

**易方达生物科技指数分级证券投资基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 年 6 月 30 日**

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
2 基金简介 .....	6
2.1 基金基本情况 .....	6
2.2 基金产品说明 .....	6
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	7
2.4 信息披露方式 .....	7
2.5 其他相关资料 .....	7
3 主要财务指标和基金净值表现 .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	13
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 .....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	14
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
7 投资组合报告 .....	33
7.1 期末基金资产组合情况 .....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	37
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 .....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	37
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 .....	37
7.9 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 .....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	37

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	37
7.12 投资组合报告附注 .....	38
8 基金份额持有人信息 .....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
8.4 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 .....	40
9 开放式基金份额变动 .....	41
10 重大事件揭示 .....	41
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
10.2 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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	43
11 备查文件目录 .....	46
11.1 备查文件目录 .....	46
11.2 存放地点 .....	46
11.3 查阅方式 .....	46



## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达生物科技指数分级证券投资基金		
基金简称	易方达生物分级		
基金主代码	161122		
交易代码	161122		
基金运作方式	契约型开放式、分级基金		
基金合同生效日	2015 年 6 月 3 日		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	221,119,759.41 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 6 月 11 日		
下属分级基金的基金简称	易方达生物分级	易方达生物分级 A	易方达生物分级 B
下属分级基金场内简称	生物分级	生物 A	生物 B
下属分级基金的交易代码	161122	150257	150258
报告期末下属分级基金的份额总额	188,002,143.41 份	16,558,808.00 份	16,558,808.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密追踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。		
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。		
业绩比较基准	中证万得生物科技指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。长期而言，其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；A 类份额具有预期风险、收益较低的特征；B 类份额具有预期风险、收益较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	基础份额为股票型基金，其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	与基础份额相比，A 类份额的预期收益和预期风险低于基础份额。	与基础份额相比，B 类份额的预期收益和预期风险高于基础份额。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## 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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-14,993,711.35
本期利润	-42,603,926.46

加权平均基金份额本期利润	-0.1865
本期加权平均净值利润率	-18.62%
本期基金份额净值增长率	-15.02%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-128,037,035.59
期末可供分配基金份额利润	-0.5790
期末基金资产净值	229,872,935.82
期末基金份额净值	1.0396
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-32.80%

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.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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

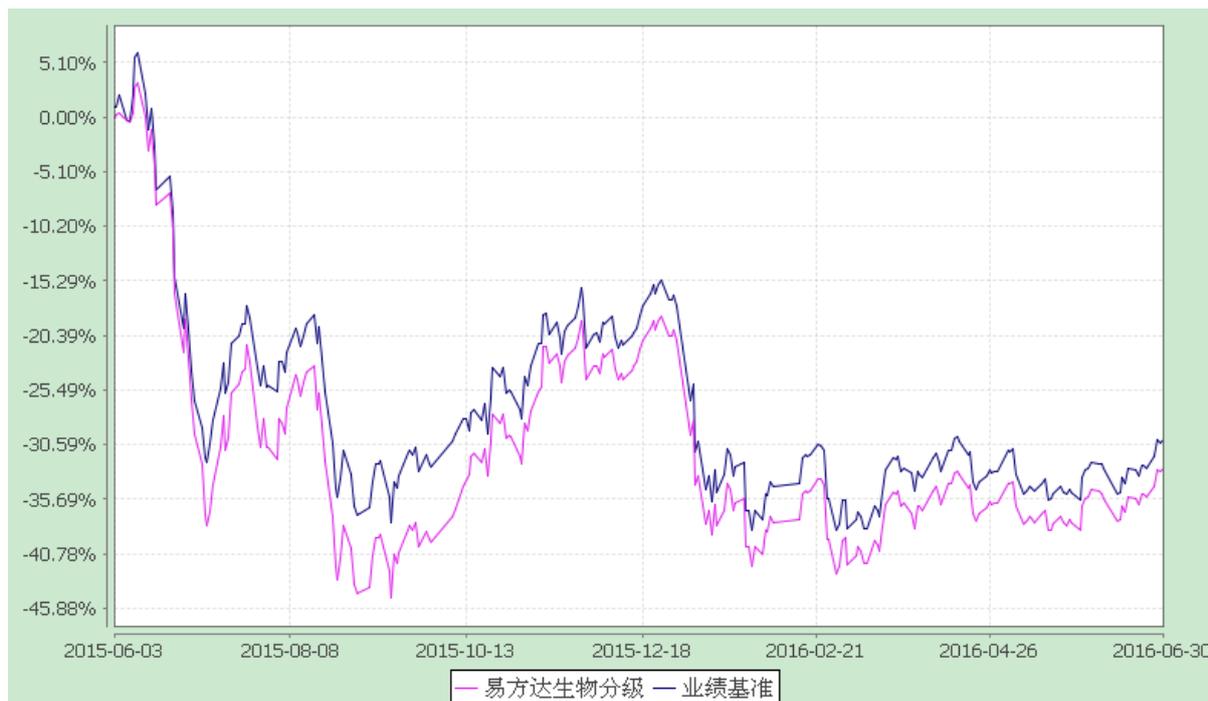
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.57%	1.35%	5.30%	1.33%	0.27%	0.02%
过去三个月	5.62%	1.53%	4.82%	1.51%	0.80%	0.02%
过去六个月	-15.02%	2.48%	-15.14%	2.36%	0.12%	0.12%
过去一年	-17.20%	2.80%	-16.25%	2.47%	-0.95%	0.33%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-32.80%	2.81%	-30.11%	2.52%	-2.69%	0.29%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

易方达生物科技指数分级证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年6月3日至2016年6月30日)



注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十五部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-32.80%，同期业绩比较基准收益率为-30.11%。

## 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2016年6月30日，易方达旗下共管理92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，管理公募基金总规模4056.91亿元。

#### 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	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----

		理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
王建军	本基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、指数与量化投资部总经理助理	2015-06-03	-	9 年	博士研究生，曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理。
成曦	本基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理助理（自 2015 年 9 月 2 日至 2016 年 5 月 6 日）、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理（自 2015 年 9 月 2 日至 2016 年 5 月 6 日）、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理助理（自 2015 年 9 月 2 日至 2016 年 5 月 6 日）、易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理助理（自 2015 年 9 月 2 日至 2016 年 5 月 6 日）、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理助理（自 2015 年 9 月 2 日至 2016 年 5 月 6 日）	2016-05-07	-	8 年	硕士研究生，曾任华泰联合证券资产管理部研究员；易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员。

	月 6 日)、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理(自 2015 年 9 月 2 日至 2016 年 5 月 6 日)、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理助理(自 2015 年 9 月 2 日至 2016 年 5 月 6 日)、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理(自 2015 年 9 月 2 日至 2016 年 5 月 6 日)				
--	--	--	--	--	--

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，王建军的“任职日期”为基金合同生效之日，成曦的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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.根据 2016 年 7 月 6 日《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理变更公告》，自 2016 年 7 月 6 日起，王建军不再担任本基金的基金经理，成曦仍任本基金的基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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 16 次，其中 13 次为指数及量化投资因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；3 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

2016 年 2 季度 GDP 增速为 6.7%，与 1 季度持平，上半年由基建、房地产项目投资惯性及企业存货回补，对 2 季度的 GDP 起到了一定支撑，并且一定程度上对冲了制造业下滑的影响。投资方面，固定资产投资、制造业投资、房地产开发投资累计同比均在二季度有所下滑；工业方面，工业增加值同比增速在 2 季度有轻微提升；消费方面，上半年社会消费品同比数据保持在 10% 上下，较为平稳；物价方面，年初以来的高 CPI 数据，在 2 季度有所回落至 1.9%；流动性方面，新增人民币贷款在经过 4，5 月份的收紧之后，6 月份上升至 1.38 万亿。

综合来看，由上半年基建、房地产带来的投资已经有所回落，同时消费保持平稳增长，金融体系资金供给总体充裕，全年经济大概率成“L”型走势。

##### 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 1.0396 元，本报告期份额净值增长率为-15.02%，同期业绩比较基准收益率为-15.14%，年化跟踪误差 3.25%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段市场：宏观经济的推动力主要来自于国企改革，供给侧改革对生产效率的提升，市场的表现还需要关注流动性的变动和人民币汇率的波动；风险方面特别需要关注信用违约事件的进程。从朝阳永续指数一致预期数据来看，虽然市场整体收入利润增速下降，但个别创新性行业依然能够保持较高增速，市场结构性特征较为明显。

在产业方面：2010-2015 期间，可以看作以智能手机普及为代表的\*\*波智能化浪潮；从 2015 年之后，更多的智能产业：智能制造、智慧城市、智能家居、智能物流、虚拟现实等概念逐渐产业化；此外，升级的消费产业，例如：医疗美容、教育培训、生物科技等产业也逐渐成为中国经济发展的重要组成部分。

生物科技公司主要由于其技术\*\*专业性，研究的长期性，能够给企业带来专利期间内的高速增长和坚固的壁垒；在这个行业，更易出现爆发式增长的企业。基于此，本指数中长期投资价值明显。

作为被动投资的基金，生物科技指数分级基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对业绩基准的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望生物科技指数分

级基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会，为各类不同风险偏好的投资者提供多样性的投资工具。

#### 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《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金合同》的约定，分级运作期内，本基金(包括生物科技分级基础份额、生物科技 A 类份额、生物科技 B 类份额)不进行收益分配。

## 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人复核审查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。

## 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：易方达生物科技指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,672,837.21	17,794,479.34
结算备付金		-	-
存出保证金		19,094.70	312,536.15
交易性金融资产	6.4.7.2	216,782,683.00	272,960,019.48
其中：股票投资		216,782,683.00	272,960,019.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,998,485.57	-
应收利息	6.4.7.5	2,286.21	3,826.40
应收股利		-	-
应收申购款		214,002.53	241,426.58
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		232,689,389.22	291,312,287.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,305,659.03	1,245,043.29
应付管理人报酬		182,524.68	246,485.39
应付托管费		40,155.43	54,226.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	20,822.85	79,135.72
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	267,291.41	309,884.59
<b>负债合计</b>		<b>2,816,453.40</b>	<b>1,934,775.76</b>
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	342,102,713.95	365,978,116.60
未分配利润	6.4.7.10	-112,229,778.13	-76,600,604.41
<b>所有者权益合计</b>		<b>229,872,935.82</b>	<b>289,377,512.19</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>232,689,389.22</b>	<b>291,312,287.95</b>

注:1.本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日,2015 年度实际报告期间为 2015 年 6 月 3 日至 2015 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2016 年 6 月 30 日,易方达生物分级份额净值 1.0396 元,易方达生物分级 A 份额参考净值 1.0035 元,易方达生物分级 B 份额参考净值 1.0757 元;基金份额总额 221,119,759.41 份,下属分级基金的份额总额分别为:易方达生物分级基金份额总额 188,002,143.41 份,易方达生物分级 A 基金份额总额 16,558,808.00 份,易方达生物分级 B 基金份额总额 16,558,808.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 易方达生物科技指数分级证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 3 日 (基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

<b>一、收入</b>		<b>-40,778,217.40</b>	<b>-155,494,520.27</b>
1.利息收入		55,846.23	177,038.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	55,846.23	158,329.96
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	18,708.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,317,187.64	92,903.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-14,118,431.83	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	801,244.19	92,903.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-27,610,215.11	-156,010,018.13
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	93,339.12	245,556.16
<b>减：二、费用</b>		<b>1,825,709.06</b>	<b>1,383,020.30</b>
1. 管理人报酬		1,139,135.33	540,097.71
2. 托管费		250,609.76	118,821.49
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	113,525.12	670,219.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	322,438.85	53,881.70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-42,603,926.46</b>	<b>-156,877,540.57</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-42,603,926.46</b>	<b>-156,877,540.57</b>

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，上年度可比期间为 2015 年 6 月 3 日至 2015 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达生物科技指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	365,978,116.60	-76,600,604.41	289,377,512.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-42,603,926.46	-42,603,926.46
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）	-23,875,402.65	6,974,752.74	-16,900,649.91
其中：1.基金申购款	93,694,975.97	-35,430,107.56	58,264,868.41
2.基金赎回款	-117,570,378.62	42,404,860.30	-75,165,518.32
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）	342,102,713.95	-112,229,778.13	229,872,935.82
项目	上年度可比期间 2015 年 6 月 3 日（基金合同生效日）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）	682,254,585.58	-	682,254,585.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-156,877,540.57	-156,877,540.57
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）	64,935,756.04	15,999,698.61	80,935,454.65
其中：1.基金申购款	271,582,233.19	4,455,176.98	276,037,410.17
2.基金赎回款	-206,646,477.15	11,544,521.63	-195,101,955.52
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）	747,190,341.62	-140,877,841.96	606,312,499.66

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 3 日，上年度可比期间为 2015 年 6 月 3 日至 2015 年 6 月 30 日。

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

易方达生物科技指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015] 675 号《关于准予易方达生物科技指数分级证券投资基金注册的批复》进行募集,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《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 3 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 682,254,585.58 份基金份额,其中认购资金利息折合 126,527.94 份基金份额。根据《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金合同》的约定,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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

### 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》、《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协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

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。

### 6.4.5 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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号

《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对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。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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，股票的股息、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。

(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，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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	13,672,837.21
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	13,672,837.21

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	282,899,901.31	216,782,683.00	-66,117,218.31

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		282,899,901.31	216,782,683.00	-66,117,218.31

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,278.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.74
合计	2,286.21

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	20,822.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	20,822.85

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,440.95
预提费用	208,850.46
其他应付款	50,000.00
合计	267,291.41

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	231,077,313.78	365,978,116.60
本期申购	56,455,306.10	89,414,058.94
本期赎回（以“-”号填列）	-68,213,048.84	-108,035,944.44
2016年6月2日基金拆分/份额折算前	219,319,571.04	347,356,231.10
基金拆分/份额折算调整	5,195,740.39	—
本期申购	2,766,997.91	4,280,917.03
本期赎回（以“-”号填列）	-6,162,549.93	-9,534,434.18
本期末	221,119,759.41	342,102,713.95

注：1. 根据本基金的基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2016 年 6 月 2 日为份额折算基准日，对易方达生物分级份额和易方达生物分级 A 份额实施定期份额折算。

2. 根据本基金基金合同规定，投资者可申购、赎回易方达生物分级份额，易方达生物分级 A 份额和易方达生物分级 B 份额不能单独申购赎回，只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露易方达生物分级 A 份额和易方达生物分级 B 份额的情况。报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 221,119,759.41 份，其中易方达生物分级份额 188,002,143.41 份，易方达生物分级 A 份额 16,558,808.00 份，易方达生物分级 B 份额 16,558,808.00 份。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-121,878,371.13	45,277,766.72	-76,600,604.41
本期利润	-14,993,711.35	-27,610,215.11	-42,603,926.46
本期基金份额交易产生的变动数	8,835,046.89	-1,860,294.15	6,974,752.74
其中：基金申购款	-32,170,293.73	-3,259,813.83	-35,430,107.56
基金赎回款	41,005,340.62	1,399,519.68	42,404,860.30
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-128,037,035.59	15,807,257.46	-112,229,778.13
-----	-----------------	---------------	-----------------

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	55,069.56
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	425.08
其他	351.59
合计	55,846.23

**6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	47,924,029.10
减：卖出股票成本总额	62,042,460.93
买卖股票差价收入	-14,118,431.83

**6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	801,244.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	801,244.19

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-27,610,215.11
——股票投资	-27,610,215.11
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-27,610,215.11

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	93,339.12
基金合同生效前利息收入	-
其他	-
合计	93,339.12

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	113,525.12
银行间市场交易费用	-
合计	113,525.12

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	4,588.39
银行间账户维护费	9,000.00
上市费	29,835.26
指数使用费	100,000.00
其他	-
合计	322,438.85

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 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。

**6.4.9.2 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、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	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

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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 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。

**6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年6月3日(基金合同生 效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,139,135.33	540,097.71
其中：支付销售机构的客户维护费	257,047.63	73,857.95

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年6月3日(基金合同生 效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	250,609.76	118,821.49

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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

易方达生物分级

无。

易方达生物分级 A

无。

易方达生物分级 B

无。

#### 6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年6月3日（基金合同生效日） 至2015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
中国建设银行	13,672,837.2 1	55,069.56	93,588,925.7 6	158,266.82

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。

#### 6.4.10.6 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 2016年1月1日至2016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	002790	瑞尔特	新股网下 发行	1,763	29,230.54
广发证券	300518	盛讯达	新股网下 发行	926	20,575.72
广发证券	603028	赛福天	新股网下 发行	3,309	14,096.34
广发证券	603131	上海沪工	新股网下	1,263	12,743.67

			发行		
广发证券	603339	四方冷链	新股网下发行	1,920	19,564.80
上年度可比期间 2015 年 6 月 3 日（基金合同生效日）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
-	-	-	-	-	-

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

根据《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金合同》的约定，分级运作期内，本基金(包括生物科技分级基础份额、生物科技 A 类份额、生物科技 B 类份额)不进行收益分配。

**6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股流通受限	12.98	12.98	1,851	24,025.98	24,025.98	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-

**6.4.12.2 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

000004	国农科技	2016-03-24	重大事项停牌	36.83	-	-	50,238	1,806,762.05	1,850,265.54	-
300142	沃森生物	2016-03-22	重大事项停牌	8.59	-	-	984,194	13,668,917.85	8,454,226.46	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	20.92	2016-07-01	23.01	6,101	21,170.47	127,632.92	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2015 年 12 月 31 日：0.00%)。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

**6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自投资于品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

**6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

**6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,672,837.21	-	-	-	13,672,837.21
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	19,094.70	-	-	-	19,094.70
交易性金融资产	-	-	-	216,782,683.00	216,782,683.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,998,485.57	1,998,485.57
应收利息	-	-	-	2,286.21	2,286.21
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,597.81	-	-	211,404.72	214,002.53
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,694,529.72	-	-	218,994,859.50	232,689,389.22
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	-	-	-	2,305,659.03	2,305,659.03
应付管理人报酬	-	-	-	182,524.68	182,524.68
应付托管费	-	-	-	40,155.43	40,155.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	20,822.85	20,822.85
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	267,291.41	267,291.41
负债总计	-	-	-	2,816,453.40	2,816,453.40

					0
利率敏感度缺口	13,694,529.72	-	-	216,178,406.10	229,872,935.82
<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	17,794,479.34	-	-	-	17,794,479.34
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	312,536.15	-	-	-	312,536.15
交易性金融资产	-	-	-	272,960,019.48	272,960,019.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,826.40	3,826.40
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	47,340.24	-	-	194,086.34	241,426.58
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,154,355.73	-	-	273,157,932.22	291,312,287.95
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	-	-	-	1,245,043.29	1,245,043.29
应付管理人报酬	-	-	-	246,485.39	246,485.39
应付托管费	-	-	-	54,226.77	54,226.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	79,135.72	79,135.72
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	309,884.59	309,884.59
负债总计	-	-	-	1,934,775.76	1,934,775.76
利率敏感度缺口	18,154,355.73	-	-	271,223,156.46	289,377,512.19

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	216,782,683.00	94.31	272,960,019.48	94.33
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	216,782,683.00	94.31	272,960,019.48	94.33

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	11,470,160.81	14,334,072.70
2.业绩比较基准下降 5%	-11,470,160.81	-14,334,072.70	

#### 6.4.14 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 2016 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 206,350,558.08 元，属于第二层次的余额为 10,432,124.92 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 246,687,340.12 元，第二层次 26,272,679.36 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。

##### (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 2016 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(2015 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	216,782,683.00	93.16
	其中：股票	216,782,683.00	93.16
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	13,672,837.21	5.88
7	其他各项资产	2,233,869.01	0.96
8	合计	232,689,389.22	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	207,953,010.20	90.46

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	127,632.92	0.06
F	批发和零售业	-	-
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	52,689.40	0.02
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	8,649,350.48	3.76
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	216,782,683.00	94.31

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002252	上海莱士	493,430	18,592,442.40	8.09
2	600867	通化东宝	853,251	17,653,763.19	7.68
3	002007	华兰生物	415,888	13,058,883.20	5.68
4	000661	长春高新	121,705	12,983,489.40	5.65
5	002030	达安基因	453,808	12,615,862.40	5.49
6	002038	双鹭药业	367,504	11,091,270.72	4.82
7	600645	中源协和	245,567	8,629,224.38	3.75
8	300009	安科生物	284,507	8,501,069.16	3.70
9	300142	沃森生物	984,194	8,454,226.46	3.68
10	300199	翰宇药业	397,971	8,098,709.85	3.52
11	002022	科华生物	366,712	7,814,632.72	3.40
12	300238	冠昊生物	176,547	7,746,882.36	3.37
13	300122	智飞生物	429,265	6,640,729.55	2.89
14	600161	天坛生物	230,491	6,405,344.89	2.79

15	000518	四环生物	920,733	6,205,740.42	2.70
16	300294	博雅生物	95,649	6,012,496.14	2.62
17	002399	海普瑞	334,612	5,842,325.52	2.54
18	002550	千红制药	686,822	5,728,095.48	2.49
19	002581	未名医药	177,000	4,823,250.00	2.10
20	600165	新日恒力	344,388	4,552,809.36	1.98
21	300463	迈克生物	149,706	4,052,541.42	1.76
22	300109	新开源	60,985	3,872,547.50	1.68
23	300439	美康生物	91,224	3,282,239.52	1.43
24	300255	常山药业	379,132	3,146,795.60	1.37
25	300204	舒泰神	170,257	3,139,539.08	1.37
26	300485	赛升药业	64,389	2,991,512.94	1.30
27	300482	万孚生物	47,218	2,500,193.10	1.09
28	300289	利德曼	151,705	2,269,506.80	0.99
29	300254	仟源医药	80,543	2,050,624.78	0.89
30	300406	九强生物	90,458	1,940,324.10	0.84
31	000004	国农科技	50,238	1,850,265.54	0.80
32	002693	双成药业	187,438	1,773,163.48	0.77
33	002680	长生生物	39,216	1,629,032.64	0.71
34	300516	久之洋	794	139,084.98	0.06
35	603737	三棵树	1,194	138,599.52	0.06
36	601611	中国核建	6,101	127,632.92	0.06
37	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.03
38	601127	小康股份	3,126	74,617.62	0.03
39	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.03
40	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
41	300518	盛讯达	926	43,383.10	0.02
42	603958	哈森股份	1,746	25,317.00	0.01
43	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
44	601966	玲珑轮胎	1,851	24,025.98	0.01
45	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
46	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01
47	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
48	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

#### 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	600165	新日恒力	4,288,476.00	1.48
2	002252	上海莱士	2,705,959.00	0.94
3	000661	长春高新	2,701,302.29	0.93
4	600867	通化东宝	2,405,001.75	0.83
5	002030	达安基因	1,642,910.00	0.57
6	002007	华兰生物	1,538,422.00	0.53
7	600645	中源协和	1,229,568.00	0.42
8	002038	双鹭药业	1,189,199.76	0.41
9	300142	沃森生物	1,093,605.58	0.38
10	300122	智飞生物	1,018,427.60	0.35
11	002022	科华生物	985,969.64	0.34
12	300238	冠昊生物	982,323.00	0.34
13	300199	翰宇药业	953,402.00	0.33
14	600161	天坛生物	944,491.00	0.33
15	000518	四环生物	914,287.00	0.32
16	002399	海普瑞	884,057.96	0.31
17	300009	安科生物	807,717.00	0.28
18	002550	千红制药	734,355.00	0.25
19	002581	未名医药	640,564.00	0.22
20	300294	博雅生物	612,683.05	0.21

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	002252	上海莱士	4,044,288.82	1.40
2	300122	智飞生物	3,871,557.55	1.34
3	600867	通化东宝	3,767,617.87	1.30
4	002030	达安基因	2,682,632.65	0.93
5	002007	华兰生物	2,548,800.41	0.88
6	000661	长春高新	2,299,112.40	0.79
7	002038	双鹭药业	2,091,958.18	0.72
8	300009	安科生物	2,037,771.95	0.70
9	600645	中源协和	1,870,651.97	0.65
10	300199	翰宇药业	1,630,284.53	0.56
11	002022	科华生物	1,600,006.35	0.55
12	002399	海普瑞	1,537,370.62	0.53
13	600161	天坛生物	1,417,491.11	0.49
14	000518	四环生物	1,386,662.93	0.48
15	300294	博雅生物	1,274,896.13	0.44
16	002550	千红制药	1,239,497.59	0.43
17	002581	未名医药	1,026,127.70	0.35

18	300463	迈克生物	925,348.49	0.32
19	002680	长生生物	827,667.99	0.29
20	300485	赛升药业	734,805.77	0.25

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收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	33,475,339.56
卖出股票收入（成交）总额	47,924,029.10

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本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所有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。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

#### 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	19,094.70
2	应收证券清算款	1,998,485.57
3	应收股利	-
4	应收利息	2,286.21
5	应收申购款	214,002.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,233,869.01

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	300142	沃森生物	8,454,226.46	3.68	重大事项停 牌

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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	个人投资者

			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
易方达生物分 级	11,043	17,024.55	785,798.00	0.42%	187,216,345.41	99.58%
易方达生物分 级 A	545	30,383.13	8,290,204.00	50.07%	8,268,604.00	49.93%
易方达生物分 级 B	1,334	12,412.90	501,301.00	3.03%	16,057,507.00	96.97%
合计	12,922	17,111.88	9,577,303.00	4.33%	211,542,456.41	95.67%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属基金份额的合计数。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

### 易方达生物分级A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	民生通惠资产—中信银行—民生通惠聚利3号资产管理产品	1,842,963.00	11.13%
2	德邦基金—招商银行—中泰稳盈回报1号资产管理计划	1,467,238.00	8.86%
3	海通证券资管—招商证券—海通怡然恒旭1号集合资产管理计划	1,161,991.00	7.02%
4	上海明泫投资管理有限公司—明泫全天候一号基金	982,779.00	5.94%
5	易方达基金—农业银行—中油财务有限责任公司	961,000.00	5.80%
6	上海明泫投资管理有限公司—明泫多策略对冲1号基金	718,800.00	4.34%
7	汪巍群	500,000.00	3.02%
8	海通资管—建行—海通海蓝宝润集合资产管理计划	350,000.00	2.11%
9	海通资管—民生—海通年年升集合资产管理计划	300,000.00	1.81%
10	刘淞微	260,000.00	1.57%
11	葛兴东	260,000.00	1.57%

### 易方达生物分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	章百杰	528,838.00	3.19%
2	王利	526,635.00	3.18%
3	陈雪娥	410,000.00	2.48%
4	马丽萍	312,772.00	1.89%
5	上海明沅投资管理有限公司—明沅稳健 增长 1 期私募证券投资基金	296,430.00	1.79%
6	刘万椿	215,586.00	1.30%
7	夏慧明	200,764.00	1.21%
8	杜效军	175,200.00	1.06%
9	黄钿	160,000.00	0.97%
10	华建良	159,695.00	0.96%

注：(1)本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人；

(2)对于易方达生物科技指数分级 A、易方达生物科技指数分级 B 前十名持有人份额比例的分母采用各自级别的份额。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达生物分级	20.79	0.0000%
	易方达生物分级 A	0.00	0.0000%
	易方达生物分级 B	0.00	0.0000%
	合计	20.79	0.0000%

### 8.4 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	份额级别	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	易方达生物分级	0
	易方达生物分级 A	0
	易方达生物分级 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达生物分级	0
	易方达生物分级 A	0
	易方达生物分级 B	0
	合计	0

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	易方达生物分级	易方达生物分级 A	易方达生物分级 B
基金合同生效日（2015 年 6 月 3 日）基金份额总额	682,254,585.58	-	-
本报告期期初基金份额总额	196,642,077.78	17,217,618.00	17,217,618.00
本报告期基金总申购份额	59,222,304.01	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	74,375,598.77	-	-
本报告期基金拆分变动份额	6,513,360.39	-658,810.00	-658,810.00
本报告期末基金份额总额	188,002,143.41	16,558,808.00	16,558,808.00

注：拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额及折算调整份额。

**10 重大事件揭示****10.1 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。

**10.2 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**

本基金管理人于 2016 年 4 月 30 日发布公告，自 2016 年 4 月 30 日起聘任詹余引先生担任公司董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚先生不再担任公司副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

**10.3 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。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	100,071.56	0.13%	93.19	0.16%	-
国信证券	2	220,575.00	0.28%	176.46	0.30%	-
中信证券	3	5,743,565.77	7.27%	4,594.85	7.84%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	6,261,599.47	7.92%	5,009.26	8.55%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	3,115,146.99	3.94%	2,901.17	4.95%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	16,910,741.38	21.39%	8,455.50	14.43%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	2	8,643,705.28	10.93%	6,914.89	11.80%	-
海通证券	2	1,344,173.94	1.70%	1,075.33	1.84%	-
华创证券	1	36,709,790.22	46.44%	29,368.02	50.13%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少国信证券股份有限公司一个交易单元，新增国金证券股份有限公司

司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、天风证券股份有限公司各一个交易单元。

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、个股分析报告及丰富全面的信息；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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-04
2	易方达基金管理有限公司关于在指数熔断情况下调整旗下部分基金场内申赎等业务开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-05
3	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-07
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加平安证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-20
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中证金牛为销售机构、参加中证金牛申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
7	易方达基金管理有限公司关于调整旗下四只指数分级证券投资基金基础份额的场内申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-29

8	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-23
9	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-26
10	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购厦门瑞尔特卫浴科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-02
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加积木基金为销售机构、参加积木基金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-03
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加富济财富为销售机构、参加富济财富申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-08
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宜信普泽为销售机构、参加宜信普泽申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-08
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏赛福天钢索股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-25
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加同花顺费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-25
16	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-29
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加好买基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-07
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宁波银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-08
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-28
20	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
21	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
22	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30

		人网站	
23	易方达基金管理有限公司关于网上直销支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05
24	易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-07
25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加民生银行直销银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-09
26	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购南通四方冷链装备股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-12
27	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-14
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
29	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大智慧为销售机构、参加大智慧申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰金融为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
31	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加川财证券为销售机构、参加川财证券申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-27
32	关于易方达生物科技指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-30
33	易方达基金管理有限公司关于易方达生物科技指数分级证券投资基金定期份额折算业务期间暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-30
34	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购上海沪工焊接集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-01
35	关于易方达生物科技指数分级证券投资基金定期份额折算业务期间易方达生物科技分级 A 类份额停复牌的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-03
36	易方达基金管理有限公司关于易方达生物科技指数分级证券投资基金之 A 类份额约定年基准收益率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-03

37	关于易方达生物科技指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-06
38	关于易方达生物科技指数分级证券投资基金之 A 类份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-06
39	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购深圳市盛讯达科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-21
40	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鑫鼎盛为销售机构、参加鑫鼎盛申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-22
41	易方达基金管理有限公司关于在官方京东店开展基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达生物科技指数分级证券投资基金募集注册的文件；
- 2.《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达生物科技指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十四日