

易方达价值成长混合型证券投资基金

2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年三月三十一日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 | 5 |
| 2.1 | 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 | 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 | 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 | 其他相关资料 | 6 |
| § 3 | 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 | 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 | 过去三年基金的利润分配情况 | 9 |
| § 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 | 10 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 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 | 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 12 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.8 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| § 5 | 托管人报告 | 14 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 15 |
| 5.3 | 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 15 |
| § 6 | 审计报告 | 15 |
| 6.1 | 审计意见 | 15 |
| 6.2 | 形成审计意见的基础 | 15 |
| 6.3 | 管理层和治理层对财务报表的责任 | 15 |
| 6.4 | 注册会计师对财务报表审计的责任 | 16 |
| § 7 | 年度财务报表 | 17 |
| 7.1 | 资产负债表 | 17 |
| 7.2 | 利润表 | 19 |
| 7.3 | 所有者权益（基金净值）变动表 | 20 |
| 7.4 | 报表附注 | 22 |
| § 8 | 投资组合报告 | 46 |
| 8.1 | 期末基金资产组合情况 | 46 |
| 8.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 46 |
| 8.3 | 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 | 47 |
| 8.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动 | 49 |
| 8.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 51 |

| | | |
|------|-----------------------------------------|----|
| 8.6 | 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 | 52 |
| 8.7 | 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 | 52 |
| 8.8 | 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 | 52 |
| 8.9 | 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 | 52 |
| 8.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 52 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 52 |
| 8.12 | 投资组合报告附注 | 52 |
| § 9 | 基金份额持有人信息 | 53 |
| 9.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 53 |
| 9.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 53 |
| 9.3 | 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 | 53 |
| § 10 | 开放式基金份额变动 | 54 |
| § 11 | 重大事件揭示 | 54 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 | 54 |
| 11.2 | 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 | 54 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 54 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 | 54 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 54 |
| 11.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 54 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 55 |
| 11.8 | 其他重大事件 | 57 |
| § 12 | 备查文件目录 | 61 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 61 |
| 12.2 | 存放地点 | 62 |
| 12.3 | 查阅方式 | 62 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 易方达价值成长混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 易方达价值成长混合 |
| 基金主代码 | 110010 |
| 交易代码 | 110010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007 年 4 月 2 日 |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,932,872,580.02 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 通过主动的资产配置以及对成长价值风格突出的股票进行投资，追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金根据宏观及微观经济因素、市场因素和政策因素，进行大类资产的战略配置。在股票投资方面，本基金遵循三个投资步骤。一是进行股票的风格特征的数量化评估，应用“易方达成长与价值股评价模型”，使用历史与预测的数据，从公司的备选库股票中选择成长与价值特性突出的股票。二是进行股票素质的基本面筛选，使用优质成长股与优质价值股的评价标准，在前面用数量化方法选出的风格鲜明的股票中，应用基本面分析方法，选出基本面较好的股票。三是进行成长与价值的风格配置，根据对市场的判断，动态地调整成长股与价值股的投资比重，追求在可控风险前提下的稳健回报。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| | | |
|----|-------|-------|
| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|

| | | | |
|-------------|------------------------------------------|-----------------------|---------------------|
| 名称 | 易方达基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张南 | 郭明 |
| | 联系电话 | 020-85102688 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | 400 881 8088 | 95588 | |
| 传真 | 020-85104666 | 010-66105798 | |
| 注册地址 | 广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-42891（集中办公 区） | 北京市西城区复兴门内大街55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 | 北京市西城区复兴门内大街55号 | |
| 邮政编码 | 510620 | 100140 | |
| 法定代表人 | 刘晓艳 | 陈四清 | |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.efunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|--------|----------------------|-----------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 易方达基金管理有限公司 | 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 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2019 年 | 2018 年 | 2017 年 |
|---------------|--------|--------|--------|
|---------------|--------|--------|--------|

| | | | |
|----------------------|------------------|-------------------|------------------|
| 本期已实现收益 | 816,568,353.67 | -266,196,790.67 | 345,392,254.42 |
| 本期利润 | 1,808,211,867.51 | -1,661,479,028.38 | 1,575,372,412.59 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.5686 | -0.5029 | 0.4447 |
| 本期加权平均净值利润率 | 34.06% | -29.95% | 26.21% |
| 本期基金份额净值增长率 | 42.09% | -27.48% | 29.78% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 期末可供分配利润 | 2,670,869,730.96 | 1,135,930,683.25 | 3,165,076,664.41 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.9107 | 0.3447 | 0.9502 |
| 期末基金资产净值 | 5,603,742,310.98 | 4,431,372,219.06 | 6,496,164,856.14 |
| 期末基金份额净值 | 1.9107 | 1.3447 | 1.9502 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 129.32% | 61.39% | 122.55% |

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 8.18% | 0.92% | 5.47% | 0.52% | 2.71% | 0.40% |
| 过去六个月 | 16.98% | 1.05% | 5.64% | 0.60% | 11.34% | 0.45% |
| 过去一年 | 42.09% | 1.40% | 26.55% | 0.87% | 15.54% | 0.53% |
| 过去三年 | 33.72% | 1.26% | 19.92% | 0.78% | 13.80% | 0.48% |
| 过去五年 | 65.88% | 1.75% | 17.66% | 1.08% | 48.22% | 0.67% |
| 自基金合同生效起至今 | 129.32% | 1.67% | 50.69% | 1.22% | 78.63% | 0.45% |

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

易方达价值成长混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2007年4月2日至2019年12月31日)

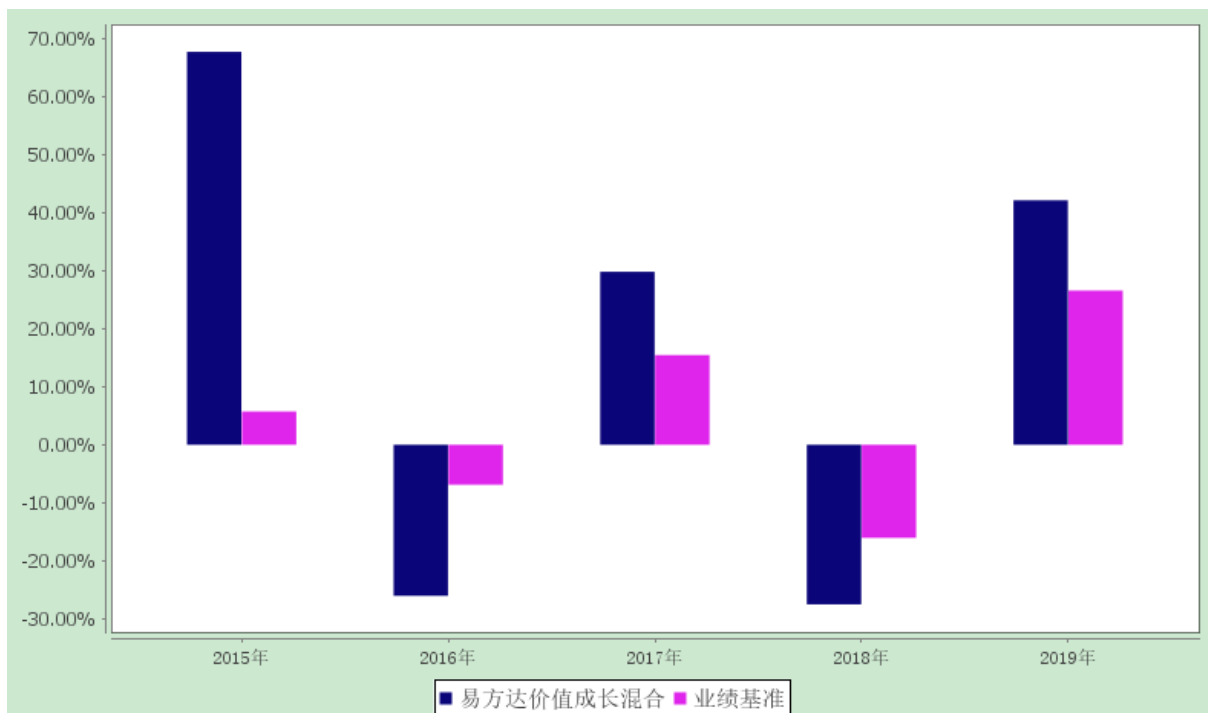


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 129.32%，同期业绩比较基准收益率为 50.69%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达价值成长混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|-------------|----------------|----------------|----------------|----|
| 2019年 | - | - | - | - | - |
| 2018年 | 1.010 | 122,548,853.13 | 210,806,933.86 | 333,355,786.99 | - |
| 2017年 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 1.010 | 122,548,853.13 | 210,806,933.86 | 333,355,786.99 | - |

§ 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（简称“易方达”）成立于2001年4月17日，总部设在广州，在北京、上海、广州、成都、大连等地设有分公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终专注于资产管理业务，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局。

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 | | |
| 武阳 | 本基金的基金经理、易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 | 2018-03-23 | - | 8年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、易方达策略成长二号混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达策略成长证券投资基金的基金经理。 |
| 林高榜 | 本基金的基金经理 | 2018-03-23 | - | 7年 | 博士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司研究部研究员、投资经理、易方达科汇灵活 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------|
| | | | | | 配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------|

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资

策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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 116 次，其中 114 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，2 次为不同基金经理管理的组合间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。

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

2019 年中国经济增速逐步放缓，但结构持续改善。自党的十九大以来，中国宏观经济已经呈现出从高速增长向高质量增长转变的态势，而防范化解重大风险是宏观经济政策的重要导向，这一政策导向也对宏观调控、经济运行的节奏产生较大的影响。从 2019 年全年来看，整体宏观调控政策仍然维持底线思维的框架，在经济出现较大下行压力的情形下（如年初由于外贸形势不确定加大，经济下行压力加大），政策兜底的思维较为明确。但是，随着经济有企稳迹象，总量政策保持定力，并未大水漫灌。在此政策基调下，宏观经济的运行整体保持较为平稳的态势。从结构上看，虽然经济增速有所放缓，但整体就业情况仍然较为良好，经济结构已经在缓慢变迁过程之中。相比于宏观经济的平稳态势，2019 年的物价出现了较大幅度的上涨，但其原因更多是单一品类的特例，整体非食品价格仍然比较平稳，与总需求的回落基本同步。

2019 年 A 股市场表现较好，主要股票指数均出现较大幅度的上涨。其中，上证综指全年上涨 22.30%，沪深 300 全年上涨 36.07%，创业板指数全年上涨 43.79%。行业板块方面，大多数中信一级行业指数均实现较大幅度的上涨，其中食品饮料、电子、家电、建材等板块涨幅较大，且均超过 50%；相比之下，建筑、钢铁、电力及公用事业、商贸零售、石油石化等板块表现较为靠后。

2019 年在资产配置上，本基金保持了之前中性的仓位，基于行业景气程度的判断，增加了电子、

汽车行业的配置，降低了非银行金融、医药行业的配置。

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 1.9107 元，本报告期份额净值增长率为 42.09%，同期业绩比较基准收益率为 26.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来相对中期视角下的中国经济，我们认为中国整体经济增速仍然处于一轮下行周期中，这一周期可能会持续一段时间。这一方面由中国经济内生增长动力在边际上有所弱化决定，另一方面也是与宏观政策基调相匹配。从内生增长动力来看，首先，房地产市场对总量经济的负面影响将较为持久，中期来看，地产销售、投资都有下行压力；其次，全球经济整体表现不佳，加之中国在全球出口贸易中的份额已经非常高，整体外需贡献有限；再次，消费整体疲弱，亮点较为有限。从宏观政策来看，整体上可能仍然延续过去几年相对稳健的基调，即维持底线思维，不搞大水漫灌。在此政策基调下，预计经济增速将延续过去几年相对平稳回落的态势。就 2020 年阶段性的经济特征而言，新型冠状病毒感染肺炎疫情对于宏观经济将会产生一定的扰动，尤其对一、二季度的总需求产生一定的负面影响，在此背景下，预计 2020 年整体财政和货币政策将会相对宽松，以对冲经济的下行压力。

从企业盈利情况来看，全市场 ROE 水平仍然处于历史水平附近。但是从结构来看，创业板的 ROE 仍然处于历史均值以下，且从细分板块景气度来看有望继续改善，值得重点关注。从估值水平来看，直观的 PE、PB 估值均显示当前 A 股估值水平已经处于历史上比较低的位置，仍然具备较好的投资价值。

在下一阶段资产配置上，本基金将继续维持当前股票仓位。行业配置方面，基于行业景气度的分析判断，重点关注景气度处于底部且有明确改善预期的行业，以及景气度已经初步呈现出改善趋势的行业。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续完善制度、强化对制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》以及科创板发行交易、转融通交易等方面的最新法规、监管要求以及公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，加强各项政策法规和制度措施的落实执行，适应公司产品

与业务发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 培育合规文化体系、严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，加大力度开展员工合规风控教育培训，进一步树立、强化“诚信、规范、专业、稳健”的基金行业文化理念和“忠实注意、谨慎勤勉”的信义义务意识，促进公司合规文化建设；持续完善制度流程和系统工具，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为。

(3) 坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

(4) 有计划、有重点地对投研交易、销售、运营、人员规范、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询建议，严格进行合规审查。

(6) 深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《关于进一步规范金融营销宣传行为的通知》等法律法规和监管政策。结合《全国法院民商事审判工作会议纪要》关于金融消费者权益保护的精神，持续优化投资者适当性管理机制流程，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”的职责义务，切实保障投资者合法权益。

(7) 提高认识，主动作为，积极践行“风险为本”的反洗钱工作方法，贯彻落实《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》等最新法规和监管要求，进一步完善洗钱风险管理体系，全面开展洗钱风险评估，深入推进洗钱风险识别与防控能力建设，切实保障资源投入，夯实制度基础，做好队伍建设、系统支持、宣传培训、内部审计、信息报送等各项工作，稳步推动反洗钱工作提质增效。

(8) 全面推动落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其配套规则，持续健全信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(9) 不断完善合规管控框架和机制，促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

截至 2019 年末，公司已通过 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、中国证券投资基金业协会相关指引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，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，具备投资、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债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》，本基金本报告期内应分配利润 267,086,973.10 元；本报告期内未进行利润分配；本报告期末应分配尚未实施的利润为 267,086,973.10 元，本基金已于 2020 年 1 月 21 日进行了利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.50 元，本基金已于 2020 年 3 月 6 日进行了利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.45 元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对易方达价值成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，易方达价值成长混合型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达价值成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达价值成长混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达价值成长混合型证券投资基金 2019 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第 21257 号

易方达价值成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了易方达价值成长混合型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了易方达价值成长混合型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达价值成长混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达价值成长混合型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管

理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估易方达价值成长混合型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算易方达价值成长混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达价值成长混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对易方达价值成长混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致易方达价值成长混合型证券投资基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括

沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

陈熹 周祎

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2020 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 287,805,873.64 | 291,017,213.54 |
| 结算备付金 | | 19,282,115.62 | 2,921,593.38 |
| 存出保证金 | | 1,197,942.97 | 1,351,039.43 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 5,354,521,275.39 | 4,039,876,755.34 |
| 其中：股票投资 | | 5,206,914,404.27 | 3,938,060,202.84 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 147,606,871.12 | 101,816,552.50 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 2,986,371.83 | 104,142,697.92 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 2,685,060.67 | 1,646,649.13 |
| 应收股利 | | - | - |

| | | | |
|-------------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 应收申购款 | | 1,017,384.00 | 4,248,696.81 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 5,669,496,024.12 | 4,445,204,645.55 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 36,710,263.95 | - |
| 应付赎回款 | | 14,754,824.99 | 1,479,827.84 |
| 应付管理人报酬 | | 7,058,747.74 | 5,890,453.54 |
| 应付托管费 | | 1,176,457.97 | 981,742.28 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 3,775,512.09 | 2,977,507.25 |
| 应交税费 | | 690,316.76 | 690,156.16 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 1,587,589.64 | 1,812,739.42 |
| 负债合计 | | 65,753,713.14 | 13,832,426.49 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 2,932,872,580.02 | 3,295,441,535.81 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 2,670,869,730.96 | 1,135,930,683.25 |
| 所有者权益合计 | | 5,603,742,310.98 | 4,431,372,219.06 |
| 负债和所有者权益总计 | | 5,669,496,024.12 | 4,445,204,645.55 |

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9107 元，基金份额总额 2,932,872,580.02

份。

7.2 利润表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | | 1,932,045,379.83 | -1,527,505,220.78 |
| 1.利息收入 | | 7,899,409.78 | 9,223,063.68 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 2,812,367.27 | 3,040,327.31 |
| 债券利息收入 | | 3,813,143.62 | 5,964,574.01 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,273,898.89 | 218,162.36 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 931,743,582.54 | -141,879,166.47 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 862,618,739.19 | -200,275,137.21 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 1,185,200.30 | 860,114.38 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 67,939,643.05 | 57,535,856.36 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 991,643,513.84 | -1,395,282,237.71 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 758,873.67 | 433,119.72 |
| 减：二、费用 | | 123,833,512.32 | 133,973,807.60 |

| | | | |
|----------------------------|----------|-------------------------|--------------------------|
| 1. 管理人报酬 | | 79,479,781.07 | 83,292,731.41 |
| 2. 托管费 | | 13,246,630.20 | 13,882,121.88 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 30,821,731.84 | 36,336,490.99 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 69.35 | 156.73 |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.19 | 285,299.86 | 462,306.59 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,808,211,867.51 | -1,661,479,028.38 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,808,211,867.51 | -1,661,479,028.38 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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） | 3,295,441,535.81 | 1,135,930,683.25 | 4,431,372,219.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,808,211,867.51 | 1,808,211,867.51 |
| 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） | -362,568,955.79 | -273,272,819.80 | -635,841,775.59 |
| 其中：1.基金申购款 | 349,703,789.04 | 239,743,123.76 | 589,446,912.80 |
| 2.基金赎回款 | -712,272,744.83 | -513,015,943.56 | -1,225,288,688.39 |

| | | | |
|----------------------------------------|----------------------------------|-------------------|-------------------|
| 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） | 2,932,872,580.02 | 2,670,869,730.96 | 5,603,742,310.98 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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） | 3,331,088,191.73 | 3,165,076,664.41 | 6,496,164,856.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -1,661,479,028.38 | -1,661,479,028.38 |
| 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） | -35,646,655.92 | -34,311,165.79 | -69,957,821.71 |
| 其中：1.基金申购款 | 429,533,081.66 | 337,142,460.04 | 766,675,541.70 |
| 2.基金赎回款 | -465,179,737.58 | -371,453,625.83 | -836,633,363.41 |
| 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） | - | -333,355,786.99 | -333,355,786.99 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 3,295,441,535.81 | 1,135,930,683.25 | 4,431,372,219.06 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达价值成长混合型证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2007] 69 号文件《关于同意易方达价值成长混合型证券投资基金募集的批复》批准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》向社会公开募集。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2007 年 4 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,874,939,465.41 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确

定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部

分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为十二次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(4)基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(5)每一基金份额享有同等分配权；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票

投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 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[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政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发

教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 287,805,873.64 | 291,017,213.54 |
| 定期存款 | - | - |

| | | |
|----------------|----------------|----------------|
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计 | 287,805,873.64 | 291,017,213.54 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | | |
|---------------|--------------------------|------------------|-----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 4,527,864,331.80 | 5,206,914,404.27 | 679,050,072.47 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 15,951,666.53 | 17,359,871.12 |
| | 银行间市场 | 129,882,760.00 | 130,247,000.00 |
| | 合计 | 145,834,426.53 | 147,606,871.12 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 4,673,698,758.33 | 5,354,521,275.39 | 680,822,517.06 |
| 项目 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 4,249,014,052.12 | 3,938,060,202.84 | -310,953,849.28 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 1,531,000.00 | 1,496,552.50 |
| | 银行间市场 | 100,152,700.00 | 100,320,000.00 |
| | 合计 | 101,683,700.00 | 101,816,552.50 |

| | | | |
|--------|------------------|------------------|-----------------|
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 4,350,697,752.12 | 4,039,876,755.34 | -310,820,996.78 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 59,131.53 | 65,883.02 |
| 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 | 8,677.00 | 1,314.70 |
| 应收债券利息 | 2,616,713.04 | 1,599,391.36 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | -20,547.95 |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 应收出借证券利息 | - | - |
| 其他 | 539.10 | 608.00 |
| 合计 | 2,685,060.67 | 1,646,649.13 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|-------------|------------------|------------------|
| | 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 31 日 |
| 交易所市场应付交易费用 | 3,775,187.07 | 2,977,507.25 |
| 银行间市场应付交易费用 | 325.02 | - |
| 合计 | 3,775,512.09 | 2,977,507.25 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|-------------|------------------|------------------|
| | 2019 年 12 月 31 日 | 2018 年 12 月 31 日 |
| 应付券商交易单元保证金 | 1,250,000.00 | 1,500,000.00 |
| 应付赎回费 | 7,589.64 | 739.42 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 预提费用 | 330,000.00 | 312,000.00 |
| 其他应付款 | - | - |
| 合计 | 1,587,589.64 | 1,812,739.42 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|---------------|----------------------------------|------------------|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,295,441,535.81 | 3,295,441,535.81 |
| 本期申购 | 349,703,789.04 | 349,703,789.04 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -712,272,744.83 | -712,272,744.83 |
| 本期末 | 2,932,872,580.02 | 2,932,872,580.02 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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 | 3,357,740,807.55 | -2,221,810,124.30 | 1,135,930,683.25 |

| | | | |
|----------------|------------------|-------------------|------------------|
| 本期利润 | 816,568,353.67 | 991,643,513.84 | 1,808,211,867.51 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -412,059,103.98 | 138,786,284.18 | -273,272,819.80 |
| 其中：基金申购款 | 367,834,826.80 | -128,091,703.04 | 239,743,123.76 |
| 基金赎回款 | -779,893,930.78 | 266,877,987.22 | -513,015,943.56 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,762,250,057.24 | -1,091,380,326.28 | 2,670,869,730.96 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 2,593,650.31 | 2,854,032.23 |
| 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 | 196,226.02 | 163,499.88 |
| 其他 | 22,490.94 | 22,795.20 |
| 合计 | 2,812,367.27 | 3,040,327.31 |

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 卖出股票成交总额 | 10,586,106,663.36 | 12,275,699,692.64 |
| 减：卖出股票成本总额 | 9,723,487,924.17 | 12,475,974,829.85 |
| 买卖股票差价收入 | 862,618,739.19 | -200,275,137.21 |

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交 | 113,221,464.13 | 285,599,856.00 |

| | | |
|-------------------------|----------------|----------------|
| 总额 | | |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 108,711,604.34 | 275,827,881.39 |
| 减：应收利息总额 | 3,324,659.49 | 8,911,860.23 |
| 买卖债券差价收入 | 1,185,200.30 | 860,114.38 |

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 67,939,643.05 | 57,535,856.36 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 67,939,643.05 | 57,535,856.36 |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 1.交易性金融资产 | 991,643,513.84 | -1,395,282,237.71 |
| ——股票投资 | 990,003,921.75 | -1,396,017,478.10 |
| ——债券投资 | 1,639,592.09 | 735,240.39 |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——基金投资 | - | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2.衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3.其他 | - | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - | - |
| 合计 | 991,643,513.84 | -1,395,282,237.71 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 758,873.67 | 433,119.72 |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 758,873.67 | 433,119.72 |

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 30,820,956.84 | 36,335,490.99 |
| 银行间市场交易费用 | 775.00 | 1,000.00 |
| 合计 | 30,821,731.84 | 36,336,490.99 |

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 审计费用 | 110,000.00 | 112,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 300,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费 | 18,099.86 | 13,106.59 |
| 银行间账户维护费 | 36,000.00 | 36,000.00 |
| 其他 | 1,200.00 | 1,200.00 |
| 合计 | 285,299.86 | 462,306.59 |

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1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。

7.4.8.2资产负债表日后事项

根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2020 年 1 月 21 日登记在册的全体持有

人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.50 元；向截至 2020 年 3 月 6 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.45 元。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------------|---------------------|
| 易方达基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”) | 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 |
| 广东粤财信托有限公司 | 基金管理人股东 |
| 盈峰控股集团有限公司 | 基金管理人股东 |
| 广东省广晟资产经营有限公司 | 基金管理人股东 |
| 广州市广永国有资产经营有限公司 | 基金管理人股东 |
| 珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东 |
| 易方达资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|------------------|----------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的 比例 |
| 广发证券 | 1,235,815,245.90 | 6.01% | 1,579,464,871.87 | 6.54% |

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31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 | 988,646.61 | 5.39% | 308,419.86 | 8.17% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31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 | 1,263,569.80 | 5.77% | - | - |

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12 月31日 | 2018年1月1日至2018年12 月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 79,479,781.07 | 83,292,731.41 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 12,772,307.90 | 13,310,308.81 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12 月31日 | 2018年1月1日至2018年12 月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 13,246,630.20 | 13,882,121.88 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 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 | | 上年度可比期间 | |
|-------------|-----------------------|--------------|-----------------------|--------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | | 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行-活期存款 | 287,805,873.64 | 2,593,650.31 | 291,017,213.54 | 2,854,032.23 |

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。根据相关法规以及本基金收益分配政策,本基金向截至 2020 年 1 月 21 日登记在册的全体持有人进行利润分配,每 10 份基金份额派发红利 0.50 元;向截至 2020 年 3 月 6 日登记在册的全体持有人进行利润分配,每 10 份基金份额派发红利 0.45 元。

7.4.12 期末(2019 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 002973 | 侨银环保 | 2019-12-27 | 2020-01-06 | 新股流通受限 | 5.74 | 5.74 | 1,146 | 6,578.04 | 6,578.04 | - |
| 601658 | 邮储银行 | 2019-12-02 | 2020-06-10 | 新股流通受限 | 5.50 | 5.71 | 796,578 | 4,381,179.00 | 4,548,460.38 | - |
| 688029 | 南微医学 | 2019-07-15 | 2020-01-22 | 新股流通受限 | 52.45 | 157.76 | 10,568 | 554,291.60 | 1,667,207.68 | - |
| 688081 | 兴图新科 | 2019-12-26 | 2020-01-06 | 新股流通受限 | 28.21 | 28.21 | 3,153 | 88,946.13 | 88,946.13 | - |
| 688123 | 聚辰股份 | 2019-12-16 | 2020-06-23 | 新股流通受限 | 33.25 | 58.12 | 6,660 | 221,445.00 | 387,079.20 | - |
| 688181 | 八亿时空 | 2019-12-27 | 2020-01-06 | 新股流通受限 | 43.98 | 43.98 | 4,306 | 189,377.88 | 189,377.88 | - |
| 7.4.12.1.2 受限证券类别:债券 | | | | | | | | | | |
| 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:张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|--------|--------|--------|--------|--------------|--------------|---|
| 113029 | 明阳转债 | 2019-12-18 | 2020-01-07 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 1,890 | 188,996.69 | 188,996.69 | - |
| 123036 | 先导转债 | 2019-12-11 | 2020-01-10 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 64,271 | 6,427,100.00 | 6,427,100.00 | - |
| 128084 | 木森转债 | 2019-12-18 | 2020-01-10 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 2,360 | 235,995.86 | 235,995.86 | - |
| 128085 | 鸿达转债 | 2019-12-18 | 2020-01-08 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 3,040 | 303,994.67 | 303,994.67 | - |

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、监察与合规管理总部、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。

本基金是混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.2 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，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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 2019 年 12 月 31 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 0.31%(2018 年 12 月 31 日：0.03%)。

7.4.13.2.1 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 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 132,850,622.95 | 101,911,780.82 |
| 合计 | 132,850,622.95 | 101,911,780.82 |

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。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2019年12月31日 | 上年度末 2018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 |

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2019年12月31日 | 上年度末 2018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 |

7.4.13.2.4 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 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 7,874,521.16 | 1,504,163.04 |
| AAA 以下 | 9,498,440.05 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 17,372,961.21 | 1,504,163.04 |

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2019年12月31日 | 上年度末 2018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 |

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2019年12月31日 | 上年度末 2018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 |

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2019 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所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。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2019年12月31 日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|----------------|--------------|--------------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 287,805,873.64 | - | - | - | 287,805,873.64 |
| 结算备付金 | 19,282,115.62 | - | - | - | 19,282,115.62 |
| 存出保证金 | 1,197,942.97 | - | - | - | 1,197,942.97 |
| 交易性金融资产 | 130,247,000.00 | 7,863,041.50 | 9,496,829.62 | 5,206,914,404.27 | 5,354,521,275.39 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 2,986,371.83 | 2,986,371.83 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,685,060.67 | 2,685,060.67 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,017,384.00 | 1,017,384.00 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 438,532,932.23 | 7,863,041.50 | 9,496,829.62 | 5,213,603,220.77 | 5,669,496,024.12 |
| 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 | - | - | - | 36,710,263.95 | 36,710,263.95 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 14,754,824.99 | 14,754,824.99 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 7,058,747.74 | 7,058,747.74 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,176,457.97 | 1,176,457.97 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 3,775,512.09 | 3,775,512.09 |
| 应交税费 | - | - | - | 690,316.76 | 690,316.76 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 1,587,589.64 | 1,587,589.64 |

| | | | | | |
|--------------------------------------|----------------|--------------|--------------|------------------|------------------|
| 负债总计 | - | - | - | 65,753,713.14 | 65,753,713.14 |
| 利率敏感度缺口 | 438,532,932.23 | 7,863,041.50 | 9,496,829.62 | 5,147,849,507.63 | 5,603,742,310.98 |
| 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 291,017,213.54 | - | - | - | 291,017,213.54 |
| 结算备付金 | 2,921,593.38 | - | - | - | 2,921,593.38 |
| 存出保证金 | 1,351,039.43 | - | - | - | 1,351,039.43 |
| 交易性金融资产 | 100,320,000.00 | 1,496,552.50 | - | 3,938,060,202.84 | 4,039,876,755.34 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 104,142,697.92 | 104,142,697.92 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,646,649.13 | 1,646,649.13 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 4,248,696.81 | 4,248,696.81 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 395,609,846.35 | 1,496,552.50 | - | 4,048,098,246.70 | 4,445,204,645.55 |
| 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 | - | - | - | 1,479,827.84 | 1,479,827.84 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 5,890,453.54 | 5,890,453.54 |
| 应付托管费 | - | - | - | 981,742.28 | 981,742.28 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 2,977,507.25 | 2,977,507.25 |
| 应交税费 | - | - | - | 690,156.16 | 690,156.16 |

| | | | | | |
|---------|----------------|--------------|---|------------------|------------------|
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 1,812,739.42 | 1,812,739.42 |
| 负债总计 | - | - | - | 13,832,426.49 | 13,832,426.49 |
| 利率敏感度缺口 | 395,609,846.35 | 1,496,552.50 | - | 4,034,265,820.21 | 4,431,372,219.06 |

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率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 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| | 1.市场利率下降25个基点 | 82,377.58 | 129,604.93 |
| | 2.市场利率上升25个基点 | -82,264.62 | -129,270.83 |

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年12月31日 | | 上年度末 2018年12月31日 | |
|----|--------------------|------------|---------------------|------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 | 公允价值 | 占基金 资产净 |
| | | | | |

| | | 值比例 (%) | | 值比例 (%) |
|---------------|------------------|------------|------------------|------------|
| 交易性金融资产—股票投资 | 5,206,914,404.27 | 92.92 | 3,938,060,202.84 | 88.87 |
| 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 | 5,206,914,404.27 | 92.92 | 3,938,060,202.84 | 88.87 |

7.4.13.4.3.2 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 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| | 1.业绩比较基准上升5% | 403,875,835.41 | 299,910,261.38 |
| | 2.业绩比较基准下降5% | -403,875,835.41 | -299,910,261.38 |

7.4.14 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 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 5,209,523,584.58 元，属于第二层次的余额为 144,997,690.81 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 3,649,408,594.24 元，第二层次 390,468,161.10 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 2019 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 5,206,914,404.27 | 91.84 |
| | 其中：股票 | 5,206,914,404.27 | 91.84 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 147,606,871.12 | 2.60 |
| | 其中：债券 | 147,606,871.12 | 2.60 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 307,087,989.26 | 5.42 |
| 8 | 其他各项资产 | 7,886,759.47 | 0.14 |
| 9 | 合计 | 5,669,496,024.12 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | 3,255,563,255.38 | 58.10 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 48,751,734.08 | 0.87 |
| E | 建筑业 | - | - |
| 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 | 1,312,714,906.45 | 23.43 |
| J | 金融业 | 106,873,325.28 | 1.91 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 225,730,867.44 | 4.03 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,578.04 | 0.00 |
| 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 | 257,273,737.60 | 4.59 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 5,206,914,404.27 | 92.92 |

8.3 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 | 002410 | 广联达 | 12,105,305 | 411,338,263.90 | 7.34 |
| 2 | 600104 | 上汽集团 | 12,839,277 | 306,216,756.45 | 5.46 |
| 3 | 300207 | 欣旺达 | 14,318,923 | 279,505,376.96 | 4.99 |
| 4 | 300450 | 先导智能 | 5,665,655 | 254,614,535.70 | 4.54 |
| 5 | 603338 | 浙江鼎力 | 3,452,349 | 246,842,953.50 | 4.40 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|------------|----------------|------|
| 6 | 002415 | 海康威视 | 7,377,475 | 241,538,531.50 | 4.31 |
| 7 | 002027 | 分众传媒 | 36,059,244 | 225,730,867.44 | 4.03 |
| 8 | 600967 | 内蒙一机 | 19,955,978 | 212,132,046.14 | 3.79 |
| 9 | 000625 | 长安汽车 | 20,672,905 | 207,349,237.15 | 3.70 |
| 10 | 300144 | 宋城演艺 | 6,206,572 | 191,845,140.52 | 3.42 |
| 11 | 601633 | 长城汽车 | 21,489,502 | 190,182,092.70 | 3.39 |
| 12 | 002153 | 石基信息 | 4,745,753 | 185,084,367.00 | 3.30 |
| 13 | 300113 | 顺网科技 | 6,714,444 | 172,494,066.36 | 3.08 |
| 14 | 601238 | 广汽集团 | 14,315,887 | 167,352,719.03 | 2.99 |
| 15 | 603678 | 火炬电子 | 7,128,197 | 163,520,839.18 | 2.92 |
| 16 | 600570 | 恒生电子 | 2,076,193 | 161,382,481.89 | 2.88 |
| 17 | 002405 | 四维图新 | 8,424,243 | 135,630,312.30 | 2.42 |
| 18 | 002396 | 星网锐捷 | 3,773,081 | 134,170,760.36 | 2.39 |
| 19 | 600699 | 均胜电子 | 6,962,364 | 124,626,315.60 | 2.22 |
| 20 | 600845 | 宝信软件 | 3,770,430 | 124,047,147.00 | 2.21 |
| 21 | 600588 | 用友网络 | 4,321,770 | 122,738,268.00 | 2.19 |
| 22 | 000895 | 双汇发展 | 3,819,200 | 110,871,376.00 | 1.98 |
| 23 | 300699 | 光威复材 | 2,006,383 | 91,290,426.50 | 1.63 |
| 24 | 000725 | 京东方 A | 16,641,600 | 75,552,864.00 | 1.35 |
| 25 | 002301 | 齐心集团 | 5,897,250 | 71,710,560.00 | 1.28 |
| 26 | 000156 | 华数传媒 | 6,267,107 | 65,428,597.08 | 1.17 |
| 27 | 603960 | 克来机电 | 1,843,874 | 59,409,620.28 | 1.06 |
| 28 | 000100 | TCL 集团 | 12,377,273 | 55,326,410.31 | 0.99 |
| 29 | 600036 | 招商银行 | 1,336,600 | 50,229,428.00 | 0.90 |
| 30 | 000001 | 平安银行 | 3,045,134 | 50,092,454.30 | 0.89 |
| 31 | 000831 | 五矿稀土 | 3,765,900 | 48,806,064.00 | 0.87 |
| 32 | 000601 | 韶能股份 | 8,799,952 | 48,751,734.08 | 0.87 |
| 33 | 000970 | 中科三环 | 4,488,702 | 48,253,546.50 | 0.86 |
| 34 | 300119 | 瑞普生物 | 3,282,500 | 47,432,125.00 | 0.85 |
| 35 | 600380 | 健康元 | 4,482,754 | 46,396,503.90 | 0.83 |
| 36 | 688029 | 南微医学 | 160,568 | 25,757,207.68 | 0.46 |
| 37 | 300088 | 长信科技 | 2,449,800 | 25,159,446.00 | 0.45 |
| 38 | 300014 | 亿纬锂能 | 250,000 | 12,540,000.00 | 0.22 |
| 39 | 688006 | 杭可科技 | 200,000 | 7,946,000.00 | 0.14 |
| 40 | 601658 | 邮储银行 | 1,137,968 | 6,549,005.78 | 0.12 |
| 41 | 688123 | 聚辰股份 | 6,660 | 387,079.20 | 0.01 |
| 42 | 000063 | 中兴通讯 | 10,000 | 353,900.00 | 0.01 |
| 43 | 688181 | 八亿时空 | 4,306 | 189,377.88 | 0.00 |
| 44 | 688081 | 兴图新科 | 3,153 | 88,946.13 | 0.00 |
| 45 | 002972 | 科安达 | 1,075 | 21,532.25 | 0.00 |
| 46 | 603109 | 神驰机电 | 684 | 18,105.48 | 0.00 |
| 47 | 002973 | 侨银环保 | 1,146 | 6,578.04 | 0.00 |
| 48 | 601688 | 华泰证券 | 120 | 2,437.20 | 0.00 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 002415 | 海康威视 | 350,014,781.67 | 7.90 |
| 2 | 600104 | 上汽集团 | 348,494,944.78 | 7.86 |
| 3 | 300498 | 温氏股份 | 273,008,992.24 | 6.16 |
| 4 | 002410 | 广联达 | 240,718,885.29 | 5.43 |
| 5 | 300207 | 欣旺达 | 223,431,247.25 | 5.04 |
| 6 | 601211 | 国泰君安 | 218,985,741.56 | 4.94 |
| 7 | 600588 | 用友网络 | 216,684,462.23 | 4.89 |
| 8 | 600967 | 内蒙一机 | 214,563,810.78 | 4.84 |
| 9 | 601601 | 中国太保 | 204,836,028.38 | 4.62 |
| 10 | 002027 | 分众传媒 | 204,501,564.61 | 4.61 |
| 11 | 601633 | 长城汽车 | 202,830,024.77 | 4.58 |
| 12 | 600741 | 华域汽车 | 202,266,856.62 | 4.56 |
| 13 | 603678 | 火炬电子 | 197,452,352.60 | 4.46 |
| 14 | 600845 | 宝信软件 | 191,694,790.55 | 4.33 |
| 15 | 601238 | 广汽集团 | 190,672,169.91 | 4.30 |
| 16 | 000625 | 长安汽车 | 190,216,594.57 | 4.29 |
| 17 | 300450 | 先导智能 | 188,139,749.42 | 4.25 |
| 18 | 300571 | 平治信息 | 187,986,461.54 | 4.24 |
| 19 | 300383 | 光环新网 | 160,361,451.54 | 3.62 |
| 20 | 300496 | 中科创达 | 158,350,695.23 | 3.57 |
| 21 | 300253 | 卫宁健康 | 146,795,334.99 | 3.31 |
| 22 | 600837 | 海通证券 | 144,214,367.85 | 3.25 |
| 23 | 600315 | 上海家化 | 133,266,313.60 | 3.01 |
| 24 | 002138 | 顺络电子 | 127,600,289.34 | 2.88 |
| 25 | 603259 | 药明康德 | 127,340,040.88 | 2.87 |
| 26 | 600699 | 均胜电子 | 126,026,836.37 | 2.84 |
| 27 | 300144 | 宋城演艺 | 124,478,056.75 | 2.81 |
| 28 | 002475 | 立讯精密 | 124,022,977.64 | 2.80 |
| 29 | 002405 | 四维图新 | 123,065,695.52 | 2.78 |
| 30 | 002174 | 游族网络 | 119,667,121.22 | 2.70 |
| 31 | 300113 | 顺网科技 | 119,632,075.97 | 2.70 |
| 32 | 300136 | 信维通信 | 117,604,981.47 | 2.65 |
| 33 | 601688 | 华泰证券 | 117,267,186.52 | 2.65 |
| 34 | 600066 | 宇通客车 | 116,645,917.31 | 2.63 |
| 35 | 002396 | 星网锐捷 | 116,466,925.32 | 2.63 |

| | | | | |
|----|--------|-------|----------------|------|
| 36 | 000725 | 京东方 A | 115,081,461.40 | 2.60 |
| 37 | 000895 | 双汇发展 | 111,833,142.11 | 2.52 |
| 38 | 600570 | 恒生电子 | 101,190,860.50 | 2.28 |
| 39 | 600030 | 中信证券 | 94,375,191.23 | 2.13 |
| 40 | 300357 | 我武生物 | 90,565,988.33 | 2.04 |

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。

8.4.2 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 | 601688 | 华泰证券 | 430,908,069.83 | 9.72 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 429,347,178.22 | 9.69 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 415,946,412.04 | 9.39 |
| 4 | 002007 | 华兰生物 | 328,619,826.47 | 7.42 |
| 5 | 300383 | 光环新网 | 306,714,814.56 | 6.92 |
| 6 | 300498 | 温氏股份 | 287,986,333.69 | 6.50 |
| 7 | 600276 | 恒瑞医药 | 226,081,122.93 | 5.10 |
| 8 | 600741 | 华域汽车 | 222,374,208.03 | 5.02 |
| 9 | 601601 | 中国太保 | 207,347,167.40 | 4.68 |
| 10 | 603259 | 药明康德 | 205,062,500.12 | 4.63 |
| 11 | 601211 | 国泰君安 | 201,580,171.03 | 4.55 |
| 12 | 600004 | 白云机场 | 192,180,452.36 | 4.34 |
| 13 | 300496 | 中科创达 | 167,759,865.66 | 3.79 |
| 14 | 002179 | 中航光电 | 165,608,311.28 | 3.74 |
| 15 | 002138 | 顺络电子 | 165,000,822.38 | 3.72 |
| 16 | 600570 | 恒生电子 | 160,260,420.34 | 3.62 |
| 17 | 300253 | 卫宁健康 | 159,369,838.82 | 3.60 |
| 18 | 002475 | 立讯精密 | 157,697,173.19 | 3.56 |
| 19 | 000977 | 浪潮信息 | 154,043,896.73 | 3.48 |
| 20 | 300571 | 平治信息 | 153,920,940.60 | 3.47 |
| 21 | 600176 | 中国巨石 | 152,352,741.08 | 3.44 |
| 22 | 002815 | 崇达技术 | 149,573,486.52 | 3.38 |
| 23 | 300136 | 信维通信 | 146,520,842.36 | 3.31 |
| 24 | 002174 | 游族网络 | 146,284,786.13 | 3.30 |
| 25 | 600009 | 上海机场 | 142,969,556.34 | 3.23 |
| 26 | 300457 | 赢合科技 | 140,244,812.71 | 3.16 |
| 27 | 600837 | 海通证券 | 132,705,646.17 | 2.99 |
| 28 | 600340 | 华夏幸福 | 127,469,433.54 | 2.88 |
| 29 | 600588 | 用友网络 | 127,318,782.29 | 2.87 |
| 30 | 002415 | 海康威视 | 121,504,430.81 | 2.74 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|------|
| 31 | 600315 | 上海家化 | 121,332,840.84 | 2.74 |
| 32 | 300357 | 我武生物 | 120,615,381.86 | 2.72 |
| 33 | 300476 | 胜宏科技 | 108,390,783.18 | 2.45 |
| 34 | 600803 | 新奥股份 | 105,451,401.61 | 2.38 |
| 35 | 000568 | 泸州老窖 | 104,023,221.41 | 2.35 |
| 36 | 600066 | 宇通客车 | 102,305,583.47 | 2.31 |
| 37 | 300144 | 宋城演艺 | 99,590,855.57 | 2.25 |
| 38 | 603160 | 汇顶科技 | 98,586,757.97 | 2.22 |
| 39 | 000002 | 万科 A | 98,153,979.54 | 2.21 |
| 40 | 600256 | 广汇能源 | 92,800,314.40 | 2.09 |
| 41 | 300661 | 圣邦股份 | 88,687,350.88 | 2.00 |

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。

8.4.3 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 | 10,002,338,203.85 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 10,586,106,663.36 |

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。

8.5 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 130,247,000.00 | 2.32 |
| | 其中：政策性金融债 | 130,247,000.00 | 2.32 |
| 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） | 17,359,871.12 | 0.31 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|----------------|------|
| 10 | 合计 | 147,606,871.12 | 2.63 |
|----|----|----------------|------|

8.6 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 | 190402 | 19 农发 02 | 1,000,000 | 100,070,000.00 | 1.79 |
| 2 | 150415 | 15 农发 15 | 300,000 | 30,177,000.00 | 0.54 |
| 3 | 123036 | 先导转债 | 64,271 | 6,427,100.00 | 0.11 |
| 4 | 120003 | 19 华菱 EB | 42,276 | 4,865,967.60 | 0.09 |
| 5 | 113552 | 克来转债 | 18,880 | 2,340,742.40 | 0.04 |

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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 | 1,197,942.97 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,986,371.83 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,685,060.67 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 1,017,384.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 7,886,759.47 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) |
|----|--------|----------|--------------|----------------------|
| 1 | 132014 | 18 中化 EB | 1,607,703.10 | 0.03 |

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 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 |
| 185,054 | 15,848.74 | 10,675,073.69 | 0.36% | 2,922,197,506.33 | 99.64% |

9.2 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 | 2,491.65 | 0.0001% |

9.3 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 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 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日(2007年4月2日)基金份额总额 | 10,874,939,465.41 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,295,441,535.81 |
| 本报告期基金总申购份额 | 349,703,789.04 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 712,272,744.83 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,932,872,580.02 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 13 年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务，本报告年度的审计费用为 110,000.00 元。

11.6 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，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稽查或处罚。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对我司采取责令改正措施的决定，对

公司提出整改要求。公司已及时完成了整改。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 浙商证券 | 1 | 16,344,814.29 | 0.08% | 15,222.07 | 0.08% | - |
| 中金财富 | 1 | 722,194,999.91 | 3.51% | 672,573.32 | 3.67% | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | 12,343,331.02 | 0.06% | 9,874.66 | 0.05% | - |
| 华西证券 | 1 | 220,885,203.87 | 1.07% | 176,708.11 | 0.96% | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | 1,732,336,618.90 | 8.43% | 1,613,329.70 | 8.80% | - |
| 瑞银证券 | 1 | 1,503,579,868.40 | 7.31% | 1,400,306.56 | 7.64% | - |
| 中信建投 | 1 | 432,078,435.16 | 2.10% | 402,395.54 | 2.20% | - |
| 国信证券 | 1 | 211,257,817.09 | 1.03% | 196,746.04 | 1.07% | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | 140,019,378.31 | 0.68% | 130,399.95 | 0.71% | - |
| 新时代证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | 18,265,460.04 | 0.09% | 17,010.72 | 0.09% | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | 799,577,062.13 | 3.89% | 744,643.57 | 4.06% | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | 330,879,030.45 | 1.61% | 308,152.99 | 1.68% | - |
| 兴业证券 | 2 | 669,382,358.99 | 3.26% | 623,402.76 | 3.40% | - |
| 国金证券 | 2 | 1,525,767,378.92 | 7.42% | 1,224,312.14 | 6.68% | - |
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 九州证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | 504,785,713.18 | 2.46% | 470,104.01 | 2.56% | - |
| 东北证券 | 1 | 1,920,611,752.31 | 9.34% | 1,788,667.39 | 9.76% | - |
| 方正证券 | 1 | 1,807,105,877.12 | 8.79% | 1,639,194.11 | 8.94% | - |
| 华创证券 | 2 | 1,264,861,298.56 | 6.15% | 1,048,542.87 | 5.72% | - |
| 海通证券 | 2 | 85,672,038.00 | 0.42% | 79,785.83 | 0.44% | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | 1,235,815,245.90 | 6.01% | 988,646.61 | 5.39% | - |
| 中信证券华南 | 2 | 5,153,882,426.88 | 25.07% | 4,546,289.84 | 24.80% | - |

| | | | | | | |
|------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 西部证券 | 0 | 251,267,694.16 | 1.22% | 234,005.45 | 1.28% | - |
|------|---|----------------|-------|------------|-------|---|

注：a) 本报告期内本基金减少西部证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中信证券股份有限公司各一个交易单元,无新增交易单元,中国中投证券有限责任公司更名为中国中金财富证券有限公司, 广州证券股份有限公司更名为中信证券华南股份有限公司。

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服务; 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。

11.7.2 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 |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富 | - | - | 680,000,000.00 | 6.05% | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | 160,000,000.00 | 1.42% | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1,720,631.16 | 17.38% | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 212,615.60 | 2.15% | 3,150,000,000.00 | 28.02% | - | - |

| | | | | | | |
|--------|--------------|--------|------------------|--------|---|---|
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 124,382.60 | 1.26% | 440,000,000.00 | 3.91% | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1,411,939.00 | 14.26% | 1,140,000,000.00 | 10.14% | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 202,739.50 | 2.05% | 610,000,000.00 | 5.43% | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 九州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | 200,000,000.00 | 1.78% | - | - |
| 东北证券 | 536,855.69 | 5.42% | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | 1,870,000,000.00 | 16.64% | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | 250,000,000.00 | 2.22% | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券华南 | 5,692,300.58 | 57.49% | 2,390,000,000.00 | 21.26% | - | - |
| 西部证券 | - | - | 350,000,000.00 | 3.11% | - | - |

11.8 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、证券日报及基金管理人网站 | 2019-01-03 |
| 2 | 易方达基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-01-29 |
| 3 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加长沙银行为销售机构、参加长沙银 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日 | 2019-01-31 |

| | | | |
|----|----------------------------------------------------|-------------------------------|------------|
| | 行电子渠道费率优惠活动的公告 | 报及基金管理人网站 | |
| 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九州证券费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-02-13 |
| 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华夏财富为销售机构、参加华夏财富费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-02-22 |
| 6 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华融湘江银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-03-01 |
| 7 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国信证券费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-03-05 |
| 8 | 易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-03-13 |
| 9 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加利得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、证券日报及基金管理人网站 | 2019-03-13 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-03-19 |
| 11 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加昆仑银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-03-29 |
| 12 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行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、证券日报及基金管理人网站 | 2019-03-30 |
| 13 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加泉州银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-04-01 |
| 14 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商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、证券日报及基金管理人网站 | 2019-04-01 |
| 15 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加青岛银行为销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-04-08 |
| 16 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国盛证券费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-04-12 |
| 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齐商银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-05-07 |
| 18 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放 | 中国证券报、上海证券 | 2019-05-16 |

| | | | |
|----|---------------------------------------------------------|-------------------------------|------------|
| | 式基金参加中国民生银行费率优惠活动的公告 | 报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | |
| 19 | 易方达基金管理有限公司关于民族证券并入方正证券期间基金业务安排的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-05-22 |
| 20 | 易方达基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-05-28 |
| 21 | 易方达基金管理有限公司关于调整转换业务货币市场基金未付收益支付规则的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-06-20 |
| 22 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加佛山农商银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-06-21 |
| 23 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于科创板股票的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-06-22 |
| 24 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加德邦证券费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-06-24 |
| 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长城国瑞证券费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-06-28 |
| 26 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加云南红塔银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-07-05 |
| 27 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加安信证券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、证券日报及基金管理人网站 | 2019-07-15 |
| 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红塔证券费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-07-15 |
| 29 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加天津农商银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-07-16 |
| 30 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加海通证券费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-08-12 |
| 31 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加销售机构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、证券日报及基金管理人网站 | 2019-08-13 |
| 32 | 易方达基金管理有限公司关于暂停北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-08-13 |

| | | | |
|----|-------------------------------------------------------------|---------------------------------------------|------------|
| 33 | 易方达基金管理有限公司关于暂停北京加和基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-08-14 |
| 34 | 易方达基金管理有限公司关于暂停上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-08-14 |
| 35 | 易方达基金管理有限公司关于暂停深圳宜投基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-08-14 |
| 36 | 易方达基金管理有限公司关于暂停厦门市鑫鼎盛控股有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-08-14 |
| 37 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加潍坊银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-08-26 |
| 38 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加广东南粤银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-09-30 |
| 39 | 易方达基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2019-10-24 |
| 40 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加方正证券费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-11-08 |
| 41 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中邮证券为销售机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-11-13 |
| 42 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国邮政储蓄银行个人网上银行和手机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、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-12-30 |
| 43 | 易方达基金管理有限公司关于公司股权变更的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 44 | 易方达基金管理有限公司关于易方达价值成长混合型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同、托 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |

| | | | |
|----|----------------------------------------------------------|---------------------------------------------|------------|
| | 管协议部分条款的公告 | | |
| 45 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 46 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加昆仑银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 47 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加苏州银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 48 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加烟台银行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、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 49 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行“2020 倾心回馈”基金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、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |
| 50 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行渠道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、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2019-12-31 |

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达价值成长混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达价值成长混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇二〇年三月三十一日