润	471,276,706.29
加权平均基金份额本期利润	0.8258
本期基金份额净值增长率	37.73%
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	1.3516
期末基金资产净值	1,113,925,111.99
期末基金份额净值	2.9330

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。

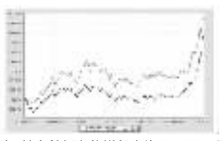
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	-0.28%	2.53%	-7.94%	2.90%	7.66%	-0.37%
过去三个月	20.47%	2.14%	15.98%	2.18%	4.49%	-0.04%
过去六个月	37.73%	1.81%	44.30%	1.76%	-6.57%	0.05%
过去一年	82.28%	1.51%	101.04%	1.38%	-18.76%	0.13%
过去三年	101.94%	1.25%	109.65%	1.17%	-7.71%	0.08%
自基金合同生效起至今	202.79%	1.38%	121.96%	1.42%	80.83%	-0.04%

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

易方达中小盘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6月19日至2015年6月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为202.79%,同期业绩比较基准收益率为121.96%。

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、广东新三联投资发展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、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5348.85亿元。

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		
张坤	本基金的基金经理,易方达亚洲精选股票型证券投资基金的基金经理	2012-09-28	-	7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、基金投资部基金经理助理。

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,本基金安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3次,其中2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年上半年,A股市场先涨后跌,沪深300指数上涨26.58%,上证指数上涨32.23%。

上半年,为了对冲经济下滑,政府继续采取了一系列货币政策和财政政策。货币政策方面,延续了去年四季度以来的宽松基调,央行在2月、5月和6月各进行了一次降息,在2月、4月和6月各进行了一次降准。财政政策方面,加快了铁路基建项目的审批速度。在二者的综合作用下,经济出现了一定的企稳迹象。资金方面,整体的流动性水平仍然较为宽松,场内融资和场外配资规模迅速增长。然而6月份以来,随着部分个股出现下跌引发高杠杆配资的平仓,并扩散到其他杠杆资金,市场出现了剧烈回调。结构方面,以软件、传媒、通信等为代表的新兴行业在上半年表现较好,创业板指数大幅上涨94.23%。整体来看,小市值公司的表现强于大市值公司。

本基金在上半年股票仓位基本维持平衡,并对结构进行了调整:降低了金融、地产行业的配置,增加了食品饮料、汽车行业的配置。个股方面,降低了部分高估值的小盘股配置,增加了业务模式有特色、长期逻辑清晰、估值水平合理的个股的投资比例。

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2.9330元,本报告期份额净值增长率为37.73%,同期业绩比较基准收益率为44.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济方面,随着货币和财政政策的宽松,地产销售逐步回暖,经济的尾部风险基本消除。目前来看,流动性水平大幅收紧的概率很小。

证券市场方面,以创业板为代表的中小市值公司在大幅上涨后,大小市值股票的估值差距被进一步拉大。很多中小市值股票被给予了高成长预期,在估值和预期如此高的情况下,未来能否兑现依然存疑。对于中大市值公司来说,不少公司在长期的竞争中已经形成了坚固的竞争壁垒,资产负债表和现金流十分健康,其成长速度不快却很扎实,其估值反应的是对中期前景的较为悲观的预期。特别是部分优质个股在6月底随市场出现了明显下跌,可以开始逐步配置。

在此背景下,本基金计划大体维持目前权益类资产的配置比例,力求以精选行业和个股为根本来获取超额收益。行业方面,选择市场空间广阔、竞争格局稳定的行业;个股方面,重点选择长期逻辑清晰、竞争壁垒高和管理优秀的两类企业:一是经过时间考验的行业龙头公司,二是经营模式有特色的中小公司。通过分享这些优秀企业的成长为投资者带来回报。

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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对易方达中小盘股票型证券投资基金(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。

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持有人利益的行为。

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)

6.1 资产负债表

会计主体:易方达中小盘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	49,271,828.91	29,789,878.64
结算备付金	7,874.20	-
存出保证金	807,680.86	341,621.90
交易性金融资产	1,066,349,914.00	1,497,409,011.24
其中:股票投资	1,026,193,914.00	1,427,378,011.24
基金投资	-	-
债券投资	40,156,000.00	70,031,000.00
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	17,350,501.02	15,403,000.00
应收利息	1,012,796.28	2,008,420.52
应收股利	-	-
应收申购款	21,355,270.81	3,494,878.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,156,155,866.08	1,548,446,810.44
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	-	-
应付赎回款	39,264,206.87	17,657,733.70
应付管理人报酬	1,481,987.69	1,877,448.58
应付托管费	246,997.93	312,908.11
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	724,701.57	784,823.13
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	512,860.03	664,019.49
负债合计	42,230,754.09	21,296,933.01
所有者权益:		
实收基金	379,788,320.82	717,147,302.34
未分配利润	734,136,791.17	810,002,575.09
所有者权益合计	1,113,925,111.99	1,527,149,877.43
负债和所有者权益总计	1,156,155,866.08	1,548,446,810.44

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值2.9330元,基金份额总额379,788,320.82份。

6.2 利润表

会计主体:易方达中小盘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	487,854,114.07	-996,074.15
1.利息收入	1,284,845.20	3,084,141.75
其中:存款利息收入	149,113.78	511,408.37
债券利息收入	1,135,731.42	2,085,172.60
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	487,560.78
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	496,431,632.84	106,136,476.48
其中:股票投资收益	479,917,009.31	81,694,435.73
基金投资收益	-	-
债券投资收益	138,713.97	66,560.00
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	15,375,909.56	24,375,480.75
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-9,514,130.88	-110,475,931.51
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	651,766.91	259,239.13
减:二、费用	16,577,407.78	18,988,003.88
1. 管理人报酬	10,546,732.94	13,447,478.94
2. 托管费	1,757,788.80	2,241,246.53
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,037,767.41	3,067,579.01
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	235,118.63	231,699.40
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	471,276,706.29	-19,984,078.03
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	471,276,706.29	-19,984,078.03

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达中小盘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)	717,147,302.34	810,002,575.09	1,527,149,877.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	471,276,706.29	471,276,706.29
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)	-337,358,981.52	-547,142,490.21	-884,501,471.73
其中:1.基金申购款	200,060,809.33	308,861,001.67	508,921,811.00
2.基金赎回款	-537,419,790.85	-856,003,491.88	-1,393,423,282.73
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)	379,788,320.82	734,136,791.17	1,113,925,111.99
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)	1,209,886,266.69	750,472,597.92	1,960,358,864.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-19,984,078.03	-19,984,078.03
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)	-139,426,452.60	-78,474,275.58	-217,900,728.18
其中:1.基金申购款	156,785,255.26	90,799,771.99	247,585,027.25
2.基金赎回款	-296,211,707.86	-169,274,047.57	-465,485,755.43
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)	1,070,459,814.09	652,014,244.31	1,722,474,058.40

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

易方达中小盘股票型证券投资基金(以下简称"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644号《关于核准易方达中小盘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《易方达中小盘股票型证券投资基金基金合同》公开募集。基金合同于2008年6月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,226,705,470.21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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.2 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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《易方达中小盘股票型证券投资基金合同》和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。

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

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,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。2013年1月1日以前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金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,暂减按25%计入应纳税所得额。

(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。

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

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	10,546,732.94	13,447,478.94
其中:支付销售机构的客户维护费	1,725,229.52	2,066,528.73

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首日起10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	1,757,788.80	2,241,246.53

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;由基金托管人于次月首日起10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

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

无。

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
中国银行股份有限公司	49,271,828.91	132,102.01	96,774,090.85	473,868.97

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	600089	特变电工	配股发行	792,015	5,464,903.50

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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000669	金鸿能源	2015-01-13	2016-01-14	非公开发行流通受限	21.10	28.56	730,000	15,403,000.00	20,848,800.00	-

注:1.中油金鸿能源投资股份有限公司于2015年6月26日(流通受限期内),向全体股东每10股派2元人民币现金(含税);

2.以上"可流通日"是根据上市公司公告估算的流通日期。

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
600872	中炬高新	2015-05-04	重大事项	21.62	-	-	5,300,000	55,739,786.55	114,586,000.00	-

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890,759,114.00元,属于第二层次的余额为175,590,800.00元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次1,427,219,811.24元,第二层次70,189,200.00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	1,026,193,914.00	88.76
	其中:股票	1,026,193,914.00	88.76
2	固定收益投资	40,156,000.00	3.47
	其中:债券	40,156,000.00	3.47
	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	49,279,703.11	4.26
7	其他各项资产	40,526,248.97	3.51
8	合计	1,156,155,866.08	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	-	-
C	制造业	862,238,924.00	77.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,848,800.00	1.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	57,836,800.00	5.19
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	85,260,000.00	7.65
L	租赁和商务服务业	9,390.00	0.00
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	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	1,026,193,914.00	92.12

7.3 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	600872	中炬高新	5,300,000	114,586,000.00	10.29
2	600887	伊利股份	5,900,000	111,510,000.00	10.01
3	600066	宇通客车	5,320,000	109,326,000.00	9.81
4	000858	五粮液	3,400,000	107,780,000.00	9.68
5	600519	贵州茅台	415,000	106,924,750.00	9.60
6	600340	华夏幸福	2,800,000	85,260,000.00	7.65
7	002422	科伦药业	1,600,000	64,064,000.00	5.75
8	000651	格力电器	900,000	57,510,000.00	5.16
9	002572	索菲亚	1,463,300	56,527,279.00	5.07
10	000568	泸州老窖	1,462,500	47,692,125.00	4.28

注:1.本报告期末本基金投资中炬高新(600872)、伊利股份(600887)占基金资产净值超过10%,属于被动超标。

2.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	600694	大商股份	76,227,671.43	4.99
2	000001	平安银行	70,511,506.02	4.62
3	002422	科伦药业	67,492,683.19	4.42
4	601318	中国平安	51,592,246.72	3.38
5	600661	新南洋	51,441,303.54	3.37
6	000568	泸州老窖	47,703,979