

易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基 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.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	14
7 投资组合报告.....	28
7.1 期末基金资产组合情况.....	28
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12	投资组合报告附注	37
8	基金份额持有人信息	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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	39
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	39
9	开放式基金份额变动	39
10	重大事件揭示	40
10.1	基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4	基金投资策略的改变	40
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8	其他重大事件	42
11	备查文件目录	43
11.1	备查文件目录	43
11.2	存放地点	43
11.3	查阅方式	43

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	易方达瑞惠混合发起式
基金主代码	001769
交易代码	001769
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 31 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	40,010,000,000.00 份
基金合同存续期	不定期

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、债券等资产类别的配置比例。在综合考虑宏观经济走势、市场估值水平、流动性及国家宏观和产业政策的基础上，深入分析行业景气度和竞争格局，重点投资于经营稳健、盈利能力较强或具有较好的盈利预期、财务风险较小、公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范及具有清晰长期愿景的公司，力争发掘出价值被低估或估值合理的股票。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
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	北京市东城区建国门内大街69

	号4004-8室	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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
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）
本期已实现收益	1,609,839,483.19
本期利润	-4,327,406,574.87
加权平均基金份额本期利润	-0.1833
本期加权平均净值利润率	-16.66%
本期基金份额净值增长率	-5.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	5,072,597,409.92
期末可供分配基金份额利润	0.1268
期末基金资产净值	45,082,597,409.92
期末基金份额净值	1.127
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.70%

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

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除

相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

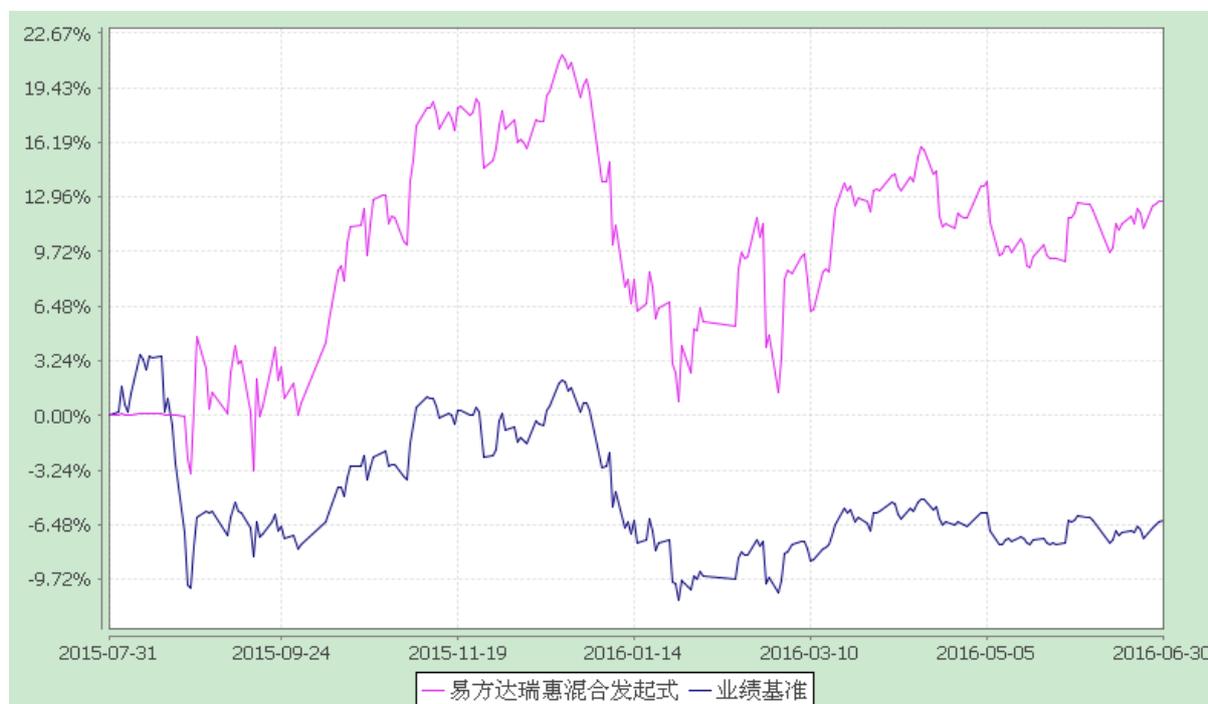
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.90%	0.75%	-0.09%	0.49%	0.99%	0.26%
过去三个月	-0.62%	0.83%	-0.66%	0.50%	0.04%	0.33%
过去六个月	-5.37%	1.48%	-6.72%	0.92%	1.35%	0.56%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.70%	1.49%	-6.24%	1.04%	18.94%	0.45%

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

易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金

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7月31日至2016年6月30日)



注：1. 本基金合同于 2015 年 7 月 31 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 12.70%，同期业绩比较基准收益率为 -6.24%。

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、易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自 2015 年 06 月 26 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基金的基金经理(自 2015 年 01 月 14 日至 2016 年 05 月 30 日)	2015-07-31	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。
肖林	本基金的基金经理	2016-05-31	-	8 年	本科学士，曾任易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、运作支持专

					员，研究部研究员。
--	--	--	--	--	-----------

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，肖林的“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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 16 次，其中 13 次为指数及量化投资因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；3 次为不同基金经理管理的非指数基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，A 股经历了一、二月份的快速下跌以及后 4 个月的振荡调整，主要指数全线下跌。上证综指、深证成指、沪深 300 指数、中小板指和创业板指分别下跌 17.22%、17.17%、15.47%、

17.88%和 17.92%。板块方面，上半年中信行业指数几乎全面下跌，仅食品饮料指数上涨，家电、有色金属、煤炭和银行指数表现相对较好，而传媒、计算机、商贸零售、餐饮旅游、交通运输指数则下跌较多。

在 2016 年上半年的投资过程中，在高度不确定的市场环境下，本基金延续了稳健的投资风格和逆向操作、价值投资的策略，注重公司的盈利能力和投资价值，选择具备持续竞争优势、管理优秀、盈利能力强、估值合理的公司构建投资组合。

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 1.127 元，本报告期份额净值增长率为-5.37%，同期业绩比较基准收益率为-6.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年，宏观经济环境或将有所改善，经济增长预计将企稳回升。货币政策方面，考虑到之前多次降息、降准，伴随着美国的加息预期以及人民币汇率波动，货币政策大概率将趋向稳健。同时，预计财政政策将继续加码，政策效果会逐渐体现到实体经济中。

在此背景下，本基金计划采取攻守均衡的投资策略，精选优质行业和公司来获取超额收益，继续寻找并配置具备中长期持续竞争优势、业绩较好、管理优秀、估值合理和低估的龙头公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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：易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	20,929,127,110.93	7,851,028,707.31
结算备付金		-	-
存出保证金		4,250,594.67	45,288,274.33
交易性金融资产	6.4.7.2	10,913,623,837.79	27,204,231,765.95
其中：股票投资		10,913,623,837.79	27,204,231,765.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	13,226,734,022.32	12,551,858,057.75
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	9,831,337.17	13,554,061.10
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		45,083,566,902.88	47,665,960,866.44
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		-	-
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		747,564.66	2,008,679.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	23,022.32	28,202.25
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	198,905.98	120,000.00
负债合计		969,492.96	2,156,881.64
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	40,010,000,000.00	40,010,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	5,072,597,409.92	7,653,803,984.80

所有者权益合计		45,082,597,409.92	47,663,803,984.80
负债和所有者权益总计		45,083,566,902.88	47,665,960,866.44

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

2.报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.127 元，基金份额总额 40,010,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金

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
一、收入		-4,307,976,685.38
1.利息收入		104,808,726.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	77,941,490.72
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		26,867,235.73
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,441,307,646.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,337,538,942.77
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	103,768,703.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,937,246,058.06
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	83,153,000.00
减：二、费用		19,429,889.49
1. 管理人报酬		-
2. 托管费		6,414,330.92
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	12,792,903.98
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	222,654.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,327,406,574.87

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,327,406,574.87

注：本基金合同生效日为 2015 年 7 月 31 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金

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）	40,010,000,000.00	7,653,803,984.80	47,663,803,984.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,327,406,574.87	-4,327,406,574.87
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）	-	1,746,199,999.99	1,746,199,999.99
其中：1.基金申购款	-	5,471,599,999.99	5,471,599,999.99
2.基金赎回款	-	-3,725,400,000.00	-3,725,400,000.00
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）	40,010,000,000.00	5,072,597,409.92	45,082,597,409.92

注：本基金合同生效日为 2015 年 7 月 31 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金(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] 1796 号《关于准予易方达瑞惠灵活配置混合型发起式

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《易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 40,010,000,000.00 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》、《易方达瑞惠灵活配置混合型发起式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	2,559,127,110.93
定期存款	18,370,000,000.00
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	18,370,000,000.00
其他存款	-
合计	20,929,127,110.93

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	12,237,005,007.35	10,913,623,837.79	-1,323,381,169.56
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	12,237,005,007.35	10,913,623,837.79	-1,323,381,169.56

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**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	13,226,734,022.32	-
合计	13,226,734,022.32	-

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	4,109,737.19
应收定期存款利息	3,218,944.44
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	2,500,742.84
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,912.70
合计	9,831,337.17

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	-
银行间市场应付交易费用	23,022.32
合计	23,022.32

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	-
预提费用	198,905.98
合计	198,905.98

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,010,000,000.00	40,010,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	40,010,000,000.00	40,010,000,000.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,039,939,096.30	4,613,864,888.50	7,653,803,984.80
本期利润	1,609,839,483.19	-5,937,246,058.06	-4,327,406,574.87
本期基金份额交易产生的变动数	1,849,388,373.03	-103,188,373.04	1,746,199,999.99
其中：基金申购款	6,235,225,364.98	-763,625,364.99	5,471,599,999.99
基金赎回款	-4,385,836,991.95	660,436,991.95	-3,725,400,000.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,499,166,952.52	-1,426,569,542.60	5,072,597,409.92

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	65,802,758.26
定期存款利息收入	11,912,194.43
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	226,538.03
合计	77,941,490.72

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	11,750,516,916.81
减：卖出股票成本总额	10,412,977,974.04
买卖股票差价收入	1,337,538,942.77

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	103,768,703.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	103,768,703.46

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	-5,937,246,058.06
——股票投资	-5,937,246,058.06
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-5,937,246,058.06

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	83,153,000.00
基金合同生效前利息收入	-
其他	-
合计	83,153,000.00

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	12,792,903.98
银行间市场交易费用	-
合计	12,792,903.98

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	49,726.04
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	9,948.61
银行间账户维护费	13,500.00
其他	300.00
合计	222,654.59

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、基金发起人
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

本基金不收取管理费。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	6,414,330.92	

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
期初持有的基金份额	10,000,000.00	
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	-	
期末持有的基金份额	10,000,000.00	
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.025%	

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

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,559,127,110.93	65,802,758.26

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

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

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

本基金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**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
000002	万科A	2015-12-21	重大事项停牌	18.20	2016-07-04	21.99	13,795,977	181,716,737.56	251,086,781.40	-
000629	*ST钒钛	2016-05-26	重大事项停牌	2.39	-	-	525,300	1,771,606.65	1,255,467.00	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项停牌	22.07	-	-	19,408,177	329,535,747.39	428,338,466.39	-
002065	东华软件	2015-12-22	重大事项停牌	18.72	2016-07-04	22.59	582,927	9,993,307.69	10,912,393.44	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	8.29	-	-	91,205	1,008,499.29	756,089.45	-
002249	大洋电机	2016-06-08	重大事项停牌	11.97	2016-07-28	10.77	9,425,203	107,541,566.23	112,819,679.91	-
002663	普邦园林	2016-04-28	重大事项停牌	7.36	-	-	6,959,920	49,137,035.20	51,225,011.20	-
002672	东江环保	2016-05-23	重大事项停牌	17.33	2016-07-15	19.06	51,109	841,765.23	885,718.97	-
600005	武钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	2.76	-	-	22,870,568	97,829,092.61	63,122,767.68	-
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	4.90	-	-	6,042,465	35,327,159.94	29,608,078.50	-
600166	福田汽车	2016-06-30	重大事项停牌	5.52	2016-07-01	5.62	3,725,833	22,041,810.36	20,566,598.16	-
600511	国药股份	2016-02-18	重大事项停牌	27.42	2016-08-04	30.16	3,898,350	124,789,060.85	106,892,757.00	-
600675	*ST中企	2016-06-24	重大事项停牌	5.05	-	-	4,772,754	33,075,185.22	24,102,407.70	-

601168	西部矿业	2016-02-01	重大事项停牌	5.93	2016-07-22	6.52	3,927,285	25,535,289.80	23,288,800.05	-
--------	------	------------	--------	------	------------	------	-----------	---------------	---------------	---

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：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00

A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自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	20,929,127,110.93	-	-	-	20,929,127,110.93

					0.93
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	4,250,594.67	-	-	-	4,250,594.67
交易性金融资产	-	-	-	10,913,623,837.79	10,913,623,837.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	13,226,734,022.32	-	-	-	13,226,734,022.32
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,831,337.17	9,831,337.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	34,160,111,727.92	-	-	10,923,455,174.96	45,083,566,902.88
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	747,564.66	747,564.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	23,022.32	23,022.32
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	198,905.98	198,905.98
负债总计	-	-	-	969,492.96	969,492.96
利率敏感度缺口	34,160,111,727.92	-	-	10,922,485,682.00	45,082,597,409.92
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	7,851,028,707.31	-	-	-	7,851,028,707.31
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	45,288,274.33	-	-	-	45,288,274.33
交易性金融资产	-	-	-	27,204,231,765.95	27,204,231,765.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	12,551,858,057.75	-	-	-	12,551,858,057.75
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	13,554,061.10	13,554,061.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,448,175,039.39	-	-	27,217,785,827.05	47,665,960,866.44
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	2,008,679.39	2,008,679.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	28,202.25	28,202.25
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	120,000.00	120,000.00
负债总计	-	-	-	2,156,881.64	2,156,881.64
利率敏感度缺口	20,448,175,039.39	-	-	27,215,628,945.41	47,663,803,984.80

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	10,913,623,837.79	24.21	27,204,231,765.95	57.08
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	10,913,623,837.79	24.21	27,204,231,765.95	57.08

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%	1,204,346,896.92	2,862,490,480.97

	2.业绩比较基准下降 5%	-1,204,346,896.92	-2,862,490,480.97
--	---------------	-------------------	-------------------

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 9,788,762,820.94 元，属于第二层次的余额为 1,124,861,016.85 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 25,222,119,887.04 元，第二层次 1,982,111,878.91 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	10,913,623,837.79	24.21
	其中：股票	10,913,623,837.79	24.21
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	13,226,734,022.32	29.34
	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	20,929,127,110.93	46.42
7	其他各项资产	14,081,931.84	0.03
8	合计	45,083,566,902.88	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	137,385,040.78	0.30
B	采矿业	328,997,262.94	0.73
C	制造业	4,741,857,276.00	10.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	763,479,670.51	1.69
E	建筑业	805,463,479.61	1.79
F	批发和零售业	661,033,181.63	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	532,023,105.29	1.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	534,761,934.22	1.19
J	金融业	1,440,384,295.28	3.19
K	房地产业	631,197,641.47	1.40
L	租赁和商务服务业	23,400,312.27	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	87,722,185.02	0.19
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	136,385,744.97	0.30
S	综合	89,532,707.80	0.20
	合计	10,913,623,837.79	24.21

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	000651	格力电器	19,408,177	428,338,466.39	0.95
2	000002	万科A	13,795,977	251,086,781.40	0.56
3	600887	伊利股份	14,006,947	233,495,806.49	0.52
4	601988	中国银行	69,720,034	223,801,309.14	0.50
5	601398	工商银行	49,783,999	221,040,955.56	0.49
6	000661	长春高新	1,952,842	208,329,184.56	0.46
7	601328	交通银行	36,136,859	203,450,516.17	0.45
8	600122	宏图高科	14,143,900	189,245,382.00	0.42
9	600572	康恩贝	25,815,798	167,286,371.04	0.37
10	601668	中国建筑	30,705,621	163,353,903.72	0.36
11	000998	隆平高科	7,238,411	137,385,040.78	0.30
12	600335	国机汽车	12,095,400	135,589,434.00	0.30
13	600056	中国医药	8,050,346	127,678,487.56	0.28
14	601939	建设银行	26,831,626	127,450,223.50	0.28
15	601899	紫金矿业	37,629,330	126,810,842.10	0.28
16	600037	歌华有线	8,162,500	124,151,625.00	0.28
17	601998	中信银行	21,516,935	122,001,021.45	0.27
18	600015	华夏银行	12,041,571	119,091,137.19	0.26
19	600252	中恒集团	27,100,200	117,614,868.00	0.26
20	600795	国电电力	39,470,295	115,647,964.35	0.26
21	600690	青岛海尔	12,976,244	115,229,046.72	0.26
22	300147	香雪制药	7,816,244	115,133,274.12	0.26
23	300039	上海凯宝	11,173,707	113,636,600.19	0.25
24	002249	大洋电机	9,425,203	112,819,679.91	0.25
25	600703	三安光电	5,630,835	112,447,774.95	0.25
26	300124	汇川技术	5,763,648	111,814,771.20	0.25
27	600332	白云山	4,531,993	111,668,307.52	0.25
28	600143	金发科技	17,316,644	111,519,187.36	0.25
29	601628	中国人寿	5,316,805	110,695,880.10	0.25
30	000063	中兴通讯	7,705,674	110,499,365.16	0.25
31	000001	平安银行	12,689,060	110,394,822.00	0.24
32	000006	深振业A	14,598,400	107,590,208.00	0.24

33	600511	国药股份	3,898,350	106,892,757.00	0.24
34	600831	广电网络	8,226,200	106,611,552.00	0.24
35	000166	申万宏源	12,557,997	105,612,754.77	0.23
36	002271	东方雨虹	6,099,339	105,091,610.97	0.23
37	300115	长盈精密	5,063,096	104,299,777.60	0.23
38	600011	华能国际	13,455,594	101,186,066.88	0.22
39	600125	铁龙物流	15,328,200	97,640,634.00	0.22
40	600426	华鲁恒升	10,973,240	96,674,244.40	0.21
41	600089	特变电工	11,234,421	95,717,266.92	0.21
42	600674	川投能源	11,508,105	95,056,947.30	0.21
43	002063	远光软件	6,129,043	94,693,714.35	0.21
44	000690	宝新能源	13,761,427	93,302,475.06	0.21
45	002022	科华生物	4,315,400	91,961,174.00	0.20
46	000039	中集集团	6,445,964	91,339,309.88	0.20
47	600068	葛洲坝	15,172,595	88,304,502.90	0.20
48	601088	中国神华	6,237,081	87,755,729.67	0.19
49	600029	南方航空	12,279,826	86,695,571.56	0.19
50	601006	大秦铁路	13,195,901	84,981,602.44	0.19
51	000538	云南白药	1,276,106	82,053,615.80	0.18
52	601186	中国铁建	8,154,947	81,223,272.12	0.18
53	600315	上海家化	2,813,255	81,134,274.20	0.18
54	002375	亚厦股份	7,011,792	79,233,249.60	0.18
55	000793	华闻传媒	8,004,907	79,088,481.16	0.18
56	000069	华侨城 A	12,331,825	78,923,680.00	0.18
57	000090	天健集团	8,825,015	77,660,132.00	0.17
58	601669	中国电建	13,228,916	75,537,110.36	0.17
59	002309	中利科技	4,169,200	74,670,372.00	0.17
60	002251	步步高	5,641,200	73,166,364.00	0.16
61	002390	信邦制药	7,902,229	73,016,595.96	0.16
62	600500	中化国际	8,059,193	72,855,104.72	0.16
63	600115	东方航空	10,928,900	72,240,029.00	0.16
64	600196	复星医药	3,694,558	70,270,493.16	0.16
65	600588	用友网络	3,577,000	70,037,660.00	0.16
66	600597	光明乳业	5,340,799	67,721,331.32	0.15
67	600583	海油工程	9,669,163	66,813,916.33	0.15
68	000572	海马汽车	12,696,328	65,893,942.32	0.15
69	600256	广汇能源	15,841,684	64,950,904.40	0.14
70	000030	富奥股份	9,038,200	64,803,894.00	0.14
71	600005	武钢股份	22,870,568	63,122,767.68	0.14
72	600221	海南航空	19,762,781	62,648,015.77	0.14
73	600309	万华化学	3,551,472	61,440,465.60	0.14
74	000338	潍柴动力	7,841,122	61,239,162.82	0.14
75	600522	中天科技	6,191,265	60,674,397.00	0.13
76	600376	首开股份	5,394,577	59,987,696.24	0.13

77	000100	TCL 集团	18,196,800	59,867,472.00	0.13
78	002646	青青稞酒	2,896,732	59,701,646.52	0.13
79	601607	上海医药	3,300,257	59,569,638.85	0.13
80	601800	中国交建	5,457,533	57,467,822.49	0.13
81	601111	中国国航	8,055,454	54,454,869.04	0.12
82	002410	广联达	3,620,413	51,771,905.90	0.11
83	600835	上海机电	2,685,115	51,527,356.85	0.11
84	000800	一汽轿车	4,717,800	51,329,664.00	0.11
85	002663	普邦园林	6,959,920	51,225,011.20	0.11
86	601818	光大银行	13,597,275	51,125,754.00	0.11
87	002038	双鹭药业	1,648,947	49,765,220.46	0.11
88	600496	精工钢构	11,519,756	49,074,160.56	0.11
89	002250	联化科技	3,379,182	48,389,886.24	0.11
90	600657	信达地产	9,403,809	46,830,968.82	0.10
91	000997	新大陆	2,320,017	46,493,140.68	0.10
92	000963	华东医药	659,467	44,448,075.80	0.10
93	600270	外运发展	2,516,509	44,013,742.41	0.10
94	600642	申能股份	7,511,340	43,115,091.60	0.10
95	600208	新潮中宝	9,738,036	41,191,892.28	0.09
96	300043	互动娱乐	2,886,260	40,898,304.20	0.09
97	600617	国新能源	3,512,526	40,253,547.96	0.09
98	601991	大唐发电	9,755,819	37,950,135.91	0.08
99	000581	威孚高科	1,844,900	37,193,184.00	0.08
100	000883	湖北能源	7,943,426	36,778,062.38	0.08
101	600271	航天信息	1,537,486	36,592,166.80	0.08
102	600195	中牧股份	1,956,796	35,809,366.80	0.08
103	600027	华电国际	7,186,047	35,570,932.65	0.08
104	601117	中国化学	6,431,498	35,566,183.94	0.08
105	002146	荣盛发展	5,271,025	35,421,288.00	0.08
106	600578	京能电力	8,118,192	34,745,861.76	0.08
107	002327	富安娜	3,931,208	33,454,580.08	0.07
108	601258	庞大集团	11,986,731	32,963,510.25	0.07
109	000999	华润三九	1,356,450	32,853,219.00	0.07
110	600863	内蒙华电	10,840,177	32,737,334.54	0.07
111	600743	华远地产	6,791,300	32,122,849.00	0.07
112	002267	陕天然气	3,005,583	31,558,621.50	0.07
113	002140	东华科技	2,061,309	31,455,575.34	0.07
114	603005	晶方科技	830,597	31,454,708.39	0.07
115	600006	东风汽车	3,428,785	30,413,322.95	0.07
116	600019	宝钢股份	6,042,465	29,608,078.50	0.07
117	600705	中航资本	4,993,438	29,361,415.44	0.07
118	601106	中国一重	5,037,312	26,244,395.52	0.06
119	300291	华录百纳	1,061,579	24,978,953.87	0.06
120	600805	悦达投资	2,832,005	24,581,803.40	0.05

121	600675	*ST 中企	4,772,754	24,102,407.70	0.05
122	600880	博瑞传播	2,773,100	23,599,081.00	0.05
123	601168	西部矿业	3,927,285	23,288,800.05	0.05
124	601139	深圳燃气	2,888,703	23,109,624.00	0.05
125	002004	华邦健康	2,413,561	22,035,811.93	0.05
126	600787	中储股份	2,890,546	21,476,756.78	0.05
127	601808	中海油服	1,739,865	21,139,359.75	0.05
128	600166	福田汽车	3,725,833	20,566,598.16	0.05
129	600240	华业资本	1,995,600	19,995,912.00	0.04
130	002551	尚荣医疗	799,979	18,703,509.02	0.04
131	002332	仙琚制药	1,629,760	18,253,312.00	0.04
132	000028	国药一致	278,619	18,138,096.90	0.04
133	601888	中国国旅	398,206	17,513,099.88	0.04
134	600406	国电南瑞	1,291,669	17,269,614.53	0.04
135	000539	粤电力A	3,113,440	15,629,468.80	0.03
136	601158	重庆水务	2,206,089	14,185,152.27	0.03
137	600594	益佰制药	842,164	13,457,780.72	0.03
138	600085	同仁堂	451,682	13,455,606.78	0.03
139	600873	梅花生物	2,009,264	12,477,529.44	0.03
140	600600	青岛啤酒	418,684	12,171,143.88	0.03
141	601390	中国中铁	1,717,456	11,970,668.32	0.03
142	603366	日出东方	1,419,782	11,926,168.80	0.03
143	600585	海螺水泥	814,511	11,842,989.94	0.03
144	002065	东华软件	582,927	10,912,393.44	0.02
145	601965	中国汽研	1,075,875	10,339,158.75	0.02
146	300002	神州泰岳	922,172	9,811,910.08	0.02
147	600398	海澜之家	858,495	9,700,993.50	0.02
148	002470	金正大	1,169,538	9,414,780.90	0.02
149	002048	宁波华翔	362,347	8,286,875.89	0.02
150	000826	启迪桑德	259,011	7,912,786.05	0.02
151	600176	中国巨石	822,120	7,867,688.40	0.02
152	601098	中南传媒	430,454	7,795,521.94	0.02
153	601231	环旭电子	689,174	7,374,161.80	0.02
154	600894	广日股份	547,573	7,299,148.09	0.02
155	000729	燕京啤酒	923,329	7,008,067.11	0.02
156	600587	新华医疗	298,933	6,902,362.97	0.02
157	600748	上实发展	672,276	6,480,740.64	0.01
158	601369	陕鼓动力	986,964	6,296,830.32	0.01
159	600064	南京高科	419,681	6,274,230.95	0.01
160	600557	康缘药业	382,638	6,248,478.54	0.01
161	601021	春秋航空	115,716	5,547,425.04	0.01
162	002008	大族激光	239,764	5,476,209.76	0.01
163	600008	首创股份	1,353,160	5,263,792.40	0.01
164	600016	民生银行	573,044	5,117,282.92	0.01

165	002440	闰土股份	327,194	4,858,830.90	0.01
166	600023	浙能电力	948,055	4,825,599.95	0.01
167	603288	海天味业	150,349	4,570,609.60	0.01
168	600352	浙江龙盛	527,857	4,550,127.34	0.01
169	600141	兴发集团	387,291	4,461,592.32	0.01
170	601126	四方股份	410,786	4,325,576.58	0.01
171	000488	晨鸣纸业	505,191	4,011,216.54	0.01
172	600418	江淮汽车	304,622	3,862,606.96	0.01
173	002344	海宁皮城	387,819	3,781,235.25	0.01
174	600118	中国卫星	96,300	3,235,680.00	0.01
175	002642	荣之联	108,772	2,861,791.32	0.01
176	601989	中国重工	437,393	2,768,697.69	0.01
177	601992	金隅股份	335,961	2,603,697.75	0.01
178	000598	兴蓉环境	485,415	2,562,991.20	0.01
179	600170	上海建工	640,417	2,452,797.11	0.01
180	600415	小商品城	340,773	2,105,977.14	0.00
181	601318	中国平安	62,783	2,011,567.32	0.00
182	601166	兴业银行	126,652	1,930,176.48	0.00
183	000709	河钢股份	679,800	1,883,046.00	0.00
184	601601	中国太保	68,952	1,864,462.08	0.00
185	601699	潞安环能	278,961	1,824,404.94	0.00
186	600839	四川长虹	384,000	1,697,280.00	0.00
187	300267	尔康制药	117,386	1,680,967.52	0.00
188	600036	招商银行	93,648	1,638,840.00	0.00
189	600535	天士力	40,859	1,461,117.84	0.00
190	600717	天津港	159,585	1,386,793.65	0.00
191	000629	*ST 钒钛	525,300	1,255,467.00	0.00
192	601169	北京银行	119,872	1,243,072.64	0.00
193	600582	天地科技	217,000	976,500.00	0.00
194	600018	上港集团	183,856	937,665.60	0.00
195	600373	中文传媒	44,516	923,707.00	0.00
196	002672	东江环保	51,109	885,718.97	0.00
197	002049	紫光国芯	18,609	817,865.55	0.00
198	002129	中环股份	91,205	756,089.45	0.00
199	600519	贵州茅台	2,578	752,569.76	0.00
200	600104	上汽集团	35,893	728,268.97	0.00
201	601336	新华保险	17,812	719,604.80	0.00
202	000417	合肥百货	82,519	667,578.71	0.00
203	600030	中信证券	40,786	661,956.78	0.00
204	600518	康美药业	42,493	645,468.67	0.00
205	002050	三花股份	66,525	641,966.25	0.00
206	600060	海信电器	35,166	621,734.88	0.00
207	601311	骆驼股份	26,000	516,100.00	0.00
208	002142	宁波银行	33,686	497,879.08	0.00

209	002456	欧菲光	16,852	497,134.00	0.00
210	600298	安琪酵母	27,838	496,629.92	0.00
211	600079	人福医药	29,521	495,067.17	0.00
212	002281	光迅科技	7,283	467,568.60	0.00
213	002480	新筑股份	39,618	430,647.66	0.00
214	002241	歌尔股份	14,995	430,056.60	0.00
215	002056	横店东磁	23,874	405,858.00	0.00
216	002422	科伦药业	22,596	348,204.36	0.00
217	000400	许继电气	21,660	334,430.40	0.00
218	600999	招商证券	19,410	320,265.00	0.00
219	002431	棕榈股份	25,780	296,470.00	0.00
220	002081	金螳螂	28,515	285,720.30	0.00
221	603766	隆鑫通用	13,135	265,589.70	0.00
222	600694	大商股份	6,511	250,803.72	0.00
223	002007	华兰生物	7,067	221,903.80	0.00
224	002236	大华股份	14,850	194,535.00	0.00
225	002051	中工国际	9,737	191,526.79	0.00
226	600109	国金证券	12,633	170,292.84	0.00
227	600201	生物股份	6,062	165,674.46	0.00
228	002482	广田集团	21,817	165,372.86	0.00
229	600000	浦发银行	10,608	165,166.56	0.00
230	600498	烽火通信	6,437	156,290.36	0.00
231	600884	杉杉股份	8,694	149,623.74	0.00
232	300003	乐普医疗	8,056	146,941.44	0.00
233	600570	恒生电子	2,196	146,626.92	0.00
234	601600	中国铝业	36,031	135,836.87	0.00
235	600660	福耀玻璃	9,456	132,384.00	0.00
236	002419	天虹商场	8,490	101,540.40	0.00
237	601898	中煤能源	18,154	93,674.64	0.00
238	600521	华海药业	3,805	92,537.60	0.00
239	000402	金融街	8,242	80,112.24	0.00
240	600362	江西铜业	5,640	76,027.20	0.00
241	600485	信威集团	2,968	52,949.12	0.00
242	000792	盐湖股份	1,659	35,004.90	0.00
243	000046	泛海控股	3,220	32,554.20	0.00
244	600369	西南证券	2,471	17,939.46	0.00
245	601969	海南矿业	1,343	15,068.46	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	601377	兴业证券	27,684,542.34	0.06
2	000661	长春高新	20,585,966.08	0.04
3	601099	太平洋	11,345,595.52	0.02

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	600016	民生银行	659,980,398.91	1.38
2	601166	兴业银行	510,056,273.13	1.07
3	600030	中信证券	453,283,106.82	0.95
4	601169	北京银行	436,983,151.93	0.92
5	600519	贵州茅台	323,561,504.10	0.68
6	601318	中国平安	242,995,694.71	0.51
7	600518	康美药业	229,137,449.16	0.48
8	601601	中国太保	226,700,265.31	0.48
9	002049	紫光国芯	202,925,531.25	0.43
10	600104	上汽集团	176,022,374.32	0.37
11	300059	东方财富	174,440,113.79	0.37
12	000333	美的集团	152,285,251.54	0.32
13	600352	浙江龙盛	148,795,493.40	0.31
14	600048	保利地产	143,692,037.70	0.30
15	600176	中国巨石	142,140,534.80	0.30
16	600085	同仁堂	139,787,135.38	0.29
17	002450	康得新	137,848,701.15	0.29
18	600498	烽火通信	133,234,151.38	0.28
19	002008	大族激光	132,906,292.12	0.28
20	000488	晨鸣纸业	127,923,478.15	0.27

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	59,616,103.94
卖出股票收入（成交）总额	11,750,516,916.81

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	4,250,594.67
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	9,831,337.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,081,931.84

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情 况说明
1	000651	格力电器	428,338,466.39	0.95	重大事项停 牌
2	000002	万 科 A	251,086,781.40	0.56	重大事项停 牌

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2	20,005,000.00 0.00	40,010,000,000.00	100.00%	0.00	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.0250%	10,000,000.00	0.0250%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.0250%	10,000,000.00	0.0250%	-

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 7 月 31 日）基金份额总额	40,010,000,000.00
--------------------------------	-------------------

本报告期期初基金份额总额	40,010,000,000.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	40,010,000,000.00

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	
招商证券	2	2,420,677,425.48	20.60%	-	-	-
国泰君安	1	1,574,494,097.18	13.40%	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	2,349,738,989.08	20.00%	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	5,405,606,405.07	46.00%	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于因指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	基金管理人网站	2016-01-04
2	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-06
3	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
4	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-08
5	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-12
6	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-14
7	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
8	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
9	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-29
10	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-02
11	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-17
12	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-23
13	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-26
14	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-31

		人网站	
15	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-12
16	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
17	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
18	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
19	易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报及基金管理人网站	2016-05-31
20	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-14

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惠灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达瑞惠灵活配置混合型发起式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