

# 易方达 50 指数证券投资基金

## 2016 年半年度报告摘要

### 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年八月二十四日

## 1 重要提示

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。

基金托管人交通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 2016 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       | 易方达上证 50 指数        |
| 基金主代码      | 110003             |
| 交易代码       | 110003             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2004 年 3 月 22 日    |
| 基金管理人      | 易方达基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 交通银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 8,295,987,425.02 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                     |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越指数的投资收益，追求长期资本增值。                                                                          |
| 投资策略   | 本基金为指数增强型基金，股票投资部分以上证 50 指数作为标的指数，资产配置上追求充分投资，不根据对市场时机的判断主动调整股票仓位，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的偏离风险，追求超越基准的收益水平。 |
| 业绩比较基准 | 上证 50 指数                                                                                                            |
| 风险收益特征 | 本基金为股票基金，其预期风险、收益水平高于混合基金、债券基金及货币市场基金。本基金在控制与目标指数偏离风险的同时，力争获得超越基准的收益。长期来看，本基金具有与目标指数相近的风险水平。                        |

### 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           | 交通银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张南                    | 汤嵩彦                 |
|             | 联系电话 | 020-85102688          | 95559               |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn | tangsy@bankcomm.com |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088          | 95559               |
| 传真          |      | 020-85104666          | 021-62701216        |

### 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 | <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                                  |

### 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       | -47,675,086.69                       |
| 本期利润          | -769,371,716.46                      |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0923                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -8.82%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0386                              |
| 期末基金资产净值      | 7,976,122,295.77                     |
| 期末基金份额净值      | 0.9614                               |

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      | 0.71%    | 0.82%       | -1.53%     | 0.80%         | 2.24%  | 0.02%  |
| 过去三个月      | 1.64%    | 0.80%       | -1.57%     | 0.83%         | 3.21%  | -0.03% |
| 过去六个月      | -8.82%   | 1.54%       | -12.32%    | 1.65%         | 3.50%  | -0.11% |
| 过去一年       | -17.96%  | 1.96%       | -26.04%    | 2.20%         | 8.08%  | -0.24% |
| 过去三年       | 55.74%   | 1.72%       | 36.73%     | 1.90%         | 19.01% | -0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 190.02%  | 1.71%       | 98.06%     | 1.84%         | 91.96% | -0.13% |

##### 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 50 指数证券投资基金

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

（2004 年 3 月 22 日至 2016 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 190.02%，同期业绩比较基准收益率为 98.06%。

## 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（助理）期限 | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-----------------|--------|----|
|----|----|-----------------|--------|----|

|     |                                                                                                                                                                                                 | 任职日期       | 离任日期 |      |                                                                                              |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|------|------|----------------------------------------------------------------------------------------------|
| 张胜记 | 本基金的基金经理、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、指数与量化投资部总经理助理 | 2012-09-28 | -    | 11 年 | 硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司机构理财部研究员、机构理财部投资经理助理、基金经理助理、研究部行业研究员、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理。 |

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 上半年，国内经济增速回升，国内生产总值 GDP 同比增长 6.7%，呈现弱复苏态势。1-6 月份全国固定资产投资同比增长 9.0%，房地产开发同比增长 6.1%，维持高位；规模以上工业增加值同比实际增长 6.0%，社会消费品零售总额同比增长 10.3%，保持稳定。居民消费价格指数（CPI）同比上涨 2.1%，工业生产者出厂价格指数（PPI）同比下降 4.8%，通胀处于较低水平。央行货币投放力度整体宽松，央行再次降低银行存款准备金率 0.5 个百分点、降低房地产首付比例等。广义货币供应量 M2 同比增长 11.8%，居民部分的中长期贷款强劲，反映出地产销售旺盛。报告期内，上证指数下跌 17.22%，创业板、中小板跌幅较大，上证 50 指数下跌 12.32%。从行业表现来看，食品饮料、有色金属、银行、家电等板块跌幅较小；交通运输、轻工、传媒、商业贸易等行业跌幅较大。

本基金是跟踪上证 50 指数的增强型指数基金，股票仓位根据合同要求一直保持在 90%以上，在行业配置上，多数行业与指数权重分布一致，食品饮料、医药、TMT 等行业有一定的超配，银行、建筑建材等行业有所低配。报告期内，根据对市场形势的判断，本基金进行了一些结构调整操作，主要是降低了银行、券商等板块的权重，增加了食品饮料、医药生物等板块的配置。本基金报告期业绩领先基准指数。

##### 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 0.9614 元，本报告期份额净值增长率为-8.82%，同期业绩比较基准收益率为-12.32%，年化跟踪误差 3.30%，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 2016 年下半年，宏观经济复苏缓慢，企业盈利处于低位，上市公司业绩整体难有较好表现。市场估值虽然已大幅回调，但结构性高估严重，小盘股估值仍远高于历史均值；证监会颁布借壳新规、严查并购重组，将对小盘股形成带来压力。另一方面，去杠杆的大背景下，股市流动性供给并不充裕；欧美发达国家金融政策面临变化，美联储加息、英国脱欧等将对发达国家股市、汇市产生冲击。A 股市场在目前水平上震荡企稳的可能性较大。

上证 50 指数的整体估值较低，股息收益率较高，本基金根据基金合同的要求将继续保持 90%以上的股票配置。另一方面，将继续深入研究各成分股的前景，在市场调整阶段，积极增加具有长期竞争力、业绩增长稳定的成分股配置，平衡组合的结构，力争为投资者带来超越基准指数的回报。

#### 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

报告期内，基金托管人在易方达 50 指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，易方达基金管理有限公司在易方达 50 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 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

报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达 50 指数证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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 50 指数证券投资基金



报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日         |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |                                |                                  |
| 银行存款            | 514,264,781.69                 | 184,286,864.82                   |
| 结算备付金           | 1,283,978.24                   | 5,240,648.58                     |
| 存出保证金           | 728,780.74                     | 2,364,589.17                     |
| 交易性金融资产         | 7,532,947,829.87               | 8,599,721,139.03                 |
| 其中：股票投资         | 7,332,935,829.87               | 8,277,603,682.83                 |
| 基金投资            | -                              | -                                |
| 债券投资            | 200,012,000.00                 | 322,117,456.20                   |
| 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         | -                              | 46,420,120.19                    |
| 应收利息            | 4,454,303.33                   | 9,958,717.40                     |
| 应收股利            | -                              | -                                |
| 应收申购款           | 2,323,174.95                   | 3,685,525.00                     |
| 递延所得税资产         | -                              | -                                |
| 其他资产            | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     | <b>8,056,002,848.82</b>        | <b>8,851,677,604.19</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2016 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         | 58,852,996.33                  | 51,424,093.63                    |
| 应付赎回款           | 10,999,469.90                  | 9,834,820.55                     |
| 应付管理人报酬         | 7,768,663.73                   | 8,988,440.99                     |
| 应付托管费           | 1,294,777.30                   | 1,498,073.51                     |
| 应付销售服务费         | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 739,240.08                     | 3,082,723.47                     |
| 应交税费            | -                              | -                                |
| 应付利息            | -                              | -                                |
| 应付利润            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         | -                              | -                                |
| 其他负债            | 225,405.71                     | 431,042.82                       |
| <b>负债合计</b>     | <b>79,880,553.05</b>           | <b>75,259,194.97</b>             |

|                   |                         |                         |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| <b>所有者权益：</b>     |                         |                         |
| 实收基金              | 8,295,987,425.02        | 8,323,453,070.90        |
| 未分配利润             | -319,865,129.25         | 452,965,338.32          |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>7,976,122,295.77</b> | <b>8,776,418,409.22</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>8,056,002,848.82</b> | <b>8,851,677,604.19</b> |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9614 元，基金份额总额 8,295,987,425.02 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达 50 指数证券投资基金

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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                | <b>-711,140,636.79</b>                   | <b>3,203,244,447.49</b>                       |
| 1.利息收入                     | 4,839,761.82                             | 18,863,965.97                                 |
| 其中：存款利息收入                  | 1,053,449.75                             | 1,387,660.13                                  |
| 债券利息收入                     | 3,750,512.88                             | 16,633,026.70                                 |
| 资产支持证券利息收入                 | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入                 | 35,799.19                                | 843,279.14                                    |
| 其他利息收入                     | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 5,296,496.11                             | 5,457,336,462.72                              |
| 其中：股票投资收益                  | -64,542,686.63                           | 5,303,231,546.07                              |
| 基金投资收益                     | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                     | -1,342,204.90                            | 44,479,029.87                                 |
| 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                       | 71,181,387.64                            | 109,625,886.78                                |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | -721,696,629.77                          | -2,287,178,472.85                             |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 419,735.05                               | 14,222,491.65                                 |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>58,231,079.67</b>                     | <b>161,023,206.72</b>                         |
| 1. 管理人报酬                   | 46,144,109.18                            | 106,126,451.28                                |
| 2. 托管费                     | 7,690,684.87                             | 17,687,741.89                                 |
| 3. 销售服务费                   | -                                        | -                                             |
| 4. 交易费用                    | 4,168,071.38                             | 32,056,255.15                                 |
| 5. 利息支出                    | -                                        | 4,891,478.04                                  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                                        | 4,891,478.04                                  |
| 6. 其他费用                    | 228,214.24                               | 261,280.36                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-769,371,716.46</b>                   | <b>3,042,221,240.77</b>                       |

|                          |                        |                         |
|--------------------------|------------------------|-------------------------|
| 减：所得税费用                  | -                      | -                       |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b> | <b>-769,371,716.46</b> | <b>3,042,221,240.77</b> |

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：易方达 50 指数证券投资基金

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<br>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）                        | 8,323,453,070.90                           | 452,965,338.32    | 8,776,418,409.22   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -769,371,716.46   | -769,371,716.46    |
| 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）      | -27,465,645.88                             | -3,458,751.11     | -30,924,396.99     |
| 其中：1.基金申购款                             | 557,627,137.52                             | -44,381,060.86    | 513,246,076.66     |
| 2.基金赎回款                                | -585,092,783.40                            | 40,922,309.75     | -544,170,473.65    |
| 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）                        | 8,295,987,425.02                           | -319,865,129.25   | 7,976,122,295.77   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 19,769,782,162.95                          | 310,809,950.40    | 20,080,592,113.35  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 3,042,221,240.77  | 3,042,221,240.77   |
| 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）      | -9,590,815,797.35                          | -1,602,797,628.15 | -11,193,613,425.50 |
| 其中：1.基金申购款                             | 8,235,946,420.97                           | 1,027,169,084.47  | 9,263,115,505.44   |
| 2.基金赎回款                                | -17,826,762,218.32                         | -2,629,966,712.62 | -20,456,728,930.94 |
| 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） | 10,178,966,365.60 | 1,750,233,563.02 | 11,929,199,928.62 |
|-----------------|-------------------|------------------|-------------------|

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 50 指数证券投资基金（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”）证监基金字[2004]13 号文《关于同意易方达 50 指数证券投资基金设立的批复》的批准，由易方达基金管理有限公司作为基金发起人，向社会公开发行募集并于 2004 年 3 月 22 日正式成立，首次设立募集规模为 5,048,902,330.26 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定，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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

### 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《会计报表附注的编制及披露》、《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。

### 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

#### 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、增值税、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。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税。

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；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 |
| 交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”) | 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      |
| 易方达资产管理有限公司            | 基金管理人的子公司           |
| 易方达海外投资(深圳)有限公司        | 基金管理人子公司控制的公司       |

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。

#### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票成交总额的<br>比例 | 成交金额                            | 占当期股票成交总额的<br>比例 |
| 广发证券  | 1,010,172,220.68           | 33.85%           | 6,549,721,385.54                | 36.23%           |

##### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30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  | 940,774.96                      | 40.56%     | 232,520.35   | 31.45%       |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30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  | 5,962,866.11                    | 38.80%     | 3,302,077.13 | 32.86%       |

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。

#### 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<br>2016年1月1日至2016年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 46,144,109.18                  | 106,126,451.28                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 9,430,135.81                   | 19,641,445.47                       |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

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<br>2016年1月1日至2016年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月<br>30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 7,690,684.87                   | 17,687,741.89                       |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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。

#### 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

份额单位：份

| 关联方名称           | 本期末 2016 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末 2015 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 |
| 易方达资产管理有限公司     | -                   | -                | 579,929.60            | 0.01%            |
| 易方达海外投资(深圳)有限公司 | 187,959.13          | 0.00%            | 187,959.13            | 0.00%            |

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<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2015年1月1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       |
| 交通银行  | 514,264,781.69             | 1,018,285.83 | 782,983,969.83                  | 1,288,600.07 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通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<br>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 | 3,022      | 50,104.76 |
| 广发证券                                  | 300518 | 盛讯达  | 新股网下发行 | 1,306      | 29,019.32 |
| 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 | 新股网下发行 | 1,263      | 12,743.67 |



| 广发证券                                       | 603339 | 四方冷链 | 新股网下<br>发行 | 2,793          | 28,460.67    |
|--------------------------------------------|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 上年度可比期间<br>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：<br>股/张） | 总金额          |
| 广发证券                                       | 002741 | 光华科技 | 新股网下<br>发行 | 44,444         | 547,105.64   |
| 广发证券                                       | 603898 | 好莱客  | 新股网下<br>发行 | 67,555         | 1,322,051.35 |

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.9 期末（2016 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

| <b>6.4.9.1.1 受限证券类别：股票</b> |          |                |                |                      |          |            |              |                  |                  |    |
|----------------------------|----------|----------------|----------------|----------------------|----------|------------|--------------|------------------|------------------|----|
| 证券<br>代码                   | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日      | 可流<br>通日       | 流通<br>受<br>限类<br>型   | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量(单<br>位：股) | 期末<br>成本<br>总额   | 期末<br>估值<br>总额   | 备注 |
| 00279<br>1                 | 坚朗<br>五金 | 2016-0<br>3-22 | 2017-0<br>3-29 | 老股<br>转让<br>流通<br>受限 | 21.57    | 53.77      | 121,28<br>5  | 2,616,<br>117.45 | 6,521,<br>494.45 | -  |
| 00279<br>2                 | 通宇<br>通讯 | 2016-0<br>3-21 | 2017-0<br>3-28 | 老股<br>转让<br>流通<br>受限 | 22.94    | 59.80      | 116,43<br>2  | 1,780,<br>625.74 | 6,962,<br>633.60 | -  |
| 00280<br>5                 | 丰元<br>股份 | 2016-0<br>6-29 | 2016-0<br>7-07 | 新股<br>流通<br>受限       | 5.80     | 5.80       | 971          | 5,631.<br>80     | 5,631.<br>80     | -  |
| 30048<br>8                 | 恒锋<br>工具 | 2015-0<br>6-25 | -              | 老股<br>转让<br>流通<br>受限 | 20.11    | 72.10      | 71,341       | 1,434,<br>667.51 | 5,143,<br>686.10 | -  |
| 30050<br>8                 | 维宏<br>股份 | 2016-0<br>4-12 | 2017-0<br>4-19 | 老股<br>转让<br>流通<br>受限 | 20.08    | 254.50     | 10,383       | 208,49<br>0.64   | 2,642,<br>473.50 | -  |
| 30052<br>0                 | 科大<br>国创 | 2016-0<br>6-30 | 2016-0<br>7-08 | 新股<br>流通             | 10.05    | 10.05      | 926          | 9,306.<br>30     | 9,306.<br>30     | -  |

|        |      |            |            | 受限     |       |       |        |            |            |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|--------|------------|------------|---|
| 601966 | 玲珑轮胎 | 2016-06-24 | 2016-07-06 | 新股流通受限 | 12.98 | 12.98 | 15,341 | 199,126.18 | 199,126.18 | - |
| 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  | - |

注：1.广东坚朗五金制品股份有限公司于 2016 年 6 月 16 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 1.5 元人民币现金（含税）；

2.广东通宇通讯股份有限公司于 2016 年 6 月 7 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 4 元人民币现金（含税），同时按每 10 股转增 5 股进行资本公积金转增股本；

3.恒锋工具股份有限公司于 2016 年 5 月 3 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 2.2 元人民币现金（含税）；截至半年度报告送出日，恒锋工具尚未披露关于部分限售股份上市流通的提示性公告，因此可流通日暂未确定；

4.上海维宏电子科技股份有限公司于 2016 年 6 月 28 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 1.64 元人民币现金（含税）；

5.以上“可流通日”中，部分证券的日期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 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|--------|--------------|--------------|----|
| 300508 | 维宏股份 | 2016-06-30 | 重大事项停牌 | 254.50 | 2016-07-06 | 242.00 | 10,383 | 208,490.64   | 2,642,473.50 | -  |
| 601611 | 中国核建 | 2016-06-30 | 重大事项停牌 | 20.92  | 2016-07-01 | 23.01  | 37,059 | 128,594.73   | 775,274.28   | -  |
| 300488 | 恒锋工具 | 2016-04-01 | 重大事项停牌 | 72.10  | -          | -      | 71,341 | 1,434,667.51 | 5,143,686.10 | -  |

#### 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 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。

##### 6.4.9.3.2 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。

**6.4.10 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 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 7,324,374,395.99 元，属于第二层次的余额为 208,573,433.88 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 8,222,057,138.83 元，第二层次 377,664,000.20 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              | 7,332,935,829.87 | 91.02         |
|    | 其中：股票             | 7,332,935,829.87 | 91.02         |
| 2  | 固定收益投资            | 200,012,000.00   | 2.48          |
|    | 其中：债券             | 200,012,000.00   | 2.48          |
|    | 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      | 515,548,759.93   | 6.40          |
| 7  | 其他各项资产            | 7,506,259.02     | 0.09          |
| 8  | 合计                | 8,056,002,848.82 | 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

##### 7.2.1.1 指数投资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              | 288,814,521.89   | 3.62          |
| C  | 制造业              | 1,231,350,869.75 | 15.44         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 95,550,296.51    | 1.20          |
| E  | 建筑业              | 228,682,783.40   | 2.87          |
| F  | 批发和零售业           | -                | -             |

|   |                 |                  |       |
|---|-----------------|------------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 106,434,341.40   | 1.33  |
| H | 住宿和餐饮业          | -                | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 104,651,136.78   | 1.31  |
| J | 金融业             | 3,832,154,285.77 | 48.05 |
| K | 房地产业            | 167,013,628.40   | 2.09  |
| L | 租赁和商务服务业        | -                | -     |
| 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              | 6,054,651,863.90 | 75.91 |

#### 7.2.1.2 积极投资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<br>（%） |
|----|------------------|----------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -                |
| B  | 采矿业              | 32,699,869.20  | 0.41             |
| C  | 制造业              | 876,825,863.03 | 10.99            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,333,671.75  | 0.15             |
| E  | 建筑业              | 775,274.28     | 0.01             |
| F  | 批发和零售业           | 33,239,578.29  | 0.42             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,470,686.00   | 0.03             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 60,732,552.60  | 0.76             |
| J  | 金融业              | 255,647,819.72 | 3.21             |
| K  | 房地产业             | 636,525.00     | 0.01             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -                |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 20,126.10      | 0.00             |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| 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       | 2,902,000.00     | 0.04  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -                | -     |
| S | 综合            | -                | -     |
|   | 合计            | 1,278,283,965.97 | 16.03 |

### 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

#### 7.3.1 期末指数投资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  | 601318 | 中国平安 | 23,669,196 | 758,361,039.84 | 9.51         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 1,917,186  | 559,664,937.12 | 7.02         |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 26,686,421 | 406,701,056.04 | 5.10         |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 44,490,203 | 397,297,512.79 | 4.98         |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 18,359,929 | 321,298,757.50 | 4.03         |
| 6  | 600887 | 伊利股份 | 16,060,936 | 267,735,803.12 | 3.36         |
| 7  | 600837 | 海通证券 | 15,589,718 | 240,393,451.56 | 3.01         |
| 8  | 601169 | 北京银行 | 20,456,731 | 212,136,300.47 | 2.66         |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 7,322,814  | 198,008,890.56 | 2.48         |
| 10 | 601668 | 中国建筑 | 36,137,610 | 192,252,085.20 | 2.41         |

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](http://www.efunds.com.cn) 网站的半年度报告正文。

#### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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  | 000001 | 平安银行 | 28,462,986 | 247,627,978.20 | 3.10         |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 6,999,613  | 227,697,410.89 | 2.85         |
| 3  | 000661 | 长春高新 | 1,866,894  | 199,160,251.92 | 2.50         |
| 4  | 002179 | 中航光电 | 2,800,667  | 121,324,894.44 | 1.52         |
| 5  | 002241 | 歌尔股份 | 3,110,424  | 89,206,960.32  | 1.12         |

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](http://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  | 000858 | 五 粮 液 | 160,977,693.60 | 1.83            |
| 2  | 002117 | 东港股份  | 78,120,247.95  | 0.89            |
| 3  | 600048 | 保利地产  | 68,126,899.46  | 0.78            |
| 4  | 002007 | 华兰生物  | 65,648,622.33  | 0.75            |
| 5  | 600887 | 伊利股份  | 64,203,330.03  | 0.73            |
| 6  | 601377 | 兴业证券  | 63,811,762.08  | 0.73            |
| 7  | 002563 | 森马服饰  | 61,524,803.68  | 0.70            |
| 8  | 000661 | 长春高新  | 54,403,554.14  | 0.62            |
| 9  | 601766 | 中国中车  | 51,488,144.32  | 0.59            |
| 10 | 600809 | 山西汾酒  | 50,110,091.40  | 0.57            |
| 11 | 002230 | 科大讯飞  | 41,952,410.01  | 0.48            |
| 12 | 601788 | 光大证券  | 41,664,001.33  | 0.47            |
| 13 | 601699 | 潞安环能  | 38,802,188.71  | 0.44            |
| 14 | 601088 | 中国神华  | 35,637,758.95  | 0.41            |
| 15 | 600029 | 南方航空  | 35,458,583.02  | 0.40            |
| 16 | 002179 | 中航光电  | 35,251,254.92  | 0.40            |
| 17 | 600739 | 辽宁成大  | 32,942,548.10  | 0.38            |
| 18 | 601989 | 中国重工  | 30,772,160.00  | 0.35            |
| 19 | 601601 | 中国太保  | 25,961,026.12  | 0.30            |
| 20 | 601211 | 国泰君安  | 22,124,814.99  | 0.25            |

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  | 600000 | 浦发银行 | 176,747,681.96 | 2.01            |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 105,969,529.97 | 1.21            |
| 3  | 600015 | 华夏银行 | 104,784,794.12 | 1.19            |
| 4  | 002153 | 石基信息 | 88,398,936.26  | 1.01            |
| 5  | 600809 | 山西汾酒 | 87,338,259.13  | 1.00            |
| 6  | 002117 | 东港股份 | 76,023,748.76  | 0.87            |
| 7  | 300113 | 顺网科技 | 64,481,153.98  | 0.73            |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 63,388,953.07  | 0.72            |
| 9  | 601901 | 方正证券 | 56,246,373.38  | 0.64            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 48,558,484.44 | 0.55 |
| 11 | 600837 | 海通证券 | 46,752,636.50 | 0.53 |
| 12 | 600690 | 青岛海尔 | 46,422,796.94 | 0.53 |
| 13 | 600276 | 恒瑞医药 | 46,119,244.67 | 0.53 |
| 14 | 300109 | 新开源  | 42,614,581.82 | 0.49 |
| 15 | 600150 | 中国船舶 | 42,492,599.80 | 0.48 |
| 16 | 601126 | 四方股份 | 37,175,080.07 | 0.42 |
| 17 | 601288 | 农业银行 | 35,421,240.00 | 0.40 |
| 18 | 601601 | 中国太保 | 29,333,271.25 | 0.33 |
| 19 | 601668 | 中国建筑 | 23,848,148.00 | 0.27 |
| 20 | 000661 | 长春高新 | 21,709,594.16 | 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 | 1,425,784,288.54 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,583,409,056.40 |

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

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      | 80,016,000.00  | 1.00         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 119,996,000.00 | 1.50         |
|    | 其中：政策性金融债 | 119,996,000.00 | 1.50         |
| 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        | 200,012,000.00 | 2.51         |



**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**

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   | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 1.25         |
| 2  | 150020 | 15 附息国债 20 | 800,000   | 80,016,000.00  | 1.00         |
| 3  | 160401 | 16 农发 01   | 200,000   | 19,996,000.00  | 0.25         |

**7.7 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。

**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 2016 年 2 月 19 日，北京银监局对于民生银行当事人业务续做不审慎、未对交易背景进行认真审查、管理缺位导致对应车辆完全脱离监控的行为给予罚款人民币 50 万元的行政处罚。

2015 年 12 月 3 日，深圳银监局对于招商银行 2014 年 5 月 17 日后仍开展商业承兑汇票的买入返售交易；个人不良信贷资产违规批量转让、个人理财业务资金违规投资于不良信贷资产的行为给予罚款人民币 100 万元的行政处罚。

2015 年 9 月 25 日，福建银监局对于兴业银行信贷资产非真实、完全转让处以 50 万元罚款的行政处罚。

根据海通证券股份有限公司 2015 年 9 月 11 日发布的《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，因公司涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，被中国证监会予以警告及行政处罚。

本基金为指数型基金，民生银行、招商银行、兴业银行、海通证券系标的指数成份券，其投资决策程序符合公司投资制度的规定。除民生银行、招商银行、兴业银行、海通证券外，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   | 728,780.74   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 4,454,303.33 |
| 5  | 应收申购款   | 2,323,174.95 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 7,506,259.02 |

### 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

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 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

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>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<br>比例 | 持有份额             | 占总份额<br>比例 |
|---------|-----------|---------------|------------|------------------|------------|
| 522,252 | 15,885.03 | 86,927,639.93 | 1.05%      | 8,209,059,785.09 | 98.95%     |

**8.2 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 | 614,401.78 | 0.0074%  |

**8.3 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

|                                |                  |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2004 年 3 月 22 日）基金份额总额 | 5,048,902,330.26 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 8,323,453,070.90 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 557,627,137.52   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 585,092,783.40   |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 8,295,987,425.02 |

**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      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 财通证券 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 中信证券 | 2      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 国信证券 | 2      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 渤海证券 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 中信建投 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 安信证券 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 申万宏源 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 国都证券 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 光大证券 | 1      | 820,885,276.89   | 27.51%       | 764,493.13 | 32.96%     | -  |
| 银河证券 | 2      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 中银国际 | 1      | 87,319,874.08    | 2.93%        | 81,320.56  | 3.51%      | -  |
| 中泰证券 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 东北证券 | 1      | 1,065,660,627.62 | 35.71%       | 532,830.33 | 22.97%     | -  |
| 海通证券 | 1      | -                | -            | -          | -          | -  |
| 广发证券 | 3      | 1,010,172,220.68 | 33.85%       | 940,774.96 | 40.56%     | -  |

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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。

#### 10.7.2 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 |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 光大证券 | -    | -            | 140,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

易方达基金管理有限公司

二〇一六年八月二十四日