

# 易方达军工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合规守信情况的说明.....	10
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.....	11
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合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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.....	17
7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
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.....	36
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.12 投资组合报告附注 .....	38
8 基金份额持有人信息 .....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
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 .....	41
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 .....	41
9 开放式基金份额变动 .....	41
10 重大事件揭示 .....	42
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	43
10.8 其他重大事件 .....	44
11 备查文件目录 .....	48
11.1 备查文件目录 .....	48
11.2 存放地点 .....	48
11.3 查阅方式 .....	48



## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达军工指数分级证券投资基金		
基金简称	易方达军工分级		
基金主代码	502003		
交易代码	502003		
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 7 月 8 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	274,919,319.56 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 15 日		
下属分级基金的基金简称	易方达军工分级	易方达军工分级 A	易方达军工分级 B
下属分级基金场内简称	军工分级	军工 A	军工 B
下属分级基金的交易代码	502003	502004	502005
报告期末下属分级基金的份额总额	91,650,513.56 份	91,634,403.00 份	91,634,403.00 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进行投资，即完全按照标的指数的成份股组成及权重构建基金投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35% 以内。		
业绩比较基准	95% × 中证军工指数收益率 + 5% × 同期银行活期存款利率（税后）		
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	-186,224,105.05
本期利润	-225,395,054.85

加权平均基金份额本期利润	-0.3920
本期加权平均净值利润率	-42.89%
本期基金份额净值增长率	-17.00%
<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	-147,771,491.24
期末可供分配基金份额利润	-0.5375
期末基金资产净值	311,612,927.25
期末基金份额净值	1.1335
<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	-29.43%

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

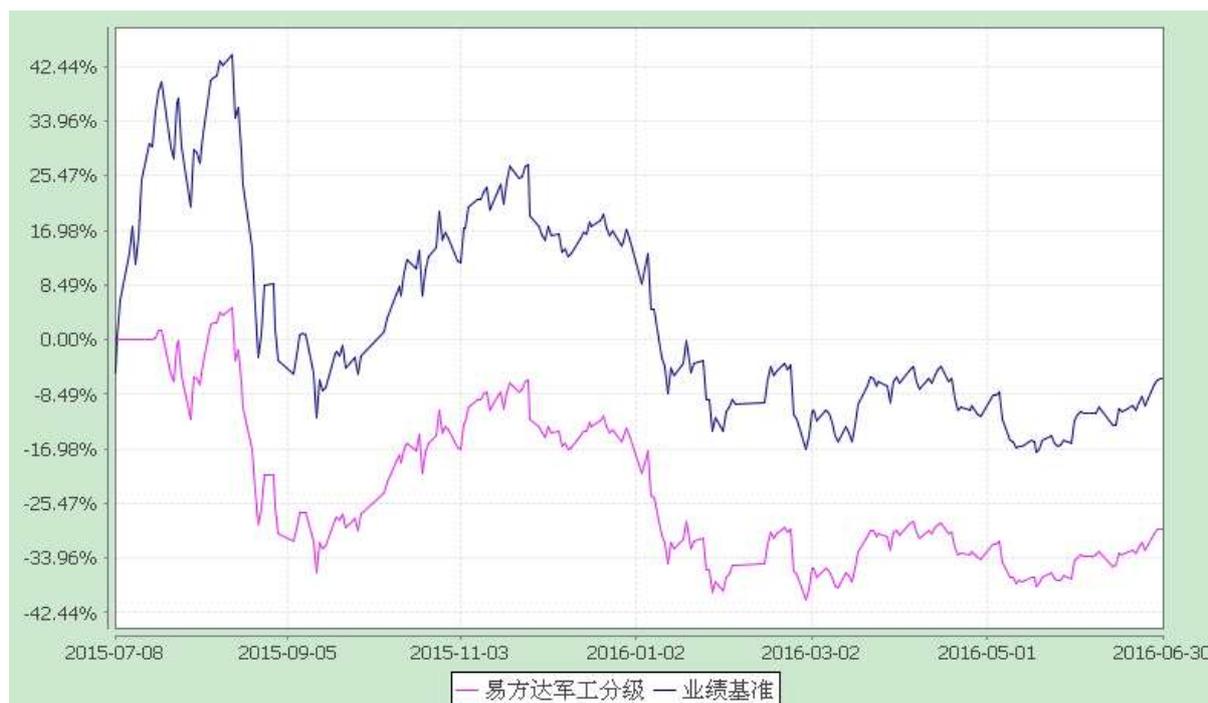
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.70%	1.51%	7.37%	1.42%	0.33%	0.09%
过去三个月	0.25%	1.69%	-0.25%	1.66%	0.50%	0.03%
过去六个月	-17.00%	2.72%	-18.88%	2.46%	1.88%	0.26%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-29.43%	3.00%	-6.14%	3.07%	-23.29%	-0.07%

#### 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

易方达军工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7月8日至2016年6月30日)



注：1.本基金合同于 2015 年 7 月 8 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.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。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-29.43%，同期业绩比较基准收益率为-6.14%。

## 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		
余海燕	本基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理、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的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理	2015-07-08	-	11 年	硕士研究生，曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。
王飞	本基金的基金经理助理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达沪深 300 非银行金融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、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理助理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金的基金经理助理	2015-09-02	2016-05-25	6 年	硕士研究生，曾任银华基金管理有限公司基金经理助理。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，余海燕的“任职日期”为基金合同生效之日，王飞的“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。

#### 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 年上半年国内宏观经济基本面下行压力犹存，1-2 月份工业增速延续了前期的下滑态势，随后在财政和信贷政策的支持、补库存、房地产回暖的推动下，3 月份宏观经济企稳回升，景气度明显改善，3 月制造业 PMI 大幅回升至 50.2，随后货币政策重心转向供给侧改革以及工业去产能、企业去杠杆仍持续的背景下，制造业投资继续疲弱，二季度房地产投资较上季度有所放缓，经济增长动能有所减弱，宏观数据显示 6 月财新中国制造业 PMI 降至 48.6，2 季度 GDP 同比增速为 6.7%，创 2009 年 2 季度以来新低。资本市场方面，2016 年伊始 A 股市场大幅波动。年初人民币兑美元即期汇率贬值以及叠加宽松货币政策会收紧的预期，A 股市场在一月份连续大幅下挫；随后中国创历史记录的信贷数据出炉，市场对政府宽松刺激的预期升温，同时在人民币兑美元即期汇率止跌回升、美联储加息趋缓以及中国经济基本面数据好转带动市场风险偏好修复的背景下，A 股市场主要股指自 2 月份开始迎来了反弹。进入二季度后海外市场风险事件不断，期间美联储加息预期不断反复，

美联储一度尝试以出售资产的方式收缩其资产负债表，临近半年末出现黑天鹅事件——英国公投脱欧，导致全球避险情绪持续攀升，美日欧等发达股市暴跌，英镑和欧元大幅贬值，美元指数急升，黄金、日元等避险资产大涨。相较海外市场的不平静，A 股市场在二季度维持窄幅震荡行情，市场波动较前期大幅减弱，期间虽然遭遇权威人士表态“中国经济走势是长期 L 型”、A 股被纳入 MSCI 指数落空、英国公投脱欧等诸多利空因素，在震荡博弈中 A 股市场表现相对较为平稳。最终上半年上证综指以下跌 17.22% 收官，在风格方面，报告期内沪深 300 指数下跌 15.47%，创业板综指下跌 13.89%；行业方面，仅食品饮料行业录得正收益，有色金属、银行、电子、家用电器等板块跌幅相对较小，传媒、交通运输、商业贸易、休闲服务等板块跌幅较大。报告期内中证军工指数下跌 19.95%。

报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

#### 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 1.1335 元，本报告期份额净值增长率为-17.00%，同期业绩比较基准收益率为-18.88%，日跟踪偏离度的均值为 0.20%，年化跟踪误差为 5.352%，与业绩比较基准产生偏离主要是由报告期内停牌股票估值调整及基金申购赎回冲击等因素所致。

#### 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，宏观经济增速依然面临下行风险。随着当前政策重心逐步回归“供给侧改革”，前期稳增长措施效果将逐步淡化，房地产增速预计将缓慢回落，下半年经济增长可能会重回增速缓降的局面。A 股市场未来中短期表现及风险方面我们需要关注：经济继续下行带来的信用风险；各种改革措施能否加大力度推进；英国脱欧事件开启的逆全球化浪潮带来的外围不确定性增加；中国货币政策基调和汇率政策目标将由于海外市场动荡加剧而受到更大的挑战。从中长期看改革与创新仍然值得期待，在就业与坏账压力之下，财政政策有望加码，而改革进程，包括国企、财税、服务业、人口政策及户籍土地等方面有望继续推进；通过供给侧改革、提高全要素生产率，将是中国经济长期可持续增长的关键手段，我们对中国经济告别粗放式增长模式、走向长期可持续发展充满信心。A 股市场仍是实现经济转型的国家战略的核心高地，因此在战略上对于当前 A 股市场不必太悲观。通过资本市场盘活存量、促进创新创业，把社会资金、资源更有效率地配置，促进产业并购、重组，改善上市公司业绩，A 股市场和产业发展的正反馈仍将重现。

军工改革作为十八届三中全会深化改革的重要任务，其深度受益于全面改革的红利，包括国企改革、一带一路走出去战略、《中国制造 2025》，以及行业自身改革——包括军民融合、军工资产

证券化、军工科研院所改制。围绕主战装备提速、资本运作和军民融合三条主线，军工行业未来上升空间充足，具有较大的长期投资价值。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数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，为投资者提供质地优良的指数投资工具，既为短期投资者提供“高弹性、高波动”的投资工具，又为长期看好军工行业投资前景的投资者提供方便、高效的工具。

#### 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《易方达军工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(包括军工分级基础份额、军工 A 类份额、军工 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：易方达军工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	22,723,880.78	86,855,659.19
结算备付金		193,426.94	3,133,350.23
存出保证金		371,610.69	818,435.79
交易性金融资产	6.4.7.2	295,585,828.43	819,415,570.29
其中：股票投资		295,585,828.43	819,415,570.29
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		413,598.75	-
应收利息	6.4.7.5	3,769.57	22,421.64
应收股利		-	-
应收申购款		678,005.10	260,640.27
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		319,970,120.26	910,506,077.41
<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		7,588,710.12	8,410,920.50
应付管理人报酬		270,525.79	875,395.88
应付托管费		59,515.68	192,587.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	150,991.69	2,066,702.52
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	287,449.73	261,699.13
<b>负债合计</b>		<b>8,357,193.01</b>	<b>11,807,305.09</b>
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	441,558,925.50	1,056,933,100.54
未分配利润	6.4.7.10	-129,945,998.25	-158,234,328.22
<b>所有者权益合计</b>		<b>311,612,927.25</b>	<b>898,698,772.32</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>319,970,120.26</b>	<b>910,506,077.41</b>

注:1.本基金合同生效日为 2015 年 7 月 8 日,2015 年度实际报告期间为 2015 年 7 月 8 日至 2015 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2016 年 6 月 30 日,易方达军工分级份额净值 1.1335 元,易方达军工分级 A 份额参考净值 1.0210 元,易方达军工分级 B 份额参考净值 1.2460 元;基金份额总额 274,919,319.56 份,下属分级基金的份额总额分别为:易方达军工分级基金份额总额 91,650,513.56 份,易方达军工分级 A 基金份额总额 91,634,403.00 份,易方达军工分级 B 基金份额总额 91,634,403.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体:易方达军工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
<b>一、收入</b>		<b>-219,916,013.96</b>
1.利息收入		231,826.08

其中：存款利息收入	6.4.7.11	231,826.08
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-182,399,105.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-183,155,168.59
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	756,062.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-39,170,949.80
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	1,422,215.68
<b>减：二、费用</b>		<b>5,479,040.89</b>
1. 管理人报酬		2,614,506.26
2. 托管费		575,191.40
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,961,453.94
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	327,889.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-225,395,054.85</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-225,395,054.85</b>

注：本基金合同生效日为 2015 年 7 月 8 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达军工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）	1,056,933,100.54	-158,234,328.22	898,698,772.32

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-225,395,054.85	-225,395,054.85
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）	-615,374,175.04	253,683,384.82	-361,690,790.22
其中：1.基金申购款	1,133,491,139.52	-357,440,707.00	776,050,432.52
2.基金赎回款	-1,748,865,314.56	611,124,091.82	-1,137,741,222.74
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）	441,558,925.50	-129,945,998.25	311,612,927.25

注：本基金合同生效日为 2015 年 7 月 8 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

易方达军工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] 672 号《关于准予易方达军工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《易方达军工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，《易方达军工指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 213,341,670.94 份基金份额，其中认购资金利息折合 86,164.67 份基金份额。根据《易方达军工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

资基金会会计核算业务指引》、《易方达军工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	22,723,880.78
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	22,723,880.78

**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	321,372,922.88	295,585,828.43	-25,787,094.45
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	321,372,922.88	295,585,828.43	-25,787,094.45

**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	3,540.79
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	78.30
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	150.48
合计	3,769.57

**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	150,991.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	150,991.69

**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	28,599.27
预提费用	208,850.46
其他应付款	50,000.00
合计	287,449.73

**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	1,056,933,100.54	1,056,933,100.54
本期申购	902,290,908.98	902,290,908.98
本期赎回（以“-”号填列）	-53,803,800.51	-53,803,800.51
2016 年 1 月 29 日基金拆分/份额折算前	1,905,420,209.01	1,905,420,209.01
基金拆分/份额折算调整	-719,088,436.63	—

本期申购	143,947,144.24	231,200,230.54
本期赎回（以“-”号填列）	-1,055,359,597.06	-1,695,061,514.05
本期末	274,919,319.56	441,558,925.50

注：1.根据本基金的基金合同、招募说明书及上海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 1 月 29 日为份额折算基准日，对易方达军工分级份额、易方达军工分级 A 份额和易方达军工分级 B 份额实施不定期份额折算。

2.根据本基金基金合同规定，投资者可申购、赎回易方达军工分级份额，易方达军工分级 A 份额和易方达军工分级 B 份额不能单独申购赎回，只可在上海证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露易方达军工分级 A 份额和易方达军工分级 B 份额的情况。报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 274,919,319.56 份，其中易方达军工分级份额 91,650,513.56 份，易方达军工分级 A 份额 91,634,403.00 份，易方达军工分级 B 份额 91,634,403.00 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	-151,400,731.04	-6,833,597.18	-158,234,328.22
本期利润	-186,224,105.05	-39,170,949.80	-225,395,054.85
本期基金份额交易产生的变动数	189,853,344.85	63,830,039.97	253,683,384.82
其中：基金申购款	-195,253,394.89	-162,187,312.11	-357,440,707.00
基金赎回款	385,106,739.74	226,017,352.08	611,124,091.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-147,771,491.24	17,825,492.99	-129,945,998.25

#### 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	217,018.38
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	8,769.38
其他	6,038.32
合计	231,826.08

#### 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	810,251,592.55
减：卖出股票成本总额	993,406,761.14
买卖股票差价收入	-183,155,168.59

#### 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	756,062.67
基金投资产生的股利收益	-
合计	756,062.67

**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	-39,170,949.80
——股票投资	-39,170,949.80
——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	-39,170,949.80

**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	1,422,215.68
基金合同生效前利息收入	-
其他	-
合计	1,422,215.68

**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	1,961,453.94
银行间市场交易费用	-
合计	1,961,453.94

**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	10,038.83
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	327,889.29

#### 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

根据本基金的基金合同的规定，本基金以 2016 年 7 月 7 日为份额折算基准日，对军工分级基础份额和军工 A 类份额实施定期份额折算。

除上述事项外，截至本会计报表批准报出日，本基金无其它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
当期发生的基金应支付的管理费	2,614,506.26
其中：支付销售机构的客户维护费	180,960.74

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
当期发生的基金应支付的托管费	575,191.40

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**

本基金本报告期末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**

易方达军工分级

无。

易方达军工分级 A

无。

易方达军工分级 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	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	22,723,880.78	217,018.38

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	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 发行	2,793	28,460.67

#### 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《易方达军工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(包括军工分级基础份额、军工 A 类份额、军工 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	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

				受限						
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	2,794	36,266.12	36,266.12	-
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
000547	航天发展	2016-04-19	重大事项停牌	15.36	-	-	402,587	7,004,423.75	6,183,736.32	-
002046	轴研科技	2016-05-09	重大事项停牌	10.33	2016-08-22	11.36	114,690	1,157,135.23	1,184,747.70	-
002297	博云新材	2016-06-20	重大事项停牌	13.09	-	-	160,111	1,953,451.15	2,095,852.99	-
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项停牌	12.44	-	-	773,978	11,662,577.58	9,628,286.32	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	20.92	2016-07-01	23.01	10,084	34,991.48	210,957.28	-

#### 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	22,723,880.78	-	-	-	22,723,880.78
结算备付金	193,426.94	-	-	-	193,426.94
存出保证金	371,610.69	-	-	-	371,610.69
交易性金融资产	-	-	-	295,585,828.43	295,585,828.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	413,598.75	413,598.75
应收利息	-	-	-	3,769.57	3,769.57
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	2,049.65	-	-	675,955.45	678,005.10
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	23,290,968.06	-	-	296,679,152.20	319,970,120.26
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	-	-	-	7,588,710.12	7,588,710.12
应付管理人报酬	-	-	-	270,525.79	270,525.79
应付托管费	-	-	-	59,515.68	59,515.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	150,991.69	150,991.69
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	287,449.73	287,449.73
负债总计	-	-	-	8,357,193.01	8,357,193.01
利率敏感度缺口	23,290,968.06	-	-	288,321,959.19	311,612,927.25
<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	86,855,659.19	-	-	-	86,855,659.19
结算备付金	3,133,350.23	-	-	-	3,133,350.23
存出保证金	818,435.79	-	-	-	818,435.79
交易性金融资产	-	-	-	819,415,570.29	819,415,570.29
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	-	-	-	22,421.64	22,421.64
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	10,299.70	-	-	250,340.57	260,640.27
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	90,817,744.91	-	-	819,688,332.50	910,506,077.4 1
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	-	-	-	8,410,920.50	8,410,920.50
应付管理人报酬	-	-	-	875,395.88	875,395.88
应付托管费	-	-	-	192,587.06	192,587.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,066,702.52	2,066,702.52
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	261,699.13	261,699.13
负债总计	-	-	-	11,807,305.09	11,807,305.09
利率敏感度缺口	90,817,744.91	-	-	807,881,027.41	898,698,772.3 2

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	295,585,828.43	94.86	819,415,570.29	91.18
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	295,585,828.43	94.86	819,415,570.29	91.18

#### 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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	15,519,052.06	45,171,242.77
	2.业绩比较基准下降 5%	-15,519,052.06	-45,171,242.77

#### 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 276,282,247.82 元，属于第二层次的余额为 19,303,580.61 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 713,441,851.26 元，第二层次 105,973,719.03 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	295,585,828.43	92.38
	其中：股票	295,585,828.43	92.38
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	22,917,307.72	7.16
7	其他各项资产	1,466,984.11	0.46
8	合计	319,970,120.26	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	270,719,227.59	86.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	210,957.28	0.07
F	批发和零售业	3,007,829.70	0.97
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	19,357,060.66	6.21
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	2,290,753.20	0.74
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	295,585,828.43	94.86

## 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	601989	中国重工	4,097,728	25,938,618.24	8.32
2	600893	中航动力	347,913	12,055,185.45	3.87
3	600271	航天信息	494,577	11,770,932.60	3.78
4	000768	中航飞机	494,297	9,732,707.93	3.12
5	002465	海格通信	773,978	9,628,286.32	3.09
6	600118	中国卫星	263,893	8,866,804.80	2.85
7	002049	紫光国芯	162,507	7,142,182.65	2.29
8	600150	中国船舶	307,551	6,846,085.26	2.20
9	000547	航天发展	402,587	6,183,736.32	1.98
10	300159	新研股份	332,600	6,003,430.00	1.93
11	002179	中航光电	134,462	5,824,893.84	1.87
12	600879	航天电子	371,186	5,783,077.88	1.86
13	000748	长城信息	290,946	5,708,360.52	1.83
14	600482	中国动力	172,299	5,646,238.23	1.81
15	000738	中航动控	204,536	5,399,750.40	1.73
16	300101	振芯科技	173,714	4,851,832.02	1.56
17	300324	旋极信息	223,160	4,789,013.60	1.54
18	002224	三力士	205,135	4,748,875.25	1.52
19	600372	中航电子	235,553	4,586,216.91	1.47
20	002544	杰赛科技	138,121	4,429,540.47	1.42
21	600435	北方导航	332,368	4,423,818.08	1.42
22	600151	航天机电	390,599	4,413,768.70	1.42
23	600038	中直股份	105,242	4,365,438.16	1.40
24	002268	卫士通	115,830	4,139,764.20	1.33
25	002023	海特高新	236,448	4,097,643.84	1.31
26	600343	航天动力	170,912	4,064,287.36	1.30
27	000901	航天科技	101,111	4,059,606.65	1.30
28	600391	成发科技	103,144	3,965,886.80	1.27
29	002013	中航机电	286,340	3,859,863.20	1.24
30	600316	洪都航空	192,044	3,746,778.44	1.20
31	600990	四创电子	42,710	3,702,529.90	1.19
32	600562	国睿科技	103,262	3,540,853.98	1.14
33	300065	海兰信	86,254	3,336,304.72	1.07

34	000733	振华科技	146,639	3,299,377.50	1.06
35	002368	太极股份	92,748	3,295,336.44	1.06
36	300053	欧比特	180,556	3,277,091.40	1.05
37	600855	航天长峰	103,609	3,242,961.70	1.04
38	600967	北方创业	293,806	3,123,157.78	1.00
39	600765	中航重机	208,350	3,037,743.00	0.97
40	300252	金信诺	91,171	3,020,495.23	0.97
41	600677	航天通信	163,026	3,007,829.70	0.97
42	000519	江南红箭	230,582	2,930,697.22	0.94
43	002414	高德红外	107,120	2,889,026.40	0.93
44	002025	航天电器	114,887	2,836,560.03	0.91
45	603678	火炬电子	37,135	2,830,429.70	0.91
46	000801	四川九洲	228,257	2,812,126.24	0.90
47	600685	中船防务	109,991	2,789,371.76	0.90
48	002151	北斗星通	78,656	2,647,560.96	0.85
49	002253	川大智胜	70,493	2,632,913.55	0.84
50	300034	钢研高纳	112,044	2,476,172.40	0.79
51	002260	德奥通航	94,694	2,457,309.30	0.79
52	002413	雷科防务	175,667	2,411,907.91	0.77
53	300045	华力创通	123,885	2,372,397.75	0.76
54	300008	天海防务	68,187	2,270,627.10	0.73
55	002297	博云新材	160,111	2,095,852.99	0.67
56	600456	宝钛股份	96,021	1,931,942.52	0.62
57	300177	中海达	117,009	1,773,856.44	0.57
58	002214	大立科技	143,303	1,766,925.99	0.57
59	600501	航天晨光	94,017	1,729,912.80	0.56
60	002519	银河电子	77,000	1,726,340.00	0.55
61	600480	凌云股份	120,761	1,702,730.10	0.55
62	002111	威海广泰	64,467	1,694,837.43	0.54
63	002338	奥普光电	26,780	1,645,631.00	0.53
64	600815	厦工股份	256,813	1,635,898.81	0.52
65	300114	中航电测	52,735	1,571,503.00	0.50
66	600184	光电股份	68,123	1,542,304.72	0.49
67	000561	烽火电子	132,973	1,478,659.76	0.47
68	600523	贵航股份	64,449	1,197,462.42	0.38
69	002046	轴研科技	114,690	1,184,747.70	0.38
70	300123	太阳鸟	76,368	1,072,206.72	0.34
71	300447	全信股份	21,692	968,981.64	0.31
72	300354	东华测试	30,880	829,128.00	0.27
73	601611	中国核建	10,084	210,957.28	0.07
74	601127	小康股份	5,036	120,209.32	0.04
75	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.02
76	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.02
77	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.02

78	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
79	601966	玲珑轮胎	2,794	36,266.12	0.01
80	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
81	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
82	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
83	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
84	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
85	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	601989	中国重工	53,605,276.44	5.96
2	600893	中航动力	26,078,435.18	2.90
3	002368	太极股份	20,641,348.94	2.30
4	000768	中航飞机	18,635,214.30	2.07
5	600118	中国卫星	17,265,803.56	1.92
6	600150	中国船舶	16,444,711.16	1.83
7	000748	长城信息	13,364,197.04	1.49
8	600839	四川长虹	13,191,285.92	1.47
9	000738	中航动控	11,150,471.67	1.24
10	600482	中国动力	10,816,274.72	1.20
11	600879	航天电子	10,171,419.18	1.13
12	600372	中航电子	8,960,359.50	1.00
13	600038	中直股份	8,691,256.13	0.97
14	002179	中航光电	8,496,789.96	0.95
15	002268	卫士通	8,387,722.46	0.93
16	600391	成发科技	8,318,257.70	0.93
17	600151	航天机电	8,304,863.58	0.92
18	002013	中航机电	7,759,266.30	0.86
19	300101	振芯科技	7,607,050.38	0.85
20	600967	北方创业	7,352,730.36	0.82

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	601989	中国重工	73,035,791.10	8.13
2	600893	中航动力	43,872,298.19	4.88
3	000768	中航飞机	30,189,825.01	3.36
4	600839	四川长虹	29,332,434.74	3.26
5	600118	中国卫星	29,151,026.29	3.24
6	600150	中国船舶	24,226,485.74	2.70
7	000738	中航动控	21,782,430.37	2.42
8	002465	海格通信	18,794,221.66	2.09
9	600482	中国动力	17,998,538.79	2.00
10	600879	航天电子	16,879,876.25	1.88
11	002179	中航光电	15,721,476.24	1.75
12	600372	中航电子	15,468,360.02	1.72
13	600391	成发科技	15,048,246.99	1.67
14	600038	中直股份	14,990,297.04	1.67
15	002268	卫士通	13,807,265.98	1.54
16	002013	中航机电	13,681,060.52	1.52
17	000547	航天发展	13,415,272.12	1.49
18	600435	北方导航	12,967,734.08	1.44
19	600151	航天机电	12,953,570.61	1.44
20	002368	太极股份	12,948,456.20	1.44

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	508,747,969.08
卖出股票收入（成交）总额	810,251,592.55

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	371,610.69
2	应收证券清算款	413,598.75
3	应收股利	-
4	应收利息	3,769.57
5	应收申购款	678,005.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,466,984.11

**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	002465	海格通信	9,628,286.32	3.09	重大事项停 牌
2	000547	航天发展	6,183,736.32	1.98	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
易方达军工分 级	10,269	8,924.97	4,946,323.00	5.40%	86,704,190.56	94.60%
易方达军工分 级 A	677	135,353.62	82,375,667.00	89.90%	9,258,736.00	10.10%
易方达军工分 级 B	12,885	7,111.71	1,947,809.00	2.13%	89,686,594.00	97.87%
合计	23,831	11,536.21	89,269,799.00	32.47%	185,649,520.56	67.53%

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

易方达军工分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	3,113,045.00	14.16%
2	吴琪	1,000,000.00	4.55%
3	恒安标准人寿保险有限公司一投连险 05	953,513.00	4.34%
4	郑岚	871,000.00	3.96%
5	中信证券股份有限公司	810,946.00	3.69%
6	林兰惠	668,266.00	3.04%
7	王思明	622,609.00	2.83%
8	刘正华	520,911.00	2.37%
9	卢大鹏	498,087.00	2.26%
10	柳岚	474,418.00	2.16%

## 易方达军工分级A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险（集团）公司	7,382,624.00	8.06%
2	中国太平洋人寿保险股份有限公司一传统一普通保险产品	6,899,868.00	7.53%
3	银华财富资本一工商银行一银华财富资本管理（北京）有限公司	6,221,478.00	6.79%
4	北京千石创富一招商银行一干石资本一华宝证券明沅套利 1 号资产管理计划	6,082,359.00	6.64%
5	中国太平洋财产保险股份有限公司一传统一普通保险产品一013C	5,650,423.00	6.17%
6	银华财富资本一工商银行一银华财富资本管理（北京）有限公司	5,641,637.00	6.16%
7	工银瑞信基金一农业银行一中油财务有限责任公司	5,326,590.00	5.81%
8	上海明沅投资管理有限公司一明沅 CTA 二号基金	5,200,713.00	5.68%
9	上海明沅投资管理有限公司一明沅 CTA 一号基金	4,451,604.00	4.86%
10	中金公司一建设银行一中金对冲绝对收益 1 号集合资产管理计划	4,350,912.00	4.75%

## 易方达军工分级B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李满红	1,596,600.00	1.74%

2	平安信托有限责任公司—金蕴 70 期（鼎萨）集合资金信托	1,381,511.00	1.51%
3	曹阳旭	1,093,366.00	1.19%
4	刘红娜	1,000,000.00	1.09%
5	陆德昌	930,237.00	1.02%
6	钱慧芬	893,840.00	0.98%
7	常风钢	807,638.00	0.88%
8	陈波	800,000.00	0.87%
9	余晓梅	546,728.00	0.60%
10	朱娟薇	504,900.00	0.55%

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)对于易方达军工指数分级基础份额、易方达军工指数分级 A、易方达军工指数分级 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	易方达军工分级	148.99	0.0002%
	易方达军工分级 A	0.00	0.0000%
	易方达军工分级 B	0.00	0.0000%
	合计	148.99	0.0001%

### 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	易方达军工分级	0
	易方达军工分级 A	0
	易方达军工分级 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达军工分级	0
	易方达军工分级 A	0
	易方达军工分级 B	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达军工分级	易方达军工分级 A	易方达军工分级 B
基金合同生效日（2015 年 7 月 8 日）基金份额总额	213,341,670.94	-	-

本报告期期初基金份额总额	165,131,636.54	445,900,732.00	445,900,732.00
本报告期基金总申购份额	1,046,238,053.22	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	1,109,163,397.57	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-10,555,778.63	-354,266,329.00	-354,266,329.00
本报告期末基金份额总额	91,650,513.56	91,634,403.00	91,634,403.00

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	48,281,392.17	3.66%	44,964.37	4.35%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	52,454,921.35	3.98%	48,851.52	4.72%	-
国信证券	2	319,493,189.61	24.24%	255,594.58	24.71%	-
中信证券	3	59,070,291.63	4.48%	47,256.23	4.57%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	200,259,458.07	15.20%	168,747.89	16.32%	-
东方证券	1	29,224,612.72	2.22%	23,379.65	2.26%	-
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	138,968,050.78	10.55%	69,485.94	6.72%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	116,634,477.31	8.85%	93,307.59	9.02%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	2	230,588,215.35	17.50%	184,470.34	17.84%	-
海通证券	2	13,287,797.03	1.01%	10,630.25	1.03%	-
华创证券	1	109,511,820.02	8.31%	87,609.77	8.47%	-
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、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、个股分析的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	2016-01-05
4	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
5	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	2016-01-08
6	易方达军工指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-12
7	易方达军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-12
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	2016-01-12
9	易方达军工指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-13

10	易方达军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-13
11	易方达军工指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-14
12	易方达军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-14
13	易方达军工指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-15
14	易方达军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-15
15	易方达军工指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-16
16	易方达军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-16
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
18	易方达军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-21
19	易方达军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-22
20	易方达军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-27
21	易方达军工指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-27
22	易方达军工指数分级证券投资基金 B 类份额交易价格波动提示公告	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
23	易方达军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	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
24	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理	2016-01-28

	牛申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	人网站	
25	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
26	关于办理不定期份额折算期间易方达军工分级 B 类份额停复牌公告	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
27	易方达基金管理有限公司关于易方达军工指数分级证券投资基金不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	2016-01-29
28	易方达军工指数分级证券投资基金 B 类份额不定期份额折算的风险提示公告	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
29	易方达基金管理有限公司关于易方达军工指数分级证券投资基金办理不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	2016-01-29
30	关于易方达军工指数分级证券投资基金不定期份额折算业务期间停复牌的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-01
31	关于易方达军工指数分级证券投资基金不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	2016-02-02
32	易方达基金管理有限公司关于易方达军工指数分级证券投资基金之易方达军工分级份额、易方达军工分级 A 类份额、易方达军工分级 B 类份额不定期份额折算后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	2016-02-02
33	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
34	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
35	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
36	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
37	易方达基金管理有限公司关于在大同证券推出旗下部分开放式基金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	2016-03-10
38	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购	中国证券报、上海证券	2016-03-25

	江苏赛福天钢索股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
39	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
40	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
41	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
42	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
43	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
44	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
45	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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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
51	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
52	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

53	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	2016-06-14
54	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
55	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
56	关于易方达军工指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告	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
57	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军工指数分级证券投资基金募集注册的文件；
- 2.《易方达军工指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达军工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