

易方达科翔混合型证券投资基金

2016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:二〇一七年三月三十一日

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对本基金报告的整体内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经本公司内部审核部门进行复核。基金经理对本报告书之内容的真实性、准确性和完整性负责,并保证不存在虚假记载、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。本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的约定,于2017年3月27日复核了本报告书的财务指标、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当仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要请见年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本报告中所引用的数据已经审计,安华永明会计师事务所(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,报告投资者注意阅读。

本报告期自2016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

基金名称:易方达科翔混合
基金简称:易方达科翔混合
基金代码:110013
基金类型:股票型
交易代码:110013
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2006年1月13日
基金托管人:易方达基金管理有限公司
基金销售机构:中国工商银行股份有限公司
基金份额净值:1.100,440.44736
基金资产净值:不适用

2.2 基金产品说明

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。

本基金在市场环境这一端,2016年初在人民币贬值的强烈预期下,A股市场出现了一轮较深的回调,拖累沪深300指数全年下跌11.28%,而创业板综合指数更是下跌了20.35%。市场体现出资金量博弈和“恐慌向空”的趋势。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部发布的《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,同时在具体会计政策和会计估计上也考虑了中国证监会投资基金协会制定并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会投资基金协会制定的《关于进一步规范证券投资基金会计业务的指导意见》、《关于证券投资基金会计核算办法》、《证券投资基金信息报告与披露办法》等第2号《年度报告与半年度报告》及其他中国证监会颁布的有关规定。

7.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末,本基金持有的债券正回购交易余额为0元。

7.4.4 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金未持有交易所市场的债券正回购余额为0元。

7.4.5 公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值是指在公平交易中,熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者负债清偿时所确定的价格。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

于2016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2,020,387,345.38元,属于第二层次的余额为312,043,274.04元,无属于第三层次的余额(2015年12月31日:第一层次1,953,600,325.78元,第二层次72,621,110,886.75元,无属于第三层次的余额)。

(c)金融资产减值

于2016年12月31日,本基金持有的金融资产减值准备金额为0元。

(d)金融负债

于2016年12月31日,本基金未持有金融负债的公允价值准备金额为0元。

(e)其他

于2016年12月31日,本基金未持有其他金融负债的公允价值准备金额为0元。

7.4.6 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.7 其他资产

于2016年12月31日,本基金未持有其他资产的公允价值准备金额为0元。

7.4.8 其他负债

于2016年12月31日,本基金未持有其他负债的公允价值准备金额为0元。

7.4.9 期末债券正回购交易余额

截至本报告期末,本基金持有的债券正回购交易余额为0元。

7.4.10 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.11 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.12 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.13 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.14 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.15 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.16 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.17 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.18 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.19 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.20 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.21 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.22 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.23 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.24 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.25 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.26 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.27 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.28 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.29 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.30 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.31 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.32 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.33 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.34 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.35 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.36 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.37 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.38 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.39 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.40 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.41 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.42 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.43 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.44 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.45 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.46 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.47 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.48 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.49 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.50 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.51 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.52 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.53 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.54 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.55 期末持有的待摊费用

于2016年12月31日,本基金未持有待摊费用的公允价值准备金额为0元。

7.4.56 期末持有的待摊费用