

易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

2016 年第 2 季度报告

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

报告送出日期：二〇一六年七月十九日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 7 月 14 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达创新驱动混合
基金主代码	000603
交易代码	000603
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 13 日
报告期末基金份额总额	3,468,329,851.78 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在资产配置的基础上，本基金重点关注所在行业景气度较高且具有可持续性、所

	在行业竞争格局良好、管理层素质较高的创新驱动型公司。
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中债总财富指数收益率
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，高于债券型基金和货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2016 年 4 月 1 日-2016 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	24,490,429.51
2.本期利润	149,620,449.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.0422
4.期末基金资产净值	3,605,889,761.91
5.期末基金份额净值	1.040

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增	净值增	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

	长率①	长率标 准差②	较基准 收益率 ③	较基准 收益率 标准差 ④		
过去三个 月	4.42%	1.79%	-0.88%	0.51%	5.30%	1.28%

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

易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2015 年 2 月 13 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 4.00% ，同期业绩比较基准收益率为-0.41%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
樊正伟	本基金的基金经理、易方达新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2015-03-14	-	6 年	硕士研究生，曾任中国银行深圳分行职员，易方达基金管理有限公司渠道经理、研究员、易方达积极成长证券投资基金基金经理助理。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 6 次，全部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。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年二季度，上证综指下跌 2.47%，深圳综指上涨 3.24%，沪深 300 指数下跌 1.99%，创业板指下跌 0.47%。板块方面，二季度中信行业指数中食品饮料、电子元器件、家电等行业涨幅居前；餐饮旅游、传媒、交通运输等行业跌幅居前。

在 2016 年二季度的投资过程中，本基金一方面保持了对战略新兴产业的配置，另一方面也针对传统产业中积极转型并取得成效的产业进行了布局。

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 1.040 元，本报告期份额净值增长率为 4.42%，同期业绩比较基准收益率为 -0.88%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下一阶段，宏观经济方面，整体保持平稳。虽然经济增速可能面临一定的下滑压力，但预计政府将继续采取对冲措施。

货币政策方面，也将保持中性。自 2014 年年末以来已经实施了多次降息、降准，考虑人民币汇率、通货膨胀的限制，预计继续实施货币宽松的空间不大，但由于依然面临着经济下行压力以及国际政治、金融环境动荡，预计在目前阶段实施货币紧缩的可能性也不大。

在经济转型的大背景下，能使中国经济进一步恢复活力的是各种新兴产业，所以在行业配置上，将会坚持符合中国经济新常态背景的新技术、新行业和新商业模式的大方向。与此同时，传统产业中的优秀企业也在积极进行转型，其中也将出现大量投资机会。

最后，衷心感谢持有人对本基金的信任和支持，我们将努力工作，力争回

报大家的信任。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,142,059,810.74	86.56
	其中：股票	3,142,059,810.74	86.56
2	固定收益投资	55,674,420.50	1.53
	其中：债券	55,674,420.50	1.53
	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	414,469,933.66	11.42
7	其他资产	17,838,707.80	0.49
8	合计	3,630,042,872.70	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	2,040,313,284.40	56.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,581,780.95	1.01

E	建筑业	775,274.28	0.02
F	批发和零售业	20,849,317.50	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	104,451,881.10	2.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	663,927,306.21	18.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	20,939,350.80	0.58
L	租赁和商务服务业	34,192,278.00	0.95
M	科学研究和技术服务业	118,294,333.50	3.28
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	17,233,104.00	0.48
S	综合	84,501,900.00	2.34
	合计	3,142,059,810.74	87.14

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300310	宜通世纪	5,210,709	178,787,696.71	4.96
2	300222	科大智能	5,760,000	157,766,400.00	4.38
3	002137	麦达数字	8,920,445	151,290,747.20	4.20
4	300100	双林股份	3,433,313	150,413,442.53	4.17
5	300068	南都电源	6,763,293	147,845,584.98	4.10
6	300409	道氏技术	3,024,336	144,714,477.60	4.01
7	002551	尚荣医疗	6,145,143	143,673,443.34	3.98
8	300166	东方国信	5,064,676	142,975,803.48	3.97
9	300113	顺网科技	3,520,640	130,762,125.00	3.63
10	002643	万润股份	2,481,997	126,284,007.36	3.50

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,000,000.00	1.39
	其中：政策性金融债	50,000,000.00	1.39
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）	5,674,420.50	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,674,420.50	1.54

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	150416	15 农发 16	500,000	50,000,000.00	1.39
2	110031	航信转债	51,450	5,674,420.50	0.16

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,377,416.08
2	应收证券清算款	7,137,607.01
3	应收股利	-
4	应收利息	1,430,046.60
5	应收申购款	7,893,638.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,838,707.80

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	110031	航信转债	5,674,420.50	0.16

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分 的公允价值 （元）	占基金资产 净值比例 （%）	流通受限 情况说明
1	300166	东方国信	142,975,803.48	3.97	重大事项 停牌
2	300310	宜通世纪	35,395,360.00	0.98	非公开发 行流通受 限
3	300113	顺网科技	21,157,483.88	0.59	非公开发 行流通受

					限
--	--	--	--	--	---

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,532,681,193.84
报告期基金总申购份额	332,272,641.94
减：报告期基金总赎回份额	396,623,984.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	3,468,329,851.78

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会注册易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；

2. 《易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3. 《易方达创新驱动灵活配置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、营业执照。

8.2 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。

8.3 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

二〇一六年七月十九日