

# 易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

## 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§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	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	45
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	45
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45

§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 备查文件目录.....	50
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达瑞享混合	
基金主代码	001437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 26 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	151,822,785.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
下属分级基金的交易代码	001437	001438
报告期末下属分级基金的份额总额	87,017,471.09 份	64,805,314.01 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过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、货币市场工具等资产类别的配置比例，严格遵守低估值的股票投资逻辑，以绝对收益为目标，力争获得稳健、持续的投资收益。
业绩比较基准	一年期人民币定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期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。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	林葛
	联系电话	020-85102688	010-66060069
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95599
传真		020-85104666	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	北京市东城区建国门内大街69 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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	510620	100031
法定代表人	刘晓艳	周慕冰

## 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	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）	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
本期已实现收益	3,605,591.52	3,566,624.22
本期利润	6,066,892.82	5,255,754.91
加权平均基金份额本期利润	0.0453	0.0829
本期加权平均净值利润率	3.71%	8.20%
本期基金份额净值增长率	8.15%	8.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
期末可供分配利润	25,896,601.98	4,510,018.91
期末可供分配基金份额利润	0.2976	0.0696
期末基金资产净值	115,456,172.61	70,876,406.44
期末基金份额净值	1.327	1.094
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E

基金份额累计净值增长率	32.70%	9.40%
-------------	--------	-------

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

易方达瑞享混合 I

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	6.33%	1.60%	0.29%	0.01%	6.04%	1.59%
过去三个月	4.74%	1.74%	0.88%	0.01%	3.86%	1.73%
过去六个月	8.15%	2.07%	1.77%	0.01%	6.38%	2.06%
过去一年	32.70%	2.01%	3.68%	0.01%	29.02%	2.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	32.70%	2.00%	3.73%	0.01%	28.97%	1.99%

易方达瑞享混合 E

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	6.32%	1.59%	0.29%	0.01%	6.03%	1.58%
过去三个月	4.69%	1.73%	0.88%	0.01%	3.81%	1.72%
过去六个月	8.00%	2.07%	1.77%	0.01%	6.23%	2.06%
过去一年	9.40%	1.49%	3.68%	0.01%	5.72%	1.48%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	9.40%	1.48%	3.73%	0.01%	5.67%	1.47%

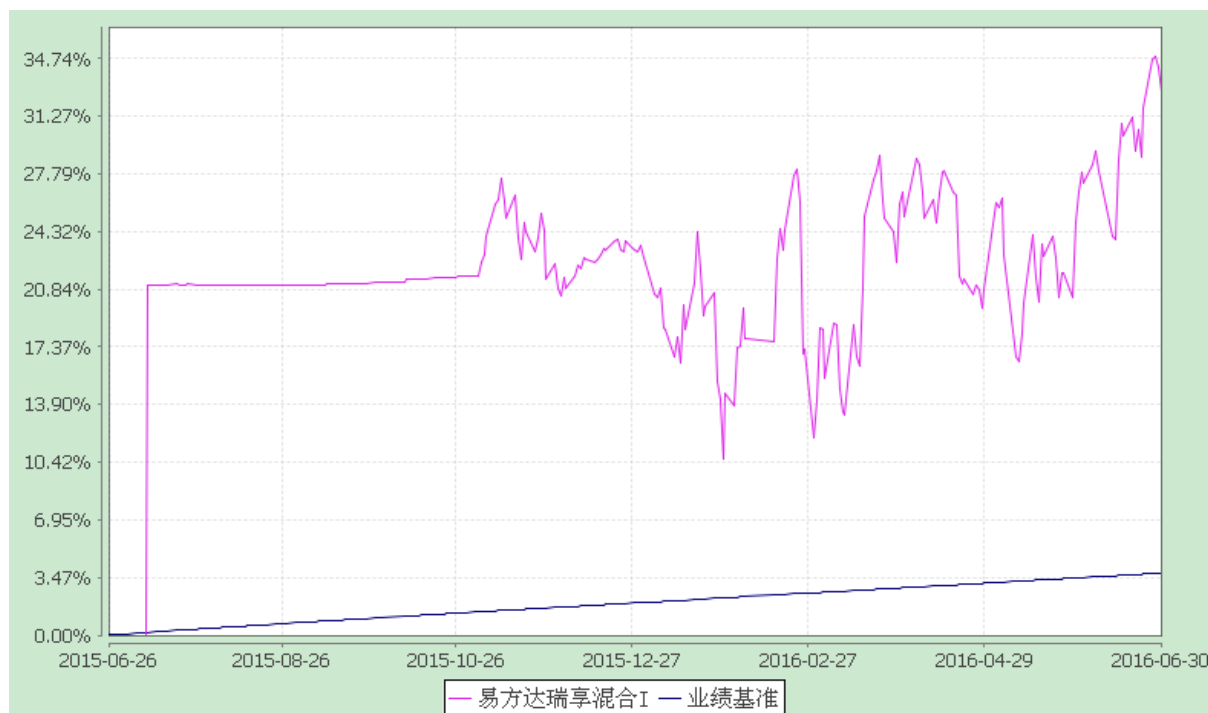
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

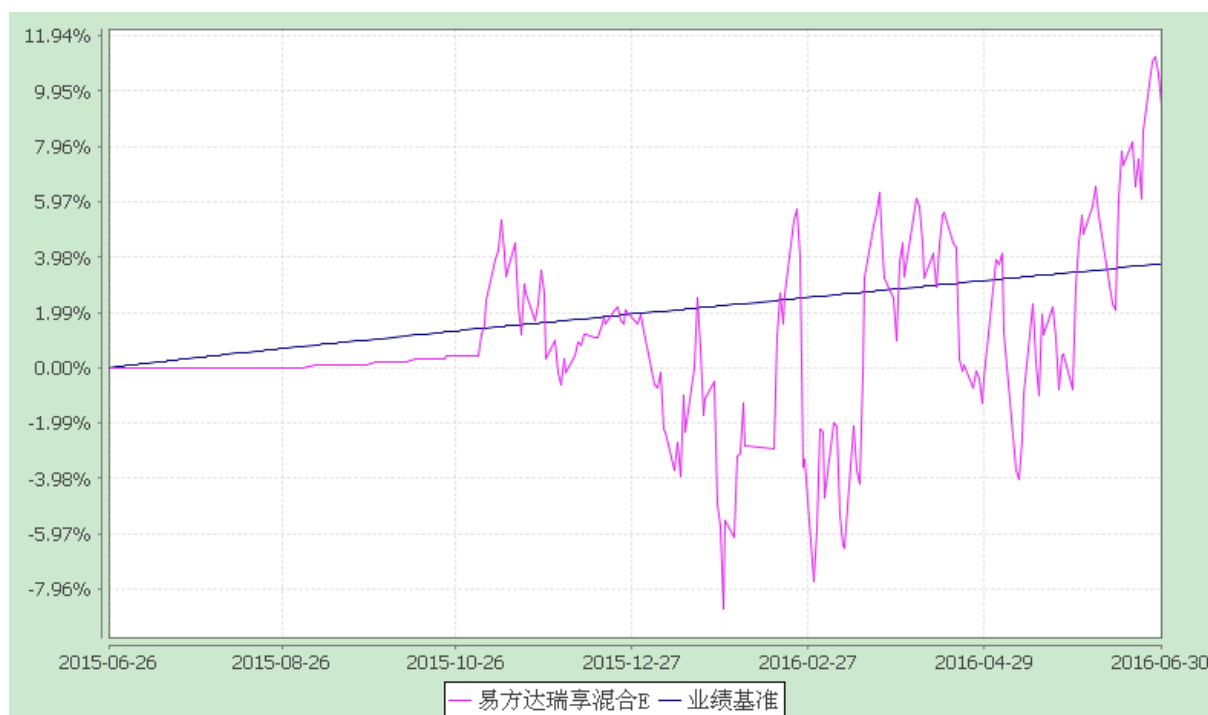
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年6月26日至2016年6月30日)

易方达瑞享混合 I



易方达瑞享混合 E



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，I类基金份额净值增长率为 32.70%，E 类基金份额净值增长率为 9.40%，同期业绩比较基准收益率为 3.73%。



## §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		
廖振华	本基金的基金经理、易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理（自 2015 年 07 月 31 日至 2016 年 05 月 30 日）、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理（自 2015 年 12 月 02 日至 2016 年 05 月 30 日）、易方达策略成长二号混合型证券投资	2015-06-26	2016-05-31	8 年	硕士研究生，曾任招商证券研究员，易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理。

	基金的基金经理（自 2015 年 01 月 14 日至 2016 年 05 月 30 日）				
梁裕宁	本基金的基金经理	2016-01-23	-	6 年	硕士研究生, 曾任普华永道会计师事务所高级审计师, 中山华通五金制品有限公司总裁助理, QQ Distinction Pty Ltd 董事、财务负责人, 易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、投资经理兼行业研究员。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，廖振华的“任职日期”为基金合同生效之日，梁裕宁的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

- 2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
- 3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关助理协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

#### 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 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

回顾上半年，A 股整体走势呈“L”型，年初由于人民币超预期快速贬值及熔断机制的引进，导致 A 股急跌，其后逐步企稳，并持续在 2800 到 3100 点区间内窄幅震荡。截止本报告期末，上证指数收于 2929 点，下跌-17.22%，创业板指数收于 2227 点，下跌 17.92%。上证成交额从 2015 年下半年的日均 5000 亿元下降到只有 2200 亿元左右水平，市场人气低迷，风险偏好持续下降。低估值、高分红、景气反转的行业持续受到资金追捧，年初以来食品饮料、有色金属、家电、汽车等跌幅较小。传媒、餐饮旅游、计算机等新兴行业估值偏高，在年初暴跌后尚未出现明显反弹。

基于震荡市的判断，本基金上半年在资产配置上较为灵活，维持高仓位并采取积极操作：持续配置贵金属、白酒、养殖等景气周期向上行业，并适当参与新能源汽车、OLED 及区块链等市场热点，提升组合弹性。整体效果尚可，本基金在上半年取得了约 8%的正收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 I 类基金份额净值为 1.327 元，本报告期份额净值增长率为 8.15%；E 类基金份额净值为 1.094 元，本报告期份额净值增长率为 8.00%；同期业绩比较基准收益率为 1.77%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们仍然维持震荡市的判断，同时预期市场波动幅度将较上半年有所提升。国际层面，美国加息节奏持续低于预期，人民币汇率贬值带来的外汇储备流出担忧逐步释放，全球经济宽松预期增强。国内层面，市场供给节奏得到有效控制，注册制推迟、再融资收紧、IPO 有序，都为市场信心修复起到较大帮助。经济层面，通胀压力缓和，货币政策收紧预期下降，供给侧改革进度超预期等因素，为股市创造结构性波段机会的可能性。中期来看，实体经济基本面改善尚未明确，因此支持资本市场持续走强的基础尚未形成。

在下一阶段的资产配置上，我们将维持较高的股票仓位，以价值股为主，并适当增加周期股的配置，结构上比较看好煤炭、有色金属等行业。从中长期看，本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法，从宏观面、政策面、资金面和基本面等四个角度进行综合分析，根据市场情况灵活配

置资产，努力挖掘具有较高成长性与动态投资价值的股票。

#### 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

易方达瑞享混合 I：本报告期内未实施利润分配。

易方达瑞享混合 E：本报告期内未实施利润分配。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—易方达基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行

为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，易方达基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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：易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,899,886.47	14,552,603.22
结算备付金		2,343,484.77	1,493,535.23
存出保证金		692,553.10	76,355.05
交易性金融资产	6.4.7.2	159,400,900.45	162,186,310.00
其中：股票投资		159,400,900.45	55,431,810.00
基金投资		-	-
债券投资		-	106,754,500.00
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	-	78,400,237.60
应收证券清算款		13,994,971.04	-
应收利息	6.4.7.5	4,201.59	2,477,715.27
应收股利		-	-
应收申购款		2,559,630.34	73,641.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>188,895,627.76</b>	<b>259,260,397.54</b>

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
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		118,064.77	33,707.77
应付管理人报酬		115,180.45	156,741.43
应付托管费		21,596.34	29,389.02
应付销售服务费		11,385.31	5,894.66
应付交易费用	6.4.7.7	2,092,330.89	193,035.31
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	204,490.95	181,510.54
负债合计		2,563,048.71	600,278.73
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	151,822,785.10	221,583,987.03
未分配利润	6.4.7.10	34,509,793.95	37,076,131.78
所有者权益合计		186,332,579.05	258,660,118.81
负债和所有者权益总计		188,895,627.76	259,260,397.54

注：1.本基金合同生效日为 2015 年 6 月 26 日，2015 年度实际报告期间为 2015 年 6 月 26 日至 2015 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2016 年 6 月 30 日，I 类基金份额净值 1.327 元，E 类基金份额净值 1.094 元；基金份额总额 151,822,785.10 份，下属分级基金的份额总额分别为：I 类基金份额总额 87,017,471.09 份，E 类基金份额总额 64,805,314.01 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日（基 金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		<b>20,428,863.14</b>	<b>17,104.12</b>

1.利息收入		417,540.98	17,104.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	153,821.08	17,104.12
债券利息收入		203,721.62	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59,998.28	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,779,335.80	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,715,972.89	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	637,645.84	-
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	425,717.07	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,150,431.99	-
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	81,554.37	-
<b>减：二、费用</b>		<b>9,106,215.41</b>	<b>28,861.19</b>
1. 管理人报酬		906,099.90	18,743.79
2. 托管费		169,893.72	3,514.46
3. 销售服务费		63,602.72	1,176.49
4. 交易费用	6.4.7.18	7,722,908.19	-
5. 利息支出		4,654.80	-
其中：卖出回购金融资产支出		4,654.80	-
6. 其他费用	6.4.7.19	239,056.08	5,426.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>11,322,647.73</b>	<b>-11,757.07</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>11,322,647.73</b>	<b>-11,757.07</b>

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 26 日，上年度可比期间为 2015 年 6 月 26 日至 2015 年 6 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

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）	221,583,987.03	37,076,131.78	258,660,118.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,322,647.73	11,322,647.73
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）	-69,761,201.93	-13,888,985.56	-83,650,187.49
其中：1.基金申购款	25,070,064.35	3,242,950.03	28,313,014.38
2.基金赎回款	-94,831,266.28	-17,131,935.59	-111,963,201.87
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）	151,822,785.10	34,509,793.95	186,332,579.05
项目	上年度可比期间		
	2015 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	213,801,701.29	-	213,801,701.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,757.07	-11,757.07
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	213,801,701.29	-11,757.07	213,789,944.22

注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 26 日，上年度可比期间为 2015 年 6 月 26 日至 2015 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金(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]1041号《关于准予易方达瑞享灵活配置混合型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《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为213,801,701.29份基金份额,其中认购资金利息折合1,200.00份基金份额。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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达瑞享灵活配置混合型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	9,899,886.47
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	9,899,886.47

##### 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	156,275,626.53	159,400,900.45	3,125,273.92

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		156,275,626.53	159,400,900.45	3,125,273.92

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,971.92
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	949.14
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	280.53
合计	4,201.59

#### 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	2,092,330.89

银行间市场应付交易费用	-
合计	2,092,330.89

**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	114.05
预提费用	204,376.90
合计	204,490.95

**6.4.7.9 实收基金****易方达瑞享混合 I**

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	159,812,608.87	159,812,608.87
本期申购	10,889,831.56	10,889,831.56
本期赎回（以“-”号填列）	-83,684,969.34	-83,684,969.34
本期末	87,017,471.09	87,017,471.09

**易方达瑞享混合 E**

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	61,771,378.16	61,771,378.16
本期申购	14,180,232.79	14,180,232.79
本期赎回（以“-”号填列）	-11,146,296.94	-11,146,296.94
本期末	64,805,314.01	64,805,314.01

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润****易方达瑞享混合 I**

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	37,295,141.98	-996,556.72	36,298,585.26
本期利润	3,605,591.52	2,461,301.30	6,066,892.82
本期基金份额交易产生的变动数	-15,004,131.52	1,077,354.96	-13,926,776.56
其中：基金申购款	2,669,558.43	366,490.19	3,036,048.62
基金赎回款	-17,673,689.95	710,864.77	-16,962,825.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,896,601.98	2,542,099.54	28,438,701.52

## 易方达瑞享混合 E

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	1,095,329.99	-317,783.47	777,546.52
本期利润	3,566,624.22	1,689,130.69	5,255,754.91
本期基金份额交易产生的变动数	-151,935.30	189,726.30	37,791.00
其中：基金申购款	-111,030.26	317,931.67	206,901.41
基金赎回款	-40,905.04	-128,205.37	-169,110.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,510,018.91	1,561,073.52	6,071,092.43

## 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	118,767.61
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	30,205.41
其他	4,848.06
合计	153,821.08

## 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	2,511,924,796.17
减：卖出股票成本总额	2,497,208,823.28
买卖股票差价收入	14,715,972.89

## 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	109,343,913.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	106,041,115.55
减：应收利息总额	2,665,151.93
买卖债券差价收入	637,645.84

#### 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	425,717.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	425,717.07

#### 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	4,150,431.99
——股票投资	4,863,816.44
——债券投资	-713,384.45
——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	4,150,431.99

#### 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	81,554.37
基金合同生效前利息收入	-
其他	-
合计	81,554.37

#### 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	7,721,445.69
银行间市场交易费用	1,462.50
合计	7,722,908.19

#### 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	55,196.96
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	16,079.18
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	239,056.08

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)	基金托管人
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年6月26日（基金合同 生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	906,099.90	18,743.79
其中：支付销售机构的客户维护费	4,288.93	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年6月26日（基金合同 生效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	169,893.72	3,514.46

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	合计
易方达基金管理有限 公司	-	62,885.51	62,885.51
中国农业银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	62,885.51	62,885.51
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2015年6月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E	合计
易方达基金管理有限 公司	-	1,176.52	1,176.52
中国农业银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	1,176.52	1,176.52

注：本基金 I 类基金份额不收取销售服务费，E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，按前一日 E 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 E 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 E 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
期初持有的基金份额	158,645,384.75	61,148,860.70
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	80,000,000.00	-
期末持有的基金份额	78,645,384.75	61,148,860.70
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	90.38%	94.36%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 6.4.10.4.2 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

##### 易方达瑞享混合 I

无。

##### 易方达瑞享混合 E

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年6月26日（基金合同生效 日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	9,899,886.47	118,767.61	213,801,701. 29	17,104.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券	002790	瑞尔特	新股网下 发行	1,889	31,319.62
广发证券	300518	盛讯达	新股网下 发行	722	16,042.84
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
上年度可比期间 2015年6月26日（基金合同生效日）至2015年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 易方达瑞享混合 I

本报告期内未发生利润分配。

##### 易方达瑞享混合 E

本报告期内未发生利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股流通受限	12.98	12.98	1,205	15,640.90	15,640.90	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股流通受限	8.49	8.49	1,365	11,588.85	11,588.85	-

##### 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
000639	西王食品	2016-05-27	重大事项停牌	14.12	-	-	150,000	2,170,833.85	2,118,000.00	-
002127	南极电商	2016-05-16	重大事项停牌	9.63	-	-	400,000	3,820,605.23	3,852,000.00	-

00245 2	长高集团	2016-06 -14	重大事项停牌	12.02	2016-0 7-12	10.82	279,500	3,445,143.00	3,359,590.00	-
00256 7	唐人神	2016-05 -16	重大事项停牌	13.98	2016-0 7-29	13.23	300,000	3,973,478.48	4,194,000.00	-
30006 1	康耐特	2016-05 -05	重大事项停牌	28.84	2016-0 7-21	31.56	100,000	2,881,642.00	2,884,000.00	-
30012 5	易世达	2016-03 -28	重大事项停牌	24.81	2016-0 8-08	24.22	50,000	1,139,136.00	1,240,500.00	-
30028 2	汇冠股份	2016-04 -22	重大事项停牌	35.25	2016-0 7-26	36.78	35,000	1,251,860.98	1,233,750.00	-
60161 1	中国核建	2016-06 -30	重大事项停牌	20.92	2016-0 7-01	23.01	4,790	16,621.30	100,206.80	-

#### 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。

##### 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：21.76%)。

##### 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	41,027,755.19
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	25,585,027.58
合计	0.00	66,612,782.77

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 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	42,603,147.54
合计	0.00	42,603,147.54

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于投资品种流动性不足，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	9,899,886.47	-	-	-	9,899,886.47
结算备付金	2,343,484.77	-	-	-	2,343,484.77
存出保证金	692,553.10	-	-	-	692,553.10
交易性金融资产	-	-	-	159,400,900.45	159,400,900.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	13,994,971.04	13,994,971.04
应收利息	-	-	-	4,201.59	4,201.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,559,630.34	2,559,630.34
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,935,924.34	-	-	175,959,703.42	188,895,627.76
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	-	-	-	118,064.77	118,064.77
应付管理人报酬	-	-	-	115,180.45	115,180.45
应付托管费	-	-	-	21,596.34	21,596.34
应付销售服务费	-	-	-	11,385.31	11,385.31
应付交易费用	-	-	-	2,092,330.89	2,092,330.89
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	204,490.95	204,490.95
负债总计	-	-	-	2,563,048.71	2,563,048.71
利率敏感度缺口	12,935,924.34	-	-	173,396,654.71	186,332,579.05

					5
上年度末 2015 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	14,552,603.22	-	-	-	14,552,603.22
结算备付金	1,493,535.23	-	-	-	1,493,535.23
存出保证金	76,355.05	-	-	-	76,355.05
交易性金融资产	65,398,500.00	41,356,000.00	-	55,431,810.00	162,186,310.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	78,400,237.60	-	-	-	78,400,237.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,477,715.27	2,477,715.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	73,641.17	73,641.17
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	159,921,231.10	41,356,000.00	-	57,983,166.44	259,260,397.54
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	-	-	-	33,707.77	33,707.77
应付管理人报酬	-	-	-	156,741.43	156,741.43
应付托管费	-	-	-	29,389.02	29,389.02
应付销售服务费	-	-	-	5,894.66	5,894.66
应付交易费用	-	-	-	193,035.31	193,035.31
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	181,510.54	181,510.54
负债总计	-	-	-	600,278.73	600,278.73

利率敏感度缺口	159,921,231.10	41,356,000.00	-	57,382,887.71	258,660,118.81
---------	----------------	---------------	---	---------------	----------------

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

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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	-	275,460.28
2.市场利率上升25个基点	-	-273,638.89	

注：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	159,400,900.45	85.55	55,431,810.00	21.43



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	159,400,900.45	85.55	55,431,810.00	21.43

#### 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%	9,509,129.03	2,486,263.55
	2.业绩比较基准下降5%	-9,509,129.03	-2,486,263.55

注：股票投资部分业绩基准取上证 A 指。

#### 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 140,418,853.65 元，属于第二层次的余额为 18,982,046.80 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 55,431,810.00 元，第二层次 106,754,500.00 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	159,400,900.45	84.39
	其中：股票	159,400,900.45	84.39
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	12,243,371.24	6.48
7	其他各项资产	17,251,356.07	9.13
8	合计	188,895,627.76	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	9,536,500.00	5.12
C	制造业	93,851,494.51	50.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	100,206.80	0.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,730,000.00	5.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,045,073.04	11.29
J	金融业	14,585,000.00	7.83
K	房地产业	4,440,000.00	2.38
L	租赁和商务服务业	3,852,000.00	2.07
M	科学研究和技术服务业	1,260,626.10	0.68
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	159,400,900.45	85.55

## 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	300383	光环新网	300,000	11,370,000.00	6.10
2	000783	长江证券	700,000	8,120,000.00	4.36
3	603799	华友钴业	200,000	7,440,000.00	3.99
4	300350	华鹏飞	200,000	7,140,000.00	3.83

5	002673	西部证券	250,000	6,465,000.00	3.47
6	300340	科恒股份	80,000	6,338,400.00	3.40
7	000911	南宁糖业	250,000	6,270,000.00	3.36
8	603766	隆鑫通用	300,000	6,066,000.00	3.26
9	002103	广博股份	300,000	6,063,000.00	3.25
10	300468	四方精创	79,912	6,046,941.04	3.25
11	600303	曙光股份	400,000	5,940,000.00	3.19
12	600547	山东黄金	150,000	5,836,500.00	3.13
13	002530	丰东股份	200,000	5,660,000.00	3.04
14	300016	北陆药业	200,000	4,570,000.00	2.45
15	002286	保龄宝	300,000	4,494,000.00	2.41
16	002077	大港股份	200,000	4,440,000.00	2.38
17	600990	四创电子	50,000	4,334,500.00	2.33
18	002567	唐人神	300,000	4,194,000.00	2.25
19	002127	南极电商	400,000	3,852,000.00	2.07
20	002177	御银股份	380,000	3,743,000.00	2.01
21	600711	盛屯矿业	500,000	3,700,000.00	1.99
22	300013	新宁物流	200,000	3,590,000.00	1.93
23	300025	华星创业	250,000	3,585,000.00	1.92
24	600702	沱牌舍得	140,000	3,533,600.00	1.90
25	002025	航天电器	140,000	3,456,600.00	1.86
26	002452	长高集团	279,500	3,359,590.00	1.80
27	600076	康欣新材	200,000	3,030,000.00	1.63
28	002733	雄韬股份	100,000	2,945,000.00	1.58
29	300061	康耐特	100,000	2,884,000.00	1.55
30	300449	汉邦高科	50,000	2,857,000.00	1.53
31	000059	华锦股份	300,000	2,790,000.00	1.50
32	000639	西王食品	150,000	2,118,000.00	1.14
33	300125	易世达	50,000	1,240,500.00	0.67
34	300282	汇冠股份	35,000	1,233,750.00	0.66
35	603737	三棵树	911	105,748.88	0.06
36	300516	久之洋	589	103,175.13	0.06
37	601611	中国核建	4,790	100,206.80	0.05
38	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
39	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.03
40	601127	小康股份	2,405	57,407.35	0.03
41	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.03
42	300518	盛讯达	722	33,825.70	0.02
43	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
44	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
45	603958	哈森股份	1,382	20,039.00	0.01
46	601966	玲珑轮胎	1,205	15,640.90	0.01
47	603016	新宏泰	1,365	11,588.85	0.01
48	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00

49	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	300383	光环新网	80,654,890.11	31.18
2	300359	全通教育	57,660,663.15	22.29
3	002668	奥马电器	53,647,876.81	20.74
4	300327	中颖电子	52,500,463.75	20.30
5	300033	同花顺	45,552,052.59	17.61
6	300409	道氏技术	37,380,272.09	14.45
7	002751	易尚展示	32,359,604.76	12.51
8	600547	山东黄金	31,812,216.64	12.30
9	000779	三毛派神	31,501,925.47	12.18
10	002153	石基信息	31,175,592.55	12.05
11	600497	驰宏锌锗	26,549,263.24	10.26
12	002292	奥飞娱乐	25,933,710.15	10.03
13	000059	华锦股份	25,716,869.00	9.94
14	002019	亿帆鑫富	25,678,187.30	9.93
15	601069	西部黄金	23,892,684.97	9.24
16	000785	武汉中商	23,476,307.50	9.08
17	002155	湖南黄金	23,232,060.78	8.98
18	002626	金达威	22,941,738.89	8.87
19	300100	双林股份	21,914,414.33	8.47
20	600160	巨化股份	21,465,698.82	8.30
21	002601	佰利联	20,748,601.92	8.02
22	002494	华斯股份	20,350,548.22	7.87
23	300007	汉威电子	20,139,955.66	7.79
24	300481	濮阳惠成	19,950,817.11	7.71
25	002368	太极股份	19,918,280.75	7.70
26	600392	盛和资源	19,842,475.00	7.67
27	603328	依顿电子	19,636,170.80	7.59
28	603799	华友钴业	19,126,792.04	7.39
29	601689	拓普集团	19,089,267.66	7.38
30	000403	ST 生化	19,014,432.43	7.35
31	300340	科恒股份	18,747,610.00	7.25
32	000568	泸州老窖	17,957,568.29	6.94
33	600988	赤峰黄金	17,823,156.74	6.89

34	002311	海大集团	17,287,961.63	6.68
35	002286	保龄宝	17,273,045.82	6.68
36	600531	豫光金铅	16,721,340.64	6.46
37	002477	雏鹰农牧	16,706,330.31	6.46
38	600756	浪潮软件	16,643,000.00	6.43
39	300113	顺网科技	16,516,922.65	6.39
40	300009	安科生物	16,420,409.50	6.35
41	002714	牧原股份	16,137,951.92	6.24
42	002466	天齐锂业	16,104,673.26	6.23
43	000890	法尔胜	15,932,104.41	6.16
44	300468	四方精创	15,751,999.74	6.09
45	300302	同有科技	15,744,222.00	6.09
46	600409	三友化工	15,544,075.11	6.01
47	600476	湘邮科技	15,452,158.65	5.97
48	600661	新南洋	15,293,064.77	5.91
49	002245	澳洋顺昌	14,962,703.00	5.78
50	002635	安洁科技	14,868,620.60	5.75
51	002582	好想你	14,568,044.11	5.63
52	002084	海鸥卫浴	14,484,709.44	5.60
53	002077	大港股份	14,207,145.00	5.49
54	300059	东方财富	13,815,405.41	5.34
55	600546	*ST 山煤	13,754,939.92	5.32
56	600348	阳泉煤业	13,698,692.08	5.30
57	300377	赢时胜	13,486,925.00	5.21
58	000687	华讯方舟	13,056,464.76	5.05
59	600975	新五丰	12,990,485.31	5.02
60	002299	圣农发展	12,850,868.00	4.97
61	300068	南都电源	12,424,838.19	4.80
62	300369	绿盟科技	12,359,860.25	4.78
63	600136	当代明诚	12,321,839.35	4.76
64	600199	金种子酒	12,242,211.58	4.73
65	000831	*ST 五稀	12,211,967.50	4.72
66	002572	索菲亚	12,028,986.75	4.65
67	002638	勤上光电	11,882,619.36	4.59
68	002175	东方网络	11,857,084.80	4.58
69	601021	春秋航空	11,756,508.25	4.55
70	300250	初灵信息	11,715,380.13	4.53
71	002370	亚太药业	11,540,209.50	4.46
72	000911	南宁糖业	11,499,016.12	4.45
73	002131	利欧股份	11,176,024.43	4.32
74	600240	华业资本	11,122,231.88	4.30
75	600111	北方稀土	10,792,761.73	4.17
76	300350	华鹏飞	10,688,940.35	4.13
77	002035	华帝股份	10,672,800.71	4.13

78	000630	铜陵有色	10,463,972.00	4.05
79	002458	益生股份	10,297,118.94	3.98
80	600682	南京新百	10,110,120.63	3.91
81	300061	康耐特	9,892,135.00	3.82
82	300017	网宿科技	9,742,263.81	3.77
83	002530	丰东股份	9,646,378.00	3.73
84	000732	泰禾集团	9,627,988.30	3.72
85	600711	盛屯矿业	9,619,416.00	3.72
86	603901	永创智能	9,603,749.00	3.71
87	002234	民和股份	9,467,781.86	3.66
88	300078	思创医惠	9,440,422.55	3.65
89	002712	思美传媒	9,420,812.00	3.64
90	300367	东方网力	9,279,421.20	3.59
91	002001	新 和 成	9,206,150.00	3.56
92	000969	安泰科技	9,174,577.00	3.55
93	002567	唐人神	9,145,044.70	3.54
94	600801	华新水泥	9,073,469.00	3.51
95	600978	宜华生活	8,959,738.76	3.46
96	603108	润达医疗	8,941,436.34	3.46
97	000892	星美联合	8,695,210.96	3.36
98	002145	中核钛白	8,662,182.64	3.35
99	601012	隆基股份	8,660,598.12	3.35
100	002228	合兴包装	8,462,565.00	3.27
101	300431	暴风集团	8,390,954.00	3.24
102	600519	贵州茅台	8,305,435.00	3.21
103	000783	长江证券	8,271,055.62	3.20
104	300098	高新兴	8,236,616.18	3.18
105	600303	曙光股份	8,082,079.58	3.12
106	300458	全志科技	8,004,225.80	3.09
107	002643	万润股份	7,991,856.84	3.09
108	000970	中科三环	7,950,490.00	3.07
109	002366	台海核电	7,949,095.72	3.07
110	600418	江淮汽车	7,802,107.50	3.02
111	000802	北京文化	7,697,325.62	2.98
112	002425	凯撒股份	7,683,857.16	2.97
113	002502	骅威文化	7,648,335.62	2.96
114	002470	金正大	7,614,227.96	2.94
115	002146	荣盛发展	7,608,308.65	2.94
116	300444	双杰电气	7,492,629.50	2.90
117	600595	中孚实业	7,484,888.60	2.89
118	002250	联化科技	7,425,022.18	2.87
119	603766	隆鑫通用	7,414,814.21	2.87
120	000833	贵糖股份	7,316,500.96	2.83
121	000573	粤宏远 A	7,129,985.95	2.76

122	600702	沱牌舍得	7,094,744.28	2.74
123	002746	仙坛股份	6,861,396.02	2.65
124	600855	航天长峰	6,837,488.40	2.64
125	600549	厦门钨业	6,788,589.00	2.62
126	002699	美盛文化	6,736,997.57	2.60
127	002127	南极电商	6,684,798.35	2.58
128	002716	金贵银业	6,614,421.11	2.56
129	603609	禾丰牧业	6,562,783.88	2.54
130	002673	西部证券	6,532,901.00	2.53
131	300267	尔康制药	6,503,921.75	2.51
132	002456	欧菲光	6,501,752.44	2.51
133	600687	刚泰控股	6,494,526.00	2.51
134	600763	通策医疗	6,370,509.00	2.46
135	300429	强力新材	6,327,698.00	2.45
136	300483	沃施股份	6,295,242.87	2.43
137	000957	中通客车	6,174,370.00	2.39
138	601336	新华保险	6,098,302.25	2.36
139	002590	万安科技	6,078,125.00	2.35
140	300121	阳谷华泰	6,074,680.50	2.35
141	603027	千禾味业	6,046,127.76	2.34
142	000550	江铃汽车	6,018,198.72	2.33
143	002103	广博股份	5,953,425.47	2.30
144	002463	沪电股份	5,887,158.05	2.28
145	300333	兆日科技	5,873,923.00	2.27
146	000639	西王食品	5,788,890.25	2.24
147	300075	数字政通	5,783,351.80	2.24
148	002325	洪涛股份	5,665,300.89	2.19
149	300160	秀强股份	5,619,832.31	2.17
150	600582	天地科技	5,496,587.00	2.13
151	000516	国际医学	5,427,420.00	2.10
152	002124	天邦股份	5,412,728.00	2.09
153	002426	胜利精密	5,403,075.70	2.09
154	000488	晨鸣纸业	5,372,863.58	2.08
155	002037	久联发展	5,371,443.13	2.08
156	002378	章源钨业	5,347,048.00	2.07
157	600216	浙江医药	5,320,494.53	2.06
158	300067	安诺其	5,301,407.00	2.05
159	300356	光一科技	5,298,407.29	2.05
160	002289	*ST 宇顺	5,293,973.00	2.05
161	600559	老白干酒	5,270,769.70	2.04
162	002100	天康生物	5,266,189.31	2.04
163	002237	恒邦股份	5,245,884.90	2.03
164	300451	创业软件	5,236,634.91	2.02
165	000545	金浦钛业	5,207,369.67	2.01



166	002461	珠江啤酒	5,173,383.25	2.00
-----	--------	------	--------------	------

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	300383	光环新网	71,743,900.54	27.74
2	300359	全通教育	59,960,881.81	23.18
3	300327	中颖电子	54,395,601.54	21.03
4	002668	奥马电器	53,241,547.56	20.58
5	300033	同花顺	44,798,734.00	17.32
6	300409	道氏技术	40,244,664.14	15.56
7	000779	三毛派神	30,780,411.10	11.90
8	002751	易尚展示	30,045,559.00	11.62
9	002153	石基信息	28,252,808.53	10.92
10	600547	山东黄金	27,752,453.07	10.73
11	002292	奥飞娱乐	27,570,861.49	10.66
12	002019	亿帆鑫富	27,435,349.76	10.61
13	600497	驰宏锌锗	26,856,947.74	10.38
14	300113	顺网科技	25,977,943.18	10.04
15	000059	华锦股份	25,252,814.41	9.76
16	002601	佰利联	24,033,052.54	9.29
17	000785	武汉中商	23,998,129.11	9.28
18	300017	网宿科技	23,664,671.38	9.15
19	300481	濮阳惠成	23,406,523.14	9.05
20	002155	湖南黄金	23,034,545.44	8.91
21	601069	西部黄金	22,706,544.64	8.78
22	600392	盛和资源	22,376,664.12	8.65
23	300100	双林股份	21,025,949.25	8.13
24	600531	豫光金铅	20,451,750.59	7.91
25	300007	汉威电子	20,332,819.31	7.86
26	601689	拓普集团	20,324,031.29	7.86
27	002626	金达威	20,170,632.42	7.80
28	002368	太极股份	20,046,406.57	7.75
29	002494	华斯股份	19,920,681.16	7.70
30	300059	东方财富	19,693,866.80	7.61
31	000403	ST 生化	19,438,189.68	7.51
32	603328	依顿电子	19,185,998.60	7.42
33	600160	巨化股份	19,123,316.00	7.39
34	600988	赤峰黄金	19,013,407.12	7.35
35	002466	天齐锂业	18,461,684.02	7.14

36	000568	泸州老窖	18,026,907.43	6.97
37	002311	海大集团	17,425,433.60	6.74
38	300009	安科生物	16,834,305.90	6.51
39	002477	雏鹰农牧	16,377,754.84	6.33
40	002572	索菲亚	16,221,695.00	6.27
41	002714	牧原股份	16,185,655.87	6.26
42	600756	浪潮软件	16,158,035.72	6.25
43	300302	同有科技	15,581,206.26	6.02
44	002635	安洁科技	15,572,164.11	6.02
45	600476	湘邮科技	15,547,288.90	6.01
46	600661	新南洋	15,232,046.35	5.89
47	600546	*ST 山煤	14,874,967.59	5.75
48	600409	三友化工	14,848,148.93	5.74
49	002245	澳洋顺昌	14,814,727.61	5.73
50	000890	法尔胜	14,795,937.68	5.72
51	300340	科恒股份	14,070,320.18	5.44
52	002582	好想你	13,991,594.21	5.41
53	600348	阳泉煤业	13,967,804.47	5.40
54	002084	海鸥卫浴	13,924,326.56	5.38
55	300068	南都电源	13,872,483.09	5.36
56	300377	赢时胜	13,661,620.42	5.28
57	600136	当代明诚	13,202,311.00	5.10
58	002638	勤上光电	13,051,516.50	5.05
59	000687	华讯方舟	13,006,402.48	5.03
60	600975	新五丰	12,824,965.63	4.96
61	002299	圣农发展	12,368,855.61	4.78
62	603799	华友钴业	12,314,147.41	4.76
63	600199	金种子酒	12,256,434.63	4.74
64	002286	保龄宝	12,249,687.25	4.74
65	300369	绿盟科技	12,042,935.00	4.66
66	600682	南京新百	11,733,262.55	4.54
67	002131	利欧股份	11,696,246.28	4.52
68	002370	亚太药业	11,589,172.50	4.48
69	300250	初灵信息	11,522,305.92	4.45
70	000831	*ST 五稀	11,300,786.00	4.37
71	601021	春秋航空	11,226,132.56	4.34
72	600240	华业资本	11,162,347.26	4.32
73	002035	华帝股份	10,973,068.48	4.24
74	600111	北方稀土	10,908,176.48	4.22
75	600562	国睿科技	10,766,893.32	4.16
76	002458	益生股份	10,585,900.20	4.09
77	000969	安泰科技	10,432,075.15	4.03
78	300078	思创医惠	10,149,741.27	3.92
79	002175	东方网络	10,084,396.76	3.90

80	000630	铜陵有色	10,010,264.00	3.87
81	300367	东方网力	9,961,535.70	3.85
82	002145	中核钛白	9,941,859.28	3.84
83	002077	大港股份	9,935,320.17	3.84
84	300207	欣旺达	9,812,390.95	3.79
85	300458	全志科技	9,752,801.06	3.77
86	002001	新 和 成	9,552,722.00	3.69
87	300468	四方精创	9,195,967.00	3.56
88	000892	星美联合	9,192,623.02	3.55
89	002234	民和股份	9,112,688.35	3.52
90	603108	润达医疗	9,058,612.70	3.50
91	300098	高新兴	8,900,405.89	3.44
92	000732	泰禾集团	8,789,407.40	3.40
93	600519	贵州茅台	8,749,618.52	3.38
94	603901	永创智能	8,716,592.90	3.37
95	002712	思美传媒	8,689,908.20	3.36
96	002643	万润股份	8,614,020.03	3.33
97	600801	华新水泥	8,331,091.62	3.22
98	002366	台海核电	8,325,245.45	3.22
99	601012	隆基股份	8,290,474.00	3.21
100	002228	合兴包装	8,267,911.21	3.20
101	002146	荣盛发展	8,219,264.96	3.18
102	600978	宜华生活	8,190,342.48	3.17
103	300444	双杰电气	8,047,563.00	3.11
104	000970	中科三环	7,954,379.49	3.08
105	300061	康耐特	7,772,997.45	3.01
106	002470	金正大	7,677,734.00	2.97
107	000573	粤宏远 A	7,538,293.00	2.91
108	000833	贵糖股份	7,522,387.69	2.91
109	002250	联化科技	7,375,718.90	2.85
110	002716	金贵银业	7,357,293.40	2.84
111	600418	江淮汽车	7,348,921.58	2.84
112	600595	中孚实业	7,322,747.69	2.83
113	000802	北京文化	7,309,020.31	2.83
114	002425	凯撒股份	7,286,906.00	2.82
115	002456	欧菲光	6,984,199.25	2.70
116	300431	暴风集团	6,965,867.20	2.69
117	002590	万安科技	6,856,466.20	2.65
118	002502	骅威文化	6,774,699.00	2.62
119	600763	通策医疗	6,701,958.94	2.59
120	300429	强力新材	6,693,432.46	2.59
121	002699	美盛文化	6,644,358.65	2.57
122	603609	禾丰牧业	6,642,864.00	2.57
123	600549	厦门钨业	6,642,807.00	2.57

124	600687	刚泰控股	6,441,852.35	2.49
125	300075	数字政通	6,330,842.60	2.45
126	002746	仙坛股份	6,314,886.36	2.44
127	600855	航天长峰	6,270,768.95	2.42
128	300267	尔康制药	6,134,754.34	2.37
129	000550	江铃汽车	6,057,822.65	2.34
130	300356	光一科技	6,031,531.60	2.33
131	603027	千禾味业	6,004,259.05	2.32
132	000957	中通客车	5,998,127.00	2.32
133	000488	晨鸣纸业	5,882,897.76	2.27
134	002325	洪涛股份	5,851,120.07	2.26
135	603369	今世缘	5,753,767.64	2.22
136	601336	新华保险	5,739,475.04	2.22
137	300121	阳谷华泰	5,732,744.92	2.22
138	002463	沪电股份	5,719,243.14	2.21
139	600711	盛屯矿业	5,678,498.50	2.20
140	002560	通达股份	5,639,973.32	2.18
141	600582	天地科技	5,549,659.22	2.15
142	300451	创业软件	5,540,221.00	2.14
143	300483	沃施股份	5,454,869.45	2.11
144	002567	唐人神	5,440,390.00	2.10
145	300160	秀强股份	5,438,936.45	2.10
146	002124	天邦股份	5,431,460.48	2.10
147	300333	兆日科技	5,419,299.75	2.10
148	002100	天康生物	5,403,034.61	2.09
149	000516	国际医学	5,388,122.68	2.08
150	000807	云铝股份	5,307,813.80	2.05
151	000545	金浦钛业	5,262,918.86	2.03
152	603268	松发股份	5,247,216.67	2.03
153	002461	珠江啤酒	5,192,117.45	2.01

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	2,596,314,097.29
卖出股票收入（成交）总额	2,511,924,796.17

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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	692,553.10
2	应收证券清算款	13,994,971.04
3	应收股利	-

4	应收利息	4,201.59
5	应收申购款	2,559,630.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,251,356.07

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
易方达瑞享混合 I	689	126,295.31	78,645,384.75	90.38%	8,372,086.34	9.62%
易方达瑞享混合 E	367	176,581.24	61,148,860.70	94.36%	3,656,453.31	5.64%
合计	1,056	143,771.58	139,794,245.45	92.08%	12,028,539.65	7.92%

#### 8.2 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	易方达瑞享混合 I	2,339,908.78	2.6890%
	易方达瑞享混合 E	6,300.00	0.0097%
	合计	2,346,208.78	1.5454%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	易方达瑞享混合 I	0
	易方达瑞享混合 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达瑞享混合 I	0
	易方达瑞享混合 E	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日）基金份额总额	160,122,734.71	53,678,966.58
本报告期期初基金份额总额	159,812,608.87	61,771,378.16
本报告期基金总申购份额	10,889,831.56	14,180,232.79
减：本报告期基金总赎回份额	83,684,969.34	11,146,296.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	87,017,471.09	64,805,314.01

## §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	
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	3,790,667,966.86	74.22%	3,530,255.08	74.22%	-
兴业证券	1	1,316,659,911.99	25.78%	1,226,205.66	25.78%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；



3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息; 能根据基金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
3	易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-23
4	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
5	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
6	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏赛福天钢索股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-25
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
8	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
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
10	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易	中国证券报、上海证券	2016-04-30

	方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
11	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
12	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
13	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
14	易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-31
15	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
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鑫鼎盛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	2016-06-20
17	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

## §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瑞享灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达瑞享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。

### 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