

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年三月三十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	159,828,135.15 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	89,272,210.95 份	70,555,924.20 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
	联系电话	020-85102688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn
		林葛
		010-66060069
		tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400 881 8088	95599
传真	020-85104666	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年		2015 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
本期已实现收益	5,772,247.63	4,774,740.94	3,592,761.02	13,233,910.73
本期利润	3,281,763.67	3,172,678.19	2,587,704.93	13,213,808.75
加权平均基金份额本期利润	0.0294	0.0482	0.0209	0.0030
本期基金份额净值增长率	5.79%	5.53%	22.70%	1.30%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
期末可供分配基金份额利润	0.2981	0.0689	0.2271	0.0126
期末基金资产净值	115,881,377.23	75,418,012.62	196,111,194.13	62,548,924.68
期末基金份额净值	1.298	1.069	1.227	1.013

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.本基金合同于 2015 年 6 月 26 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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
过去三个月	4.85%	0.91%	0.89%	0.01%	3.96%	0.90%
过去六个月	-2.19%	0.96%	1.79%	0.01%	-3.98%	0.95%
过去一年	5.79%	1.60%	3.56%	0.01%	2.23%	1.59%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	29.80%	1.72%	5.52%	0.01%	24.28%	1.71%

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
过去三个月	4.80%	0.91%	0.89%	0.01%	3.91%	0.90%
过去六个月	-2.29%	0.96%	1.79%	0.01%	-4.08%	0.95%
过去一年	5.53%	1.60%	3.56%	0.01%	1.97%	1.59%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.90%	1.33%	5.52%	0.01%	1.38%	1.32%

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 12 月 31 日)

易方达瑞享混合 I

(2015 年 6 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日)



易方达瑞享混合 E

(2015 年 6 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日)



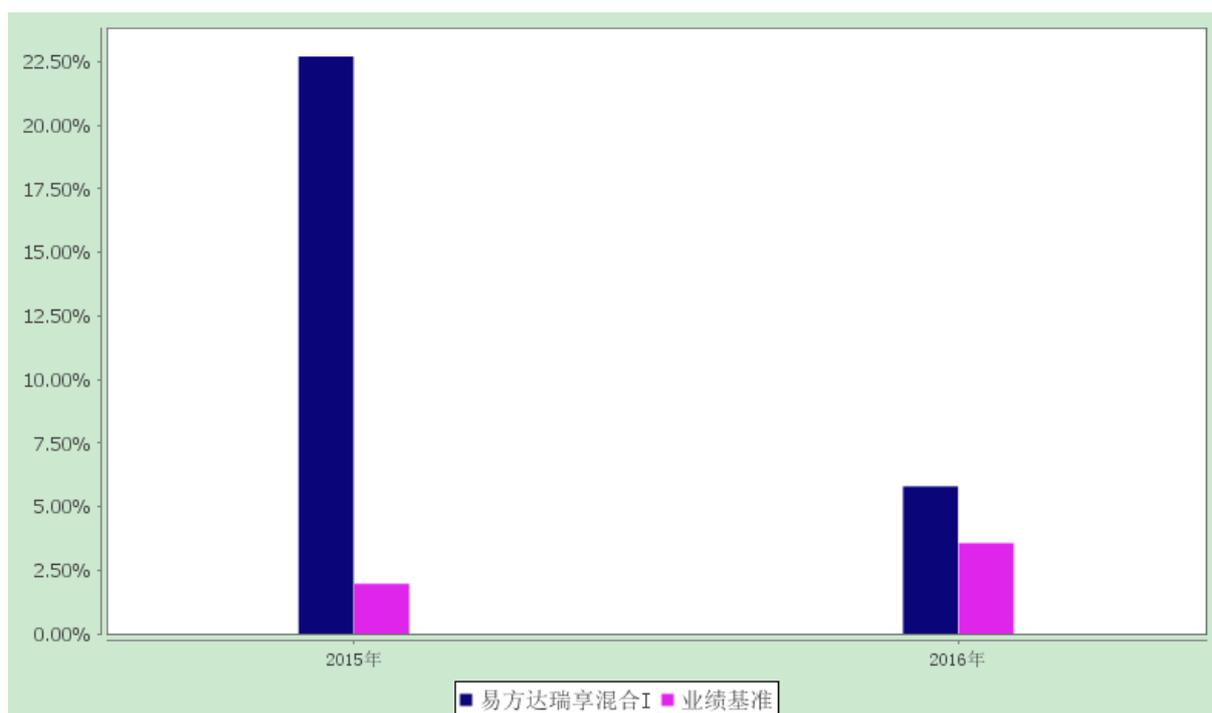
注：自基金合同生效至报告期末，I 类基金份额净值增长率为 29.80%，E 类基金份额净值增长率为 6.90%，同期业绩比较基准收益率为 5.52%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

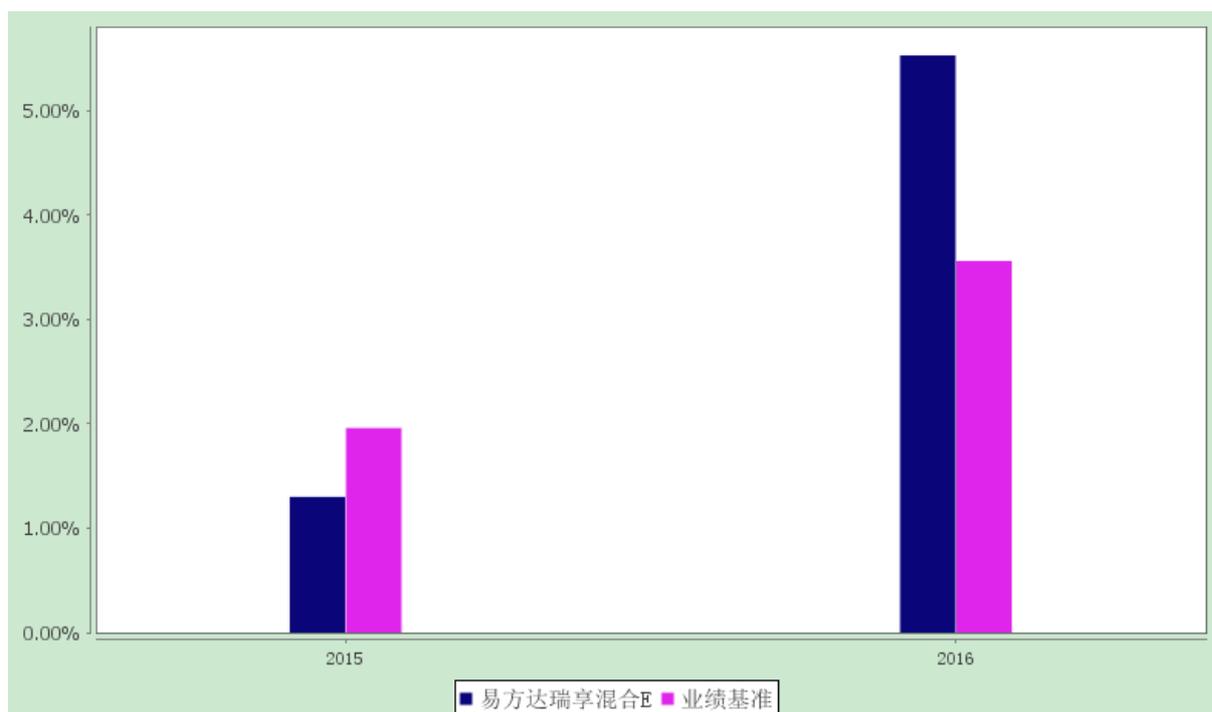
易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达瑞享混合 I



易方达瑞享混合 E



注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 26 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于 2001 年 4 月 17 日，旗下设有北京、广州、上海、成都、大连、南京等六个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。2012 年 10 月，易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016 年 12 月，易方达获得基本养老保险基金证券投资基金管理机构资格。截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理的各类资产总规模 10491 亿元，其中公募基金规模 4283 亿元，公募基金规模排名连续 12 年保持在行业前五名，服务客户超过 5000 万户，公司净资产 66 亿元，在国内资产管理行业具有领先的市场地位和综合实力。

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）	2015-06-26	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。
梁	本基金的基金经理	2016-	-	6 年	硕士研究生，曾任普华永道会计师

裕 宁		01-23		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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对我司旗下所有投资组合 2016 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 29 次，其中 26 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年 A 股市场表现相对平淡，年初“熔断”事件导致上证指数一月份大幅下跌 22.65%，其后逐步走出震荡向上行情，2 月到 12 月上证指数回升 13.37%，最终累计下跌 12.31%。整体市场风格与过去几年相比发生明显扭转，以低估值蓝筹股为首的上证 50 指数全年下跌 5.53%，表现明显好于市场整体，同期创业板指数下跌 27.71%，新兴经济与传统行业估值水平差距缩小。

2016 年，受房地产和基建投资拉动全年 GDP 增速 6.7%，较 2015 年小幅回落，经济呈现 L 型态势，传统行业盈利水平有所恢复。而供给侧改革落实和加大环保执法力度，加速了周期行业供需格局改善速度，重资产周期企业盈利状况大幅扭转。

本基金主要采取自上而下的策略进行资产配置，仓位一直维持在较高水平，通过组合结构调整应对市场变化。

一季度，组合结构以业绩确定的线性成长股为主，主要配置增速确定，估值中等的行业白马股，较大考虑股价安全边际；二季度，随着国债收益率持续下降，及宏观经济的变化，组合增加了高分红低估值价值股的配置，组合预期收益率进一步降低；进入下半年，受英国脱欧事件，美国加息预期上升等因素影响，全球流动性出现从宽松向中性发展的趋势，国债收益率逐步止跌回升。对应组合逐步降低高分红股票配置比例，并逐步加入以基建、资源为代表的大市值重资产周期股。

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 1.298 元，本报告期份额净值增长率为 5.79%；E 类基金份额净值为 1.069 元，本报告期份额净值增长率为 5.53%；同期业绩比较基准收益率为 3.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，财政政策取代货币政策引导经济复苏预期正在加强。金融风暴以来一直主导的量化宽松货币政策正在发生变化，持续流动性充裕所滋生的资产泡沫化可能将受到抑制，对应资本市场整体估值水平会有一些的下行风险。与此同时，“一带一路”和美国加大基建，都选择从政府层面引导投资，拉动实体经济复苏。受益于流动性充裕带动估值提升的新兴行业可能面临一定压力，需要兑现业绩消化估值。而经济企稳和政府投资发力，则带来传统行业及周期行业的基本面改善，最终导致整体市场结构重新向平衡方向回归。

在下一阶段资产配置上，我们将保持较高的股票仓位，通过对组合结构的积极调整应对市场变化。重点关注以下方面：一是受益于财政政策发力的行业，如基建，银行，PPP 等；二是受益于供给侧改革和环保收紧的周期行业，如钢铁，化工，造纸等；三是与财税改革相关的部分个股机会。

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 12 月 31 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，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计了 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	11,198,656.10	14,552,603.22
结算备付金	2,089,014.51	1,493,535.23
存出保证金	376,087.41	76,355.05
交易性金融资产	176,365,768.43	162,186,310.00
其中：股票投资	176,182,785.63	55,431,810.00
基金投资	-	-
债券投资	182,982.80	106,754,500.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	78,400,237.60
应收证券清算款	3,987,930.25	-
应收利息	9,456.02	2,477,715.27
应收股利	-	-
应收申购款	70,908.39	73,641.17
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	194,097,821.11	259,260,397.54
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	1,547,750.90	-
应付赎回款	12,121.03	33,707.77
应付管理人报酬	131,109.54	156,741.43
应付托管费	24,583.05	29,389.02
应付销售服务费	12,871.07	5,894.66
应付交易费用	1,009,985.02	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	60,010.65	181,510.54
负债合计	2,798,431.26	600,278.73
所有者权益：		
实收基金	159,828,135.15	221,583,987.03
未分配利润	31,471,254.70	37,076,131.78
所有者权益合计	191,299,389.85	258,660,118.81
负债和所有者权益总计	194,097,821.11	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 12 月 31 日，I 类基金份额净值 1.298 元，E 类基金份额净值 1.069 元；基金份额总额 159,828,135.15 份，下属分级基金的份额总额分别为：I 类基金份额总额 89,272,210.95 份，E 类基金份额总额 70,555,924.20 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 6 月 26 日（基金 合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	20,331,899.88	42,281,161.35
1.利息收入	505,034.04	38,749,945.75
其中：存款利息收入	236,654.86	37,224,214.06
债券利息收入	208,380.90	1,204,956.33
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	59,998.28	320,775.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	23,752,949.35	3,075,270.73
其中：股票投资收益	22,530,977.62	3,075,270.73
基金投资收益	-	-
债券投资收益	676,881.39	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	545,090.34	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,092,546.71	-1,025,158.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	166,463.20	1,481,102.94
减：二、费用	13,877,458.02	26,479,647.67
1. 管理人报酬	1,670,393.86	18,195,690.50
2. 托管费	313,198.88	3,411,691.94
3. 销售服务费	137,043.19	4,394,511.14
4. 交易费用	11,627,718.37	276,945.01
5. 利息支出	4,654.80	1,450.07

其中：卖出回购金融资产支出	4,654.80	1,450.07
6. 其他费用	124,448.92	199,359.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	6,454,441.86	15,801,513.68
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,454,441.86	15,801,513.68

注：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。

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	6,454,441.86	6,454,441.86
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）	-61,755,851.88	-12,059,318.94	-73,815,170.82
其中：1.基金申购款	52,323,545.43	8,735,901.94	61,059,447.37
2.基金赎回款	-114,079,397.31	-20,795,220.88	-134,874,618.19
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)	159,828,135.15	31,471,254.70	191,299,389.85
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 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	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)	-	15,801,513.68	15,801,513.68
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)	7,782,285.74	21,274,618.10	29,056,903.84
其中：1.基金申购款	40,223,366,098.83	34,772,785.00	40,258,138,883.83
2.基金赎回款	-40,215,583,813.09	-13,498,166.90	-40,229,081,979.99
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)	221,583,987.03	37,076,131.78	258,660,118.81

注：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。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年6月26日（基金合同 生效日）至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,670,393.86	18,195,690.50
其中：支付销售机构的客户维护费	23,469.29	430.84

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年6月26日（基金合同 生效日）至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	313,198.88	3,411,691.94

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

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。

7.4.8.2.3 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12月31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	-	133,834.51	133,834.51
中国农业银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	133,834.51	133,834.51
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12月31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	-	4,394,452.13	4,394,452.13
中国农业银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	4,394,452.13	4,394,452.13

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年6月26日（基金合同生效日）至 2015年12月31日	
	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
报告期初持有的基金份额	158,645,384.75	61,148,860.70	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	158,645,384.75	61,148,860.70
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	80,000,000.00	-	-	-
报告期末持有的基金份额	78,645,384.75	61,148,860.70	158,645,384.75	61,148,860.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	88.10%	86.67%	99.27%	98.99%

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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年6月26日（基金合同生效日） 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	11,198,656.10	176,098.58	14,552,603.22	963,468.74

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。

7.4.8.6 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12月31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
广发证券	603313	恒康家居	新股网下 发行	1,030	15,872.30
上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 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
-	-	-	-	-	-

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 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
002838	道恩 股份	2016-12-28	2017-01-06	新股 流通 受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
002840	华统 股份	2016-12-29	2017-01-10	新股 流通 受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
300583	赛托 生物	2016-12-29	2017-01-06	新股 流通	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-

				受限						
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股流通受限	4.00	4.00	26,150	104,600.00	104,600.00	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	10.44	10.44	1,875	19,575.00	19,575.00	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	23.16	23.16	831	19,245.96	19,245.96	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603660	苏州科达	2016-11-21	2017-12-01	老股转让流通受限	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603823	百合花	2016-12-09	2017-12-20	老股转让流通受限	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股流通	21.30	21.30	2,703	57,573.90	57,573.90	-

				受限						
--	--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

7.4.9.2 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
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项停牌	177.97	2017-03-13	195.77	20,504	3,556,095.40	3,649,096.88	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.10 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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 172,533,688.75 元，属于第二层次的余额为 3,832,079.68 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	176,182,785.63	90.77
	其中：股票	176,182,785.63	90.77
2	固定收益投资	182,982.80	0.09
	其中：债券	182,982.80	0.09
	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	13,287,670.61	6.85
7	其他各项资产	4,444,382.07	2.29
8	合计	194,097,821.11	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,684,000.00	2.45
B	采矿业	11,656,000.00	6.09
C	制造业	105,917,146.97	55.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.02
E	建筑业	53,690,391.76	28.07
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,270.56	0.04
J	金融业	104,600.00	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	176,182,785.63	92.10

8.3 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

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	000858	五 粮 液	365,000	12,585,200.00	6.58
2	601800	中国交建	550,000	8,354,500.00	4.37
3	601390	中国中铁	900,000	7,974,000.00	4.17
4	601668	中国建筑	900,000	7,974,000.00	4.17
5	002716	金贵银业	300,000	6,942,000.00	3.63
6	601669	中国电建	900,000	6,534,000.00	3.42
7	300078	思创医惠	250,000	6,477,500.00	3.39
8	601717	郑煤机	900,000	6,327,000.00	3.31
9	600519	贵州茅台	18,064	6,036,085.60	3.16
10	601186	中国铁建	500,000	5,980,000.00	3.13

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.efunds.com.cn 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300383	光环新网	80,654,890.11	31.18
2	300359	全通教育	67,281,379.65	26.01
3	002668	奥马电器	62,277,140.34	24.08
4	600547	山东黄金	57,191,428.73	22.11
5	300033	同花顺	53,798,191.59	20.80
6	300327	中颖电子	52,500,463.75	20.30
7	002601	佰利联	46,436,982.75	17.95
8	600988	赤峰黄金	38,628,804.15	14.93
9	600392	盛和资源	38,047,227.95	14.71
10	300409	道氏技术	37,380,272.09	14.45
11	000779	三毛派神	36,005,091.97	13.92
12	002494	华斯股份	34,357,421.00	13.28
13	300340	科恒股份	32,553,421.00	12.59
14	600497	驰宏锌锗	32,459,861.12	12.55
15	002155	湖南黄金	32,370,477.34	12.51
16	002751	易尚展示	32,359,604.76	12.51

17	002153	石基信息	31,175,592.55	12.05
18	600409	三友化工	30,855,700.47	11.93
19	002530	丰东股份	29,708,302.96	11.49
20	000911	南宁糖业	27,898,540.43	10.79
21	000426	兴业矿业	27,681,172.20	10.70
22	603799	华友钴业	26,967,544.04	10.43
23	002292	奥飞娱乐	25,933,710.15	10.03
24	000059	华锦股份	25,716,869.00	9.94
25	002019	亿帆医药	25,678,187.30	9.93
26	300481	濮阳惠成	23,969,568.11	9.27
27	601069	西部黄金	23,892,684.97	9.24
28	000785	武汉中商	23,476,307.50	9.08
29	601689	拓普集团	23,372,567.66	9.04
30	002626	金达威	22,941,738.89	8.87
31	000858	五 粮 液	22,854,474.00	8.84
32	300078	思创医惠	22,651,125.49	8.76
33	300100	双林股份	21,914,414.33	8.47
34	600160	巨化股份	21,465,698.82	8.30
35	600531	豫光金铅	21,202,496.34	8.20
36	600110	诺德股份	20,432,741.09	7.90
37	300007	汉威电子	20,139,955.66	7.79
38	002368	太极股份	19,918,280.75	7.70
39	603328	依顿电子	19,636,170.80	7.59
40	603108	润达医疗	19,554,930.39	7.56
41	002582	好想你	19,215,045.67	7.43
42	600711	盛屯矿业	19,154,433.00	7.41
43	600549	厦门钨业	19,087,399.28	7.38
44	000403	ST 生化	19,014,432.43	7.35
45	600559	老白干酒	18,303,459.50	7.08
46	000568	泸州老窖	17,957,568.29	6.94
47	601668	中国建筑	17,878,504.00	6.91
48	002311	海大集团	17,287,961.63	6.68
49	002286	保龄宝	17,273,045.82	6.68
50	300068	南都电源	17,194,920.23	6.65
51	300431	暴风集团	17,054,815.22	6.59
52	300098	高新兴	16,865,520.62	6.52
53	002638	勤上光电	16,810,520.86	6.50
54	002477	雏鹰农牧	16,706,330.31	6.46
55	603766	隆鑫通用	16,700,755.90	6.46
56	601800	中国交建	16,659,089.19	6.44
57	600756	浪潮软件	16,643,000.00	6.43
58	300113	顺网科技	16,516,922.65	6.39
59	601766	中国中车	16,500,997.00	6.38
60	300009	安科生物	16,420,409.50	6.35

61	600066	宇通客车	16,311,430.30	6.31
62	002714	牧原股份	16,137,951.92	6.24
63	002466	天齐锂业	16,104,673.26	6.23
64	000890	法尔胜	15,932,104.41	6.16
65	300468	四方精创	15,751,999.74	6.09
66	300302	同有科技	15,744,222.00	6.09
67	600476	湘邮科技	15,452,158.65	5.97
68	600661	新南洋	15,293,064.77	5.91
69	600978	宜华生活	15,246,385.47	5.89
70	002245	澳洋顺昌	14,962,703.00	5.78
71	002635	安洁科技	14,868,620.60	5.75
72	601012	隆基股份	14,796,521.72	5.72
73	002035	华帝股份	14,592,622.71	5.64
74	002084	海鸥卫浴	14,484,709.44	5.60
75	002077	大港股份	14,207,145.00	5.49
76	002716	金贵银业	14,206,255.09	5.49
77	600519	贵州茅台	14,182,734.36	5.48
78	000983	西山煤电	13,879,862.00	5.37
79	300059	东方财富	13,815,405.41	5.34
80	002458	益生股份	13,779,929.16	5.33
81	600546	*ST 山煤	13,754,939.92	5.32
82	600887	伊利股份	13,718,216.00	5.30
83	600348	阳泉煤业	13,698,692.08	5.30
84	601390	中国中铁	13,580,427.00	5.25
85	300377	赢时胜	13,486,925.00	5.21
86	300367	东方网力	13,282,288.20	5.14
87	300160	秀强股份	13,080,021.60	5.06
88	000687	华讯方舟	13,056,464.76	5.05
89	600975	新五丰	12,990,485.31	5.02
90	002299	圣农发展	12,850,868.00	4.97
91	002138	顺络电子	12,784,282.58	4.94
92	002434	万里扬	12,758,526.15	4.93
93	002127	南极电商	12,726,849.35	4.92
94	600068	葛洲坝	12,361,893.44	4.78
95	300369	绿盟科技	12,359,860.25	4.78
96	600136	当代明诚	12,321,839.35	4.76
97	601618	中国中冶	12,263,284.15	4.74
98	600199	金种子酒	12,242,211.58	4.73
99	000831	*ST 五稀	12,211,967.50	4.72
100	002145	中核钛白	12,156,886.24	4.70
101	002572	索菲亚	12,028,986.75	4.65
102	300319	麦捷科技	11,961,809.68	4.62
103	002175	东方网络	11,857,084.80	4.58
104	601021	春秋航空	11,756,508.25	4.55

105	300250	初灵信息	11,715,380.13	4.53
106	002370	亚太药业	11,540,209.50	4.46
107	300061	康耐特	11,402,519.00	4.41
108	600338	西藏珠峰	11,364,247.00	4.39
109	601186	中国铁建	11,355,907.00	4.39
110	002425	凯撒文化	11,227,730.00	4.34
111	002131	利欧股份	11,176,024.43	4.32
112	600240	华业资本	11,122,231.88	4.30
113	000957	中通客车	10,892,043.36	4.21
114	002103	广博股份	10,885,456.97	4.21
115	600426	华鲁恒升	10,879,648.26	4.21
116	600111	北方稀土	10,792,761.73	4.17
117	000968	*ST 煤气	10,694,053.59	4.13
118	300350	华鹏飞	10,688,940.35	4.13
119	000603	盛达矿业	10,605,897.96	4.10
120	000630	铜陵有色	10,463,972.00	4.05
121	600682	南京新百	10,110,120.63	3.91
122	002456	欧菲光	9,912,658.62	3.83
123	600418	江淮汽车	9,899,144.50	3.83
124	601669	中国电建	9,809,026.93	3.79
125	600701	*ST 工新	9,796,228.00	3.79
126	300017	网宿科技	9,742,263.81	3.77
127	002761	多喜爱	9,736,792.58	3.76
128	000732	泰禾集团	9,627,988.30	3.72
129	603901	永创智能	9,603,749.00	3.71
130	000333	美的集团	9,517,389.64	3.68
131	000089	深圳机场	9,497,248.70	3.67
132	002234	民和股份	9,467,781.86	3.66
133	000651	格力电器	9,455,237.00	3.66
134	002142	宁波银行	9,454,652.82	3.66
135	002712	思美传媒	9,420,812.00	3.64
136	002001	新 和 成	9,206,150.00	3.56
137	000969	安泰科技	9,174,577.00	3.55
138	002567	唐人神	9,145,044.70	3.54
139	600050	中国联通	9,139,879.15	3.53
140	600801	华新水泥	9,073,469.00	3.51
141	600029	南方航空	9,011,265.24	3.48
142	000783	长江证券	8,843,844.62	3.42
143	000895	双汇发展	8,715,082.14	3.37
144	000892	星美联合	8,695,210.96	3.36
145	600188	兖州煤业	8,684,643.90	3.36
146	600885	宏发股份	8,582,194.00	3.32
147	600458	时代新材	8,513,470.02	3.29
148	002228	合兴包装	8,462,565.00	3.27

149	002200	云投生态	8,322,920.14	3.22
150	300410	正业科技	8,115,834.13	3.14
151	600303	曙光股份	8,082,079.58	3.12
152	002339	积成电子	8,048,209.60	3.11
153	300458	全志科技	8,004,225.80	3.09
154	002643	万润股份	7,991,856.84	3.09
155	000970	中科三环	7,950,490.00	3.07
156	002366	台海核电	7,949,095.72	3.07
157	002673	西部证券	7,830,174.00	3.03
158	000802	北京文化	7,697,325.62	2.98
159	002502	骅威文化	7,648,335.62	2.96
160	002470	金正大	7,614,227.96	2.94
161	002146	荣盛发展	7,608,308.65	2.94
162	000860	顺鑫农业	7,542,524.12	2.92
163	300444	双杰电气	7,492,629.50	2.90
164	600595	中孚实业	7,484,888.60	2.89
165	002250	联化科技	7,425,022.18	2.87
166	002418	康盛股份	7,348,669.00	2.84
167	600702	沱牌舍得	7,342,593.28	2.84
168	002340	格林美	7,326,112.00	2.83
169	000833	贵糖股份	7,316,500.96	2.83
170	300449	汉邦高科	7,302,395.18	2.82
171	600491	龙元建设	7,255,330.00	2.80
172	601225	陕西煤业	7,184,800.00	2.78
173	603021	山东华鹏	7,148,746.00	2.76
174	000573	粤宏远 A	7,129,985.95	2.76
175	002371	七星电子	6,959,974.16	2.69
176	002746	仙坛股份	6,861,396.02	2.65
177	300396	迪瑞医疗	6,859,496.37	2.65
178	300016	北陆药业	6,852,235.28	2.65
179	600855	航天长峰	6,837,488.40	2.64
180	600196	复星医药	6,760,584.56	2.61
181	002699	美盛文化	6,736,997.57	2.60
182	300404	博济医药	6,704,499.00	2.59
183	002343	慈文传媒	6,661,941.00	2.58
184	603609	禾丰牧业	6,562,783.88	2.54
185	600276	恒瑞医药	6,517,067.20	2.52
186	600362	江西铜业	6,506,057.20	2.52
187	300267	尔康制药	6,503,921.75	2.51
188	600687	刚泰控股	6,494,526.00	2.51
189	600763	通策医疗	6,370,509.00	2.46
190	601106	中国一重	6,334,401.00	2.45
191	300429	强力新材	6,327,698.00	2.45
192	300483	沃施股份	6,295,242.87	2.43

193	000581	威孚高科	6,275,281.36	2.43
194	300520	科大国创	6,218,189.30	2.40
195	601717	郑煤机	6,103,290.00	2.36
196	601336	新华保险	6,098,302.25	2.36
197	002590	万安科技	6,078,125.00	2.35
198	300121	阳谷华泰	6,074,680.50	2.35
199	000937	冀中能源	6,073,678.00	2.35
200	603027	千禾味业	6,046,127.76	2.34
201	000550	江铃汽车	6,018,198.72	2.33
202	600039	四川路桥	6,002,300.00	2.32
203	000851	高鸿股份	5,984,335.00	2.31
204	600062	华润双鹤	5,934,504.88	2.29
205	600596	新安股份	5,911,313.79	2.29
206	002463	沪电股份	5,887,158.05	2.28
207	300333	兆日科技	5,873,923.00	2.27
208	002008	大族激光	5,869,173.00	2.27
209	000639	西王食品	5,788,890.25	2.24
210	300075	数字政通	5,783,351.80	2.24
211	300025	华星创业	5,766,063.63	2.23
212	002325	洪涛股份	5,665,300.89	2.19
213	300266	兴源环境	5,628,020.30	2.18
214	600060	海信电器	5,506,881.85	2.13
215	600582	天地科技	5,496,587.00	2.13
216	000516	国际医学	5,427,420.00	2.10
217	002124	天邦股份	5,412,728.00	2.09
218	002426	胜利精密	5,403,075.70	2.09
219	000488	晨鸣纸业	5,372,863.58	2.08
220	002037	久联发展	5,371,443.13	2.08
221	002378	章源钨业	5,347,048.00	2.07
222	600216	浙江医药	5,320,494.53	2.06
223	002475	立讯精密	5,304,672.00	2.05
224	300067	安诺其	5,301,407.00	2.05
225	300356	光一科技	5,298,407.29	2.05
226	002289	*ST 宇顺	5,293,973.00	2.05
227	600377	宁沪高速	5,291,569.65	2.05
228	002100	天康生物	5,266,189.31	2.04
229	600076	康欣新材	5,254,784.49	2.03
230	002237	恒邦股份	5,245,884.90	2.03
231	300451	创业软件	5,236,634.91	2.02
232	000545	金浦钛业	5,207,369.67	2.01
233	601600	中国铝业	5,184,869.00	2.00
234	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300383	光环新网	82,818,916.10	32.02
2	300359	全通教育	69,462,290.41	26.85
3	002668	奥马电器	62,601,109.91	24.20
4	600547	山东黄金	55,343,399.83	21.40
5	300327	中颖电子	54,395,601.54	21.03
6	300033	同花顺	52,662,248.66	20.36
7	002601	佰利联	44,819,080.76	17.33
8	300409	道氏技术	40,244,664.14	15.56
9	600988	赤峰黄金	35,620,577.67	13.77
10	000779	三毛派神	35,120,557.11	13.58
11	002494	华斯股份	34,559,240.92	13.36
12	600392	盛和资源	33,796,435.65	13.07
13	300340	科恒股份	32,542,215.13	12.58
14	600409	三友化工	30,851,098.18	11.93
15	002155	湖南黄金	30,748,836.97	11.89
16	002751	易尚展示	30,045,559.00	11.62
17	603799	华友钴业	28,562,962.65	11.04
18	002153	石基信息	28,252,808.53	10.92
19	000059	华锦股份	28,205,098.59	10.90
20	300481	濮阳惠成	27,680,458.14	10.70
21	000911	南宁糖业	27,572,613.81	10.66
22	002292	奥飞娱乐	27,570,861.49	10.66
23	002019	亿帆医药	27,435,349.76	10.61
24	600497	驰宏锌锗	26,856,947.74	10.38
25	000426	兴业矿业	26,474,246.96	10.24
26	300113	顺网科技	25,977,943.18	10.04
27	600531	豫光金铅	25,775,590.06	9.97
28	002530	丰东股份	25,185,052.54	9.74
29	601689	拓普集团	24,503,549.94	9.47
30	000785	武汉中商	23,998,129.11	9.28
31	300017	网宿科技	23,664,671.38	9.15
32	601069	西部黄金	22,706,544.64	8.78
33	300100	双林股份	21,025,949.25	8.13
34	300007	汉威电子	20,332,819.31	7.86
35	002626	金达威	20,170,632.42	7.80
36	002368	太极股份	20,046,406.57	7.75

37	300059	东方财富	19,693,866.80	7.61
38	000403	ST 生化	19,438,189.68	7.51
39	603108	润达医疗	19,228,605.70	7.43
40	603328	依顿电子	19,185,998.60	7.42
41	600160	巨化股份	19,123,316.00	7.39
42	002582	好想你	19,089,414.34	7.38
43	600711	盛屯矿业	19,027,979.85	7.36
44	300068	南都电源	18,809,798.70	7.27
45	002466	天齐锂业	18,461,684.02	7.14
46	002638	勤上光电	18,294,309.50	7.07
47	000568	泸州老窖	18,026,907.43	6.97
48	300098	高新兴	17,757,385.39	6.87
49	600549	厦门钨业	17,626,019.26	6.81
50	002311	海大集团	17,425,433.60	6.74
51	603766	隆鑫通用	17,363,487.53	6.71
52	601766	中国中车	17,320,497.43	6.70
53	600559	老白干酒	16,883,504.84	6.53
54	300009	安科生物	16,834,305.90	6.51
55	002286	保龄宝	16,656,344.01	6.44
56	002477	雏鹰农牧	16,377,754.84	6.33
57	002572	索菲亚	16,221,695.00	6.27
58	002714	牧原股份	16,185,655.87	6.26
59	600756	浪潮软件	16,158,035.72	6.25
60	600066	宇通客车	16,064,950.51	6.21
61	300078	思创医惠	15,903,867.56	6.15
62	600110	诺德股份	15,798,828.93	6.11
63	300302	同有科技	15,581,206.26	6.02
64	002635	安洁科技	15,572,164.11	6.02
65	600476	湘邮科技	15,547,288.90	6.01
66	300468	四方精创	15,403,545.05	5.96
67	600661	新南洋	15,232,046.35	5.89
68	300431	暴风集团	15,058,435.45	5.82
69	002035	华帝股份	14,952,749.71	5.78
70	600546	*ST 山煤	14,874,967.59	5.75
71	002245	澳洋顺昌	14,814,727.61	5.73
72	000890	法尔胜	14,795,937.68	5.72
73	002077	大港股份	14,320,455.51	5.54
74	601012	隆基股份	14,241,665.00	5.51
75	300367	东方网力	14,052,509.70	5.43
76	600978	宜华生活	14,034,187.15	5.43
77	600348	阳泉煤业	13,967,804.47	5.40
78	002084	海鸥卫浴	13,924,326.56	5.38
79	002458	益生股份	13,913,369.97	5.38
80	000983	西山煤电	13,839,616.19	5.35

81	300377	赢时胜	13,661,620.42	5.28
82	002127	南极电商	13,550,701.73	5.24
83	002145	中核钛白	13,382,408.28	5.17
84	600136	当代明诚	13,202,311.00	5.10
85	000687	华讯方舟	13,006,402.48	5.03
86	002434	万里扬	12,888,051.04	4.98
87	600975	新五丰	12,824,965.63	4.96
88	600887	伊利股份	12,752,145.96	4.93
89	601618	中国中冶	12,732,513.12	4.92
90	002299	圣农发展	12,368,855.61	4.78
91	300061	康耐特	12,338,088.45	4.77
92	600199	金种子酒	12,256,434.63	4.74
93	300319	麦捷科技	12,188,803.13	4.71
94	300160	秀强股份	12,174,630.04	4.71
95	300369	绿盟科技	12,042,935.00	4.66
96	600682	南京新百	11,733,262.55	4.54
97	002131	利欧股份	11,696,246.28	4.52
98	002370	亚太药业	11,589,172.50	4.48
99	000651	格力电器	11,555,470.61	4.47
100	300250	初灵信息	11,522,305.92	4.45
101	601668	中国建筑	11,496,020.00	4.44
102	002103	广博股份	11,373,488.07	4.40
103	000831	*ST 五稀	11,300,786.00	4.37
104	601021	春秋航空	11,226,132.56	4.34
105	600240	华业资本	11,162,347.26	4.32
106	600111	北方稀土	10,908,176.48	4.22
107	002425	凯撒文化	10,769,617.90	4.16
108	600562	国睿科技	10,766,893.32	4.16
109	600426	华鲁恒升	10,709,230.12	4.14
110	000858	五 粮 液	10,695,954.12	4.14
111	000968	*ST 煤气	10,623,747.22	4.11
112	600338	西藏珠峰	10,586,599.72	4.09
113	300350	华鹏飞	10,548,916.83	4.08
114	002456	欧菲光	10,434,199.25	4.03
115	000969	安泰科技	10,432,075.15	4.03
116	000957	中通客车	10,128,220.00	3.92
117	002175	东方网络	10,084,396.76	3.90
118	000630	铜陵有色	10,010,264.00	3.87
119	000089	深圳机场	9,905,730.27	3.83
120	300207	欣旺达	9,812,390.95	3.79
121	300458	全志科技	9,752,801.06	3.77
122	002567	唐人神	9,700,391.37	3.75
123	002001	新 和 成	9,552,722.00	3.69
124	000603	盛达矿业	9,491,486.22	3.67

125	600418	江淮汽车	9,432,300.43	3.65
126	601800	中国交建	9,372,615.41	3.62
127	000333	美的集团	9,220,502.21	3.56
128	600701	*ST 工新	9,200,836.00	3.56
129	000892	星美联合	9,192,623.02	3.55
130	002234	民和股份	9,112,688.35	3.52
131	600050	中国联通	9,109,000.00	3.52
132	002142	宁波银行	8,969,387.50	3.47
133	000732	泰禾集团	8,789,407.40	3.40
134	600885	宏发股份	8,752,381.18	3.38
135	600519	贵州茅台	8,749,618.52	3.38
136	603901	永创智能	8,716,592.90	3.37
137	002712	思美传媒	8,689,908.20	3.36
138	002643	万润股份	8,614,020.03	3.33
139	002339	积成电子	8,562,947.00	3.31
140	600188	兖州煤业	8,541,850.78	3.30
141	000783	长江证券	8,528,049.52	3.30
142	600303	曙光股份	8,489,183.20	3.28
143	600801	华新水泥	8,331,091.62	3.22
144	002366	台海核电	8,325,245.45	3.22
145	600458	时代新材	8,295,037.19	3.21
146	000895	双汇发展	8,276,509.48	3.20
147	002228	合兴包装	8,267,911.21	3.20
148	002146	荣盛发展	8,219,264.96	3.18
149	300444	双杰电气	8,047,563.00	3.11
150	002418	康盛股份	7,984,783.65	3.09
151	000970	中科三环	7,954,379.49	3.08
152	600029	南方航空	7,904,183.74	3.06
153	002470	金正大	7,677,734.00	2.97
154	600702	沱牌舍得	7,664,346.99	2.96
155	002673	西部证券	7,607,103.60	2.94
156	000573	粤宏远 A	7,538,293.00	2.91
157	300449	汉邦高科	7,534,713.48	2.91
158	000833	贵糖股份	7,522,387.69	2.91
159	002250	联化科技	7,375,718.90	2.85
160	002716	金贵银业	7,357,293.40	2.84
161	600595	中孚实业	7,322,747.69	2.83
162	000802	北京文化	7,309,020.31	2.83
163	603021	山东华鹏	7,280,128.12	2.81
164	600068	葛洲坝	7,229,526.00	2.79
165	000860	顺鑫农业	7,191,207.31	2.78
166	000639	西王食品	7,174,103.15	2.77
167	601225	陕西煤业	7,102,648.99	2.75
168	300410	正业科技	7,001,693.69	2.71

169	002371	七星电子	6,919,912.17	2.68
170	002590	万安科技	6,856,466.20	2.65
171	300016	北陆药业	6,844,929.32	2.65
172	300396	迪瑞医疗	6,832,919.44	2.64
173	002502	骅威文化	6,774,699.00	2.62
174	002340	格林美	6,769,271.00	2.62
175	600763	通策医疗	6,701,958.94	2.59
176	300429	强力新材	6,693,432.46	2.59
177	002138	顺络电子	6,675,501.02	2.58
178	002699	美盛文化	6,644,358.65	2.57
179	603609	禾丰牧业	6,642,864.00	2.57
180	601186	中国铁建	6,603,441.00	2.55
181	600196	复星医药	6,558,768.60	2.54
182	600276	恒瑞医药	6,543,814.49	2.53
183	300404	博济医药	6,543,425.89	2.53
184	000581	威孚高科	6,451,357.07	2.49
185	600687	刚泰控股	6,441,852.35	2.49
186	000937	冀中能源	6,408,176.00	2.48
187	000851	高鸿股份	6,386,940.00	2.47
188	601390	中国中铁	6,361,177.00	2.46
189	300075	数字政通	6,330,842.60	2.45
190	002746	仙坛股份	6,314,886.36	2.44
191	600062	华润双鹤	6,285,083.05	2.43
192	600855	航天长峰	6,270,768.95	2.42
193	600596	新安股份	6,250,367.62	2.42
194	300267	尔康制药	6,134,754.34	2.37
195	000550	江铃汽车	6,057,822.65	2.34
196	300356	光一科技	6,031,531.60	2.33
197	300025	华星创业	6,025,999.90	2.33
198	603027	千禾味业	6,004,259.05	2.32
199	002343	慈文传媒	5,883,568.16	2.27
200	000488	晨鸣纸业	5,882,897.76	2.27
201	002008	大族激光	5,862,332.59	2.27
202	002325	洪涛股份	5,851,120.07	2.26
203	600593	大连圣亚	5,834,794.44	2.26
204	300520	科大国创	5,822,695.80	2.25
205	603369	今世缘	5,753,767.64	2.22
206	601336	新华保险	5,739,475.04	2.22
207	300121	阳谷华泰	5,732,744.92	2.22
208	002463	沪电股份	5,719,243.14	2.21
209	600060	海信电器	5,669,011.40	2.19
210	002560	通达股份	5,639,973.32	2.18
211	002475	立讯精密	5,598,651.98	2.16
212	600582	天地科技	5,549,659.22	2.15

213	300266	兴源环境	5,543,882.40	2.14
214	300451	创业软件	5,540,221.00	2.14
215	300483	沃施股份	5,454,869.45	2.11
216	002124	天邦股份	5,431,460.48	2.10
217	300333	兆日科技	5,419,299.75	2.10
218	002100	天康生物	5,403,034.61	2.09
219	000516	国际医学	5,388,122.68	2.08
220	600491	龙元建设	5,387,291.80	2.08
221	600377	宁沪高速	5,345,652.05	2.07
222	600076	康欣新材	5,340,846.00	2.06
223	000807	云铝股份	5,307,813.80	2.05
224	000545	金浦钛业	5,262,918.86	2.03
225	603268	松发股份	5,247,216.67	2.03
226	002461	珠江啤酒	5,192,117.45	2.01
227	002568	百润股份	5,178,825.28	2.00

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,893,316,987.85
卖出股票收入（成交）总额	3,791,721,751.55

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	182,982.80	0.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	182,982.80	0.10

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112080	12 万向债	1,820	182,982.80	0.10

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	376,087.41
2	应收证券清算款	3,987,930.25
3	应收股利	-
4	应收利息	9,456.02

5	应收申购款	70,908.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,444,382.07

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	761	117,309.08	78,645,384.75	88.10%	10,626,826.20	11.90%
易方达瑞享混合 E	481	146,685.91	61,148,860.70	86.67%	9,407,063.50	13.33%
合计	1,242	128,686.10	139,794,245.45	87.47%	20,033,889.70	12.53%

9.2 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	416,919.53	0.4670%
	易方达瑞享混合 E	5,700.00	0.0081%
	合计	422,619.53	0.2644%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	10~50
	易方达瑞享混合 E	0
	合计	10~50
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

§ 10 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	22,390,063.03	29,933,482.40
减：本报告期基金总赎回份额	92,930,460.95	21,148,936.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	89,272,210.95	70,555,924.20

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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；于 2016 年 8 月 27 日发布公告，自 2016 年 8 月 27 日起聘任吴欣荣先生担任公司副总经理。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 2 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 60,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	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	5,294,480,280.09	68.93%	4,930,757.38	68.93%	-
兴业证券	1	2,386,181,116.30	31.07%	2,222,249.98	31.07%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少广发证券股份有限公司一个交易单元,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

的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	10,298,017.92	100.00%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一七年三月三十一日