

# 易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基 金

## 2016 年年度报告

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 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国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。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录 .....	2
1.1	重要提示 .....	2
1.2	目录 .....	3
§ 2	基金简介 .....	5
2.1	基金基本情况 .....	5
2.2	基金产品说明 .....	5
2.3	基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4	信息披露方式 .....	6
2.5	其他相关资料 .....	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2	基金净值表现 .....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	9
§ 4	管理人报告 .....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
§ 5	托管人报告 .....	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
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 .....	14
§ 6	审计报告 .....	15
6.1	管理层对财务报表的责任 .....	15
6.2	注册会计师的责任 .....	15
6.3	审计意见 .....	15
§ 7	年度财务报表 .....	16
7.1	资产负债表 .....	16
7.2	利润表 .....	18
7.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	19
7.4	报表附注 .....	21
§ 8	投资组合报告 .....	41
8.1	期末基金资产组合情况 .....	41
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	42
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	43
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
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 .....	50

8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	50
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
8.12	投资组合报告附注 .....	50
§ 9	基金份额持有人信息 .....	51
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	52
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	52
§ 10	开放式基金份额变动 .....	52
§ 11	重大事件揭示 .....	52
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4	基金投资策略的改变 .....	53
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
11.8	其他重大事件 .....	54
§ 12	备查文件目录 .....	56
12.1	备查文件目录 .....	56
12.2	存放地点 .....	56
12.3	查阅方式 .....	56

## § 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
登载基金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>
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 7 月 31 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	2,542,637,894.40	3,039,939,096.30
本期利润	-2,672,855,499.06	7,653,803,984.80
加权平均基金份额本期利润	-0.1429	0.1913
本期加权平均净值利润率	-12.54%	17.50%
本期基金份额净值增长率	3.86%	19.10%

3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	9,481,348,485.69	3,039,939,096.30
期末可供分配基金份额利润	0.2370	0.0760
期末基金资产净值	49,491,348,485.69	47,663,803,984.80
期末基金份额净值	1.237	1.191
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	23.70%	19.10%

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。

4.本基金合同于 2015 年 7 月 31 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

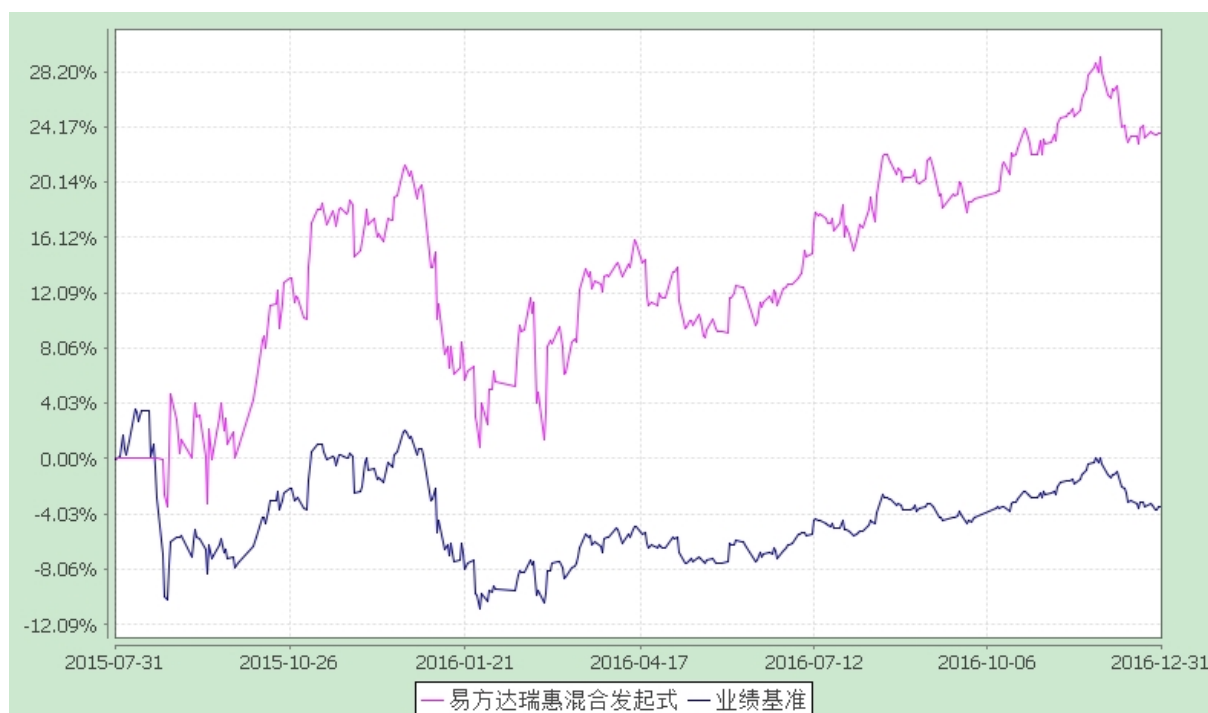
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.04%	0.63%	0.89%	0.36%	3.15%	0.27%
过去六个月	9.76%	0.71%	3.15%	0.38%	6.61%	0.33%
过去一年	3.86%	1.15%	-3.95%	0.70%	7.81%	0.45%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	23.70%	1.26%	-3.49%	0.86%	27.19%	0.40%

#### 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 12 月 31 日)



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

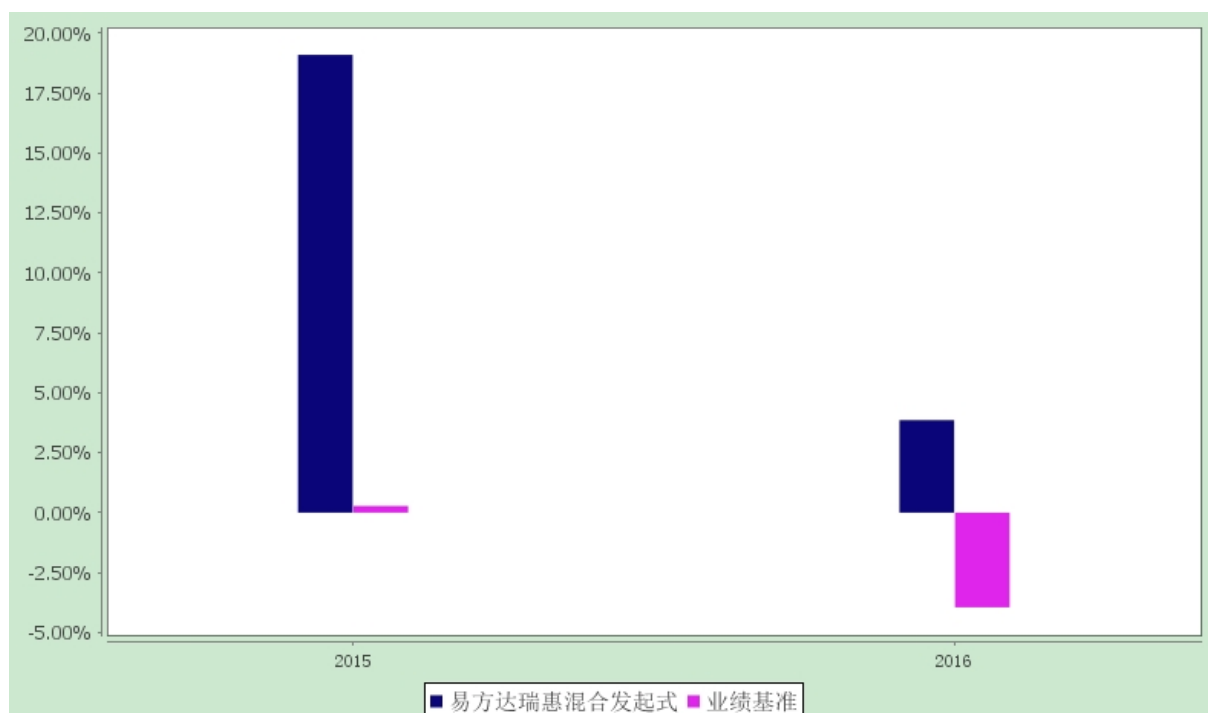
2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 23.70%，同期业绩比较基准收益率为-3.49%。

### 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

易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金

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





注：本基金合同生效日为 2015 年 7 月 31 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 7 月 31 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 股在 1 月快速下跌，此后稳步回升，但涨幅有限，综合来看，主要指数都出现了较大幅度的下跌。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 12.31%、下跌 19.64%、下跌 11.28%、下跌 22.89% 和下跌 27.71%。大盘股明显超越中小盘及创业板股票。板块方面，2016 年中信行业指数走势出现明显分化，食品饮料、家电涨幅居前，下跌的指数中跌幅较大的包括传媒、计算机、餐饮旅游、交通运输。

在 2016 年的投资过程中，为应对高度不确定的市场环境，本基金继续采用稳健的投资风格和逆向操作策略。注重中长期投资回报，重点考察公司的质量、盈利能力、抗风险能力和估值水平，选择具备持续竞争优势、管理优秀、盈利能力强、业绩波动小、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 1.237 元，本报告期份额净值增长率为 3.86%，同期业绩比较基准收益率为 -3.95%。

#### 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 2017 年，市场面临的主要风险可能是发达国家货币政策紧缩，特别是美国的货币政策，可能会阻碍包括中国在内的新兴市场经济复苏。中国经济目前已基本确定进入“L”型底部区域，但主要是靠财政刺激及房地产市场的贡献。未来主要看经济的转型升级能否顺利推进，供给侧改革能否解决产能过剩的问题，以及新兴产业的崛起。证券市场方面，在经历了 2016 年的下跌，部分行业的估值已趋于合理，未来仍然相对看好估值低的大盘蓝筹股票，但考虑到经济复苏的不确定性，预计未来将以结构性行情为主。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控内幕交易等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及

对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，及时贯彻落实新法规及新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 严守合规底线、管好合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行，完善信息隔离和利益冲突管理制度机制。

(3) 继续坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具、新投资策略的推出和应用，重点加强了对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、研究、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保了旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

(4) 对投研交易、销售宣传、客户服务、人员规范、运营及 IT 治理、反洗钱等方面开展了一系列专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

(6) 督促落实销售适当性管理制度，推动完善销售规范及客户投诉处理机制流程，保障投资者合法权益。

(7) 深入贯彻“风险为本”的监管精神，持续完善制度流程，探索建立风险识别、评估、预警和控制一体化的洗钱风险防控体系，推动提升客户身份识别工作水平，强化可疑交易监测分析，做好反洗钱宣传培训、系统研发、内部审计、信息报送等各项工作。

(8) 紧跟法规、市场变化和业务发展，持续优化完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、完整、准确、及时、规范。

(9) 不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，使合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性得到提升。

2016 年，公司获得 ISAE3402（《国际鉴证业务准则 3402 号》）无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告，鉴证日期区间为 2014 年 7 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。同时，公司通过

了 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。通过开展上述外部审计鉴证及验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定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。

#### 4.8 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 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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20722 号

易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、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，公允反映了易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 注册会计师

陈玲 周祎

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2017-03-24

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	39,190,102,425.93	7,851,028,707.31
结算备付金		-	-
存出保证金		668,643.76	45,288,274.33
交易性金融资产	7.4.7.2	10,272,135,052.07	27,204,231,765.95
其中：股票投资		10,272,135,052.07	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	7.4.7.3	-	-



买入返售金融资产	7.4.7.4	-	12,551,858,057.75
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	29,308,313.04	13,554,061.10
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>49,492,214,434.80</b>	<b>47,665,960,866.44</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		715,949.11	2,008,679.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	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	7.4.7.8	150,000.00	120,000.00
<b>负债合计</b>		<b>865,949.11</b>	<b>2,156,881.64</b>
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	40,010,000,000.00	40,010,000,000.00

未分配利润	7.4.7.10	9,481,348,485.69	7,653,803,984.80
<b>所有者权益合计</b>		<b>49,491,348,485.69</b>	<b>47,663,803,984.80</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>49,492,214,434.80</b>	<b>47,665,960,866.44</b>

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 12 月 31 日，基金份额净值 1.237 元，基金份额总额 40,010,000,000.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 7 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-2,647,147,963.51</b>	<b>7,705,670,107.46</b>
1.利息收入		205,073,970.51	146,683,612.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	149,444,730.89	143,180,390.74
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		55,629,239.62	3,503,222.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,914,888,459.44	2,945,121,606.22
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,680,021,804.07	2,923,028,630.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-

股利收益	7.4.7.15	234,866,655.37	22,092,975.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-5,215,493,393.46	4,613,864,888.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	448,383,000.00	-
<b>减：二、费用</b>		<b>25,707,535.55</b>	<b>51,866,122.66</b>
1. 管理人报酬		-	-
2. 托管费		10,851,072.02	9,127,084.32
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	14,657,403.01	42,613,919.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	199,060.52	125,118.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,672,855,499.06</b>	<b>7,653,803,984.80</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,672,855,499.06</b>	<b>7,653,803,984.80</b>

注：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。

### 7.3 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 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）	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）	-	-2,672,855,499.06	-2,672,855,499.06
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）	-	4,500,399,999.95	4,500,399,999.95
其中：1.基金申购款	-	17,894,799,999.95	17,894,799,999.95
2.基金赎回款	-	-13,394,400,000.00	-13,394,400,000.00
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	9,481,348,485.69	49,491,348,485.69
项目	上年度可比期间		
	2015 年 7 月 31 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）	40,010,000,000.00	-	40,010,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,653,803,984.80	7,653,803,984.80
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）	40,010,000,000.00	7,653,803,984.80	47,663,803,984.80

注：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。

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。

### 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终

止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 在遵守法律法规及监管部门规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议，但应于变更实施日前在指定媒体公告；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活



跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	2,590,102,425.93	2,651,028,707.31
定期存款	36,600,000,000.00	5,200,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	2,100,000,000.00	-
存款期限 3 个月-1 年	-	-
存款期限 1 个月以内	34,500,000,000.00	5,200,000,000.00
其他存款	-	-
合计	39,190,102,425.93	7,851,028,707.31

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		10,873,763,557.03	10,272,135,052.07	-601,628,504.96
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		10,873,763,557.03	10,272,135,052.07	-601,628,504.96
项目		上年度末		
		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		22,590,366,877.45	27,204,231,765.95	4,613,864,888.50
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		22,590,366,877.45	27,204,231,765.95	4,613,864,888.50

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	12,551,858,057.75	-
合计	12,551,858,057.75	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	814,121.22	8,631,814.99
应收定期存款利息	28,493,860.83	1,405,000.02
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	-	3,494,828.42
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	330.99	22,417.67
合计	29,308,313.04	13,554,061.10

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	-	28,202.25
合计	-	28,202.25

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	150,000.00	120,000.00
合计	150,000.00	120,000.00

## 7.4.7.9 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 12 月 31 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

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,039,939,096.30	4,613,864,888.50	7,653,803,984.80
本期利润	2,542,637,894.40	-5,215,493,393.46	-2,672,855,499.06
本期基金份额交易产生的变动数	4,126,590,401.70	373,809,598.25	4,500,399,999.95

其中：基金申购款	18,884,530,638.78	-989,730,638.83	17,894,799,999.95
基金赎回款	-14,757,940,237.08	1,363,540,237.08	-13,394,400,000.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,709,167,392.40	-227,818,906.71	9,481,348,485.69

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2015年7月31日（基金合同生效日）至2015年12月31日
活期存款利息收入	79,911,096.79	140,889,061.18
定期存款利息收入	69,289,733.05	1,405,000.02
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	737,956.53
其他	243,901.05	148,373.01
合计	149,444,730.89	143,180,390.74

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年7月31日（基金合同生效日）至2015年12月31日
卖出股票成交总额	13,463,086,858.83	34,711,138,832.31
减：卖出股票成本总额	11,783,065,054.76	31,788,110,201.41
买卖股票差价收入	1,680,021,804.07	2,923,028,630.90

#### 7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年7月31日（基金合同生效 日）至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	234,866,655.37	22,092,975.32
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	234,866,655.37	22,092,975.32

## 7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2015年7月31日（基金合同生效 日）至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-5,215,493,393.46	4,613,864,888.50
——股票投资	-5,215,493,393.46	4,613,864,888.50
——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	-5,215,493,393.46	4,613,864,888.50

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年7月31日（基金合同生效日）至 2015年12月31日
其他	448,383,000.00	-
合计	448,383,000.00	-

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年7月31日（基金合同生效日）至 2015年12月31日
交易所市场交易费用	14,657,403.01	42,613,919.85
银行间市场交易费用	-	-
合计	14,657,403.01	42,613,919.85

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月 31日	2015年7月31日（基金合同生效 日）至2015年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	50,000.00	20,000.00
银行汇划费	16,660.52	3,158.49
银行间账户维护费	31,500.00	1,500.00
其他	900.00	460.00
合计	199,060.52	125,118.49

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2资产负债表日后事项

2017年1月6日财政部、国家税务总局颁布了《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，就其于2016年12月21日颁布的《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)中关于“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人”的规定做出补充通知，要求2017年7月1日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

##### 7.4.9关联方关系



关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、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
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

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。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

本基金不收取管理费。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年7月31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	10,851,072.02	9,127,084.32

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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12月31 日	上年度可比期间 2015年7月31日（基金合同生 效日）至2015年12月31日
基金合同生效日（2015年7月31日）持有的基金份额	-	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.025%	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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年7月31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	2,590,102,425.9	79,911,096.79	2,651,028,707.3	140,889,061.18

	3		1	
--	---	--	---	--

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

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

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。

##### 7.4.12.2 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
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项停牌	6.25	2017-01-26	6.29	12,908,921	85,372,296.62	80,680,756.25	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项停牌	8.27	-	-	91,205	1,008,499.29	754,265.35	-
002440	闰土股份	2016-10-24	重大事项停牌	16.34	2017-01-12	15.22	327,194	5,490,315.32	5,346,349.96	-
600406	国电南瑞	2016-12-29	重大事项停牌	16.63	-	-	798,253	11,320,491.25	13,274,947.39	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	14.60	-	-	2,968	99,946.61	43,332.80	-
601168	西部矿业	2016-12-19	重大事项停牌	7.83	-	-	1,468,757	9,549,888.95	11,500,367.31	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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。

###### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、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。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2015 年 12 月 31 日：0.00%)。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31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。

#### 7.4.13.2.2 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12月31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。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	39,190,102,425.93	-	-	-	39,190,102,425.93
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	668,643.76	-	-	-	668,643.76
交易性金融资产	-	-	-	10,272,135,052.07	10,272,135,052.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	29,308,313.04	29,308,313.04
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,190,771,069.69	-	-	10,301,443,365.11	49,492,214,434.80
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	-	-	-	715,949.11	715,949.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	865,949.11	865,949.11
利率敏感度缺口	39,190,771,069.69	-	-	10,300,577,416.00	49,491,348,485.69

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			27,215,628,945.4	47,663,803,98
		-	-	1	4.80

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	10,272,135,052.07	20.76	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	10,272,135,052.07	20.76	27,204,231,765.95	57.08

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析



假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	513,606,722.28	2,862,490,480.97
	2.业绩比较基准下降 5%	-513,606,722.28	-2,862,490,480.97

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i)各层次金融工具公允价值

于 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 10,160,535,033.01 元，属于第二层次的余额为 111,600,019.06 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 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	10,272,135,052.07	20.76
	其中：股票	10,272,135,052.07	20.76
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	39,190,102,425.93	79.18
7	其他各项资产	29,976,956.80	0.06
8	合计	49,492,214,434.80	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	155,119,147.73	0.31

B	采矿业	261,715,873.92	0.53
C	制造业	4,430,555,822.86	8.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	790,592,598.75	1.60
E	建筑业	623,500,806.48	1.26
F	批发和零售业	648,710,087.75	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	556,542,621.66	1.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	501,293,736.40	1.01
J	金融业	1,381,213,425.54	2.79
K	房地产业	595,511,001.05	1.20
L	租赁和商务服务业	19,445,748.66	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	80,579,188.75	0.16
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	129,330,605.79	0.26
S	综合	98,024,386.73	0.20
	合计	10,272,135,052.07	20.76

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	17,467,360	430,046,403.20	0.87
2	601988	中国银行	69,720,034	239,836,916.96	0.48
3	601328	交通银行	36,136,859	208,509,676.43	0.42
4	601398	工商银行	46,360,399	204,449,359.59	0.41
5	000002	万科A	9,607,129	197,426,500.95	0.40
6	600572	康恩贝	25,815,798	188,713,483.38	0.38
7	600122	宏图高科	14,038,400	171,549,248.00	0.35
8	000661	长春高新	1,455,150	162,758,527.50	0.33
9	000998	隆平高科	7,238,411	155,119,147.73	0.31

10	600335	国机汽车	11,895,990	144,536,278.50	0.29
11	000006	深振业 A	14,598,400	137,954,880.00	0.28
12	600426	华鲁恒升	10,365,640	137,344,730.00	0.28
13	601998	中信银行	20,424,135	130,918,705.35	0.26
14	600056	中国医药	6,730,846	128,087,999.38	0.26
15	601628	中国人寿	5,316,805	128,081,832.45	0.26
16	600143	金发科技	16,403,844	127,621,906.32	0.26
17	600795	国电电力	39,470,295	125,120,835.15	0.25
18	600037	歌华有线	8,162,500	125,049,500.00	0.25
19	601939	建设银行	22,914,164	124,653,052.16	0.25
20	600252	中恒集团	27,100,200	124,118,916.00	0.25
21	600125	铁龙物流	15,328,200	123,851,856.00	0.25
22	600887	伊利股份	6,945,503	122,240,852.80	0.25
23	000690	宝新能源	12,684,727	117,587,419.29	0.24
24	600511	国药股份	3,898,350	117,340,335.00	0.24
25	300039	上海凯宝	11,173,707	114,307,022.61	0.23
26	600703	三安光电	8,426,936	112,836,673.04	0.23
27	300124	汇川技术	5,484,048	111,490,695.84	0.23
28	300115	长盈精密	4,270,896	111,299,549.76	0.22
29	600332	白云山	4,531,993	108,677,192.14	0.22
30	002271	东方雨虹	4,790,051	103,896,206.19	0.21
31	600831	广电网络	7,894,300	103,099,558.00	0.21
32	600089	特变电工	11,234,421	102,570,263.73	0.21
33	300147	香雪制药	7,816,244	100,829,547.60	0.20
34	600015	华夏银行	9,261,575	100,488,088.75	0.20
35	600674	川投能源	11,508,105	100,120,513.50	0.20
36	600690	青岛海尔	9,904,744	97,858,870.72	0.20
37	601186	中国铁建	8,154,947	97,533,166.12	0.20
38	000538	云南白药	1,276,106	97,175,471.90	0.20
39	600011	华能国际	13,455,594	94,861,937.70	0.19
40	000039	中集集团	6,445,964	94,239,993.68	0.19
41	601006	大秦铁路	13,195,901	93,426,979.08	0.19
42	002022	科华生物	4,315,400	86,308,000.00	0.17
43	600029	南方航空	12,279,826	86,204,378.52	0.17
44	000090	天健集团	8,825,015	85,249,644.90	0.17
45	002251	步步高	5,153,600	84,776,720.00	0.17
46	601899	紫金矿业	24,841,947	82,972,102.98	0.17
47	002249	大洋电机	9,425,203	81,339,501.89	0.16
48	000166	申万宏源	12,908,921	80,680,756.25	0.16
49	002063	远光软件	6,129,043	80,535,625.02	0.16
50	002390	信邦制药	7,902,229	78,153,044.81	0.16
51	000001	平安银行	8,573,560	78,019,396.00	0.16
52	600005	武钢股份	22,870,568	77,988,636.88	0.16
53	000063	中兴通讯	4,844,674	77,272,550.30	0.16

54	600115	东方航空	10,928,900	77,267,323.00	0.16
55	000030	富奥股份	9,038,200	76,824,700.00	0.16
56	000069	华侨城 A	11,038,925	76,720,528.75	0.16
57	600315	上海家化	2,813,255	76,267,343.05	0.15
58	600588	用友网络	3,577,000	74,473,140.00	0.15
59	600500	中化国际	6,374,593	74,327,754.38	0.15
60	002375	亚厦股份	7,011,792	74,184,759.36	0.15
61	600256	广汇能源	15,841,684	73,980,664.28	0.15
62	000793	华闻传媒	6,550,007	73,949,579.03	0.15
63	600196	复星医药	3,128,358	72,390,204.12	0.15
64	600068	葛洲坝	7,817,226	71,840,306.94	0.15
65	601088	中国神华	4,430,681	71,688,418.58	0.14
66	600583	海油工程	9,669,163	71,358,422.94	0.14
67	600597	光明乳业	5,340,799	69,750,834.94	0.14
68	000572	海马汽车	12,696,328	68,052,318.08	0.14
69	600221	海南航空	19,762,781	64,426,666.06	0.13
70	000338	潍柴动力	6,386,322	63,607,767.12	0.13
71	000100	TCL 集团	18,196,800	60,049,440.00	0.12
72	002309	中利科技	4,169,200	59,244,332.00	0.12
73	601669	中国电建	7,849,425	56,986,825.50	0.12
74	002250	联化科技	3,379,182	54,675,164.76	0.11
75	600835	上海机电	2,685,115	52,413,444.80	0.11
76	601818	光大银行	13,118,775	51,294,410.25	0.10
77	000800	一汽轿车	4,717,800	51,282,486.00	0.10
78	600657	信达地产	8,334,409	50,839,894.90	0.10
79	002646	青青稞酒	2,633,882	50,702,228.50	0.10
80	600522	中天科技	4,794,340	50,484,400.20	0.10
81	600496	精工钢构	11,519,756	49,304,555.68	0.10
82	002410	广联达	3,337,013	48,720,389.80	0.10
83	601607	上海医药	2,481,757	48,543,166.92	0.10
84	600309	万华化学	2,240,295	48,233,551.35	0.10
85	000997	新大陆	2,320,017	45,077,930.31	0.09
86	600642	申能股份	7,511,340	44,091,565.80	0.09
87	600376	首开股份	3,652,520	43,136,261.20	0.09
88	002663	普邦股份	6,959,920	42,246,714.40	0.09
89	600270	外运发展	2,516,509	41,623,058.86	0.08
90	600208	新潮中宝	9,738,036	40,510,229.76	0.08
91	600743	华远地产	8,828,690	39,287,670.50	0.08
92	601111	中国国航	5,258,409	37,860,544.80	0.08
93	601668	中国建筑	4,271,221	37,843,018.06	0.08
94	002038	双鹭药业	1,409,147	37,638,316.37	0.08
95	601991	大唐发电	9,755,819	37,267,228.58	0.08
96	600617	国新能源	3,512,526	36,881,523.00	0.07
97	000883	湖北能源	7,943,426	36,380,891.08	0.07

98	600027	华电国际	7,186,047	35,570,932.65	0.07
99	002327	富安娜	3,931,208	34,594,630.40	0.07
100	600578	京能电力	8,118,192	34,096,406.40	0.07
101	000963	华东医药	466,310	33,606,961.70	0.07
102	601800	中国交建	2,210,600	33,579,014.00	0.07
103	002146	荣盛发展	4,258,503	33,429,248.55	0.07
104	000581	威孚高科	1,488,000	33,390,720.00	0.07
105	600863	内蒙华电	10,840,177	33,387,745.16	0.07
106	601258	庞大集团	11,986,731	33,203,244.87	0.07
107	600195	中牧股份	1,451,496	30,844,290.00	0.06
108	600705	中航资本	4,993,438	30,559,840.56	0.06
109	600675	*ST 中企	4,772,754	30,497,898.06	0.06
110	300043	星辉娱乐	2,886,260	29,266,676.40	0.06
111	000999	华润三九	1,178,450	29,143,068.50	0.06
112	002267	陕天然气	3,005,583	28,823,540.97	0.06
113	601117	中国化学	4,198,198	28,421,800.46	0.06
114	002140	东华科技	2,061,309	27,868,897.68	0.06
115	601106	中国一重	5,037,312	27,251,857.92	0.06
116	600787	中储股份	2,890,546	26,217,252.22	0.05
117	600880	博瑞传播	2,773,100	24,292,356.00	0.05
118	601139	深圳燃气	2,667,103	24,243,966.27	0.05
119	600805	悦达投资	2,832,005	24,043,722.45	0.05
120	300291	华录百纳	1,061,579	23,651,980.12	0.05
121	600006	东风汽车	3,428,785	23,590,040.80	0.05
122	601808	中海油服	1,739,865	22,322,467.95	0.05
123	603005	晶方科技	737,297	22,148,401.88	0.04
124	002004	华邦健康	2,413,561	21,890,998.27	0.04
125	600019	宝钢股份	3,004,309	19,077,362.15	0.04
126	002332	仙琚制药	1,379,760	17,757,511.20	0.04
127	601888	中国国旅	398,206	17,282,140.40	0.03
128	600271	航天信息	845,286	16,863,455.70	0.03
129	600240	华业资本	1,559,400	16,747,956.00	0.03
130	000539	粤电力 A	3,113,440	16,563,500.80	0.03
131	601158	重庆水务	2,206,089	16,391,241.27	0.03
132	600166	福田汽车	5,172,400	15,982,716.00	0.03
133	601390	中国中铁	1,717,456	15,216,660.16	0.03
134	000028	国药一致	222,619	14,893,211.10	0.03
135	600594	益佰制药	842,164	14,022,030.60	0.03
136	600406	国电南瑞	798,253	13,274,947.39	0.03
137	600600	青岛啤酒	418,684	12,326,056.96	0.02
138	603366	日出东方	1,292,982	12,296,258.82	0.02
139	601168	西部矿业	1,468,757	11,500,367.31	0.02
140	002551	尚荣医疗	555,479	11,059,586.89	0.02
141	600398	海澜之家	858,495	9,263,161.05	0.02

142	002470	金正大	1,169,538	9,239,350.20	0.02
143	601965	中国汽研	844,375	8,992,593.75	0.02
144	600587	新华医疗	298,933	7,506,207.63	0.02
145	600894	广日股份	547,573	7,485,322.91	0.02
146	601231	环旭电子	689,174	7,381,053.54	0.01
147	601098	中南传媒	430,454	7,171,363.64	0.01
148	002048	宁波华翔	245,203	5,428,794.42	0.01
149	002440	闰土股份	327,194	5,346,349.96	0.01
150	300002	神州泰岳	561,125	5,184,795.00	0.01
151	600023	浙能电力	948,055	5,147,938.65	0.01
152	600352	浙江龙盛	527,857	4,861,562.97	0.01
153	603288	海天味业	150,349	4,409,736.17	0.01
154	601021	春秋航空	115,716	4,251,405.84	0.01
155	600585	海螺水泥	239,480	4,061,580.80	0.01
156	601126	四方股份	410,786	3,996,947.78	0.01
157	000826	启迪桑德	117,000	3,858,660.00	0.01
158	600873	梅花生物	578,078	3,769,068.56	0.01
159	601369	陕鼓动力	542,748	3,717,823.80	0.01
160	002065	东华软件	157,045	3,659,148.50	0.01
161	000729	燕京啤酒	471,537	3,277,182.15	0.01
162	600008	首创股份	790,144	3,247,491.84	0.01
163	600064	南京高科	187,663	3,143,355.25	0.01
164	601989	中国重工	437,393	3,101,116.37	0.01
165	600170	上海建工	640,417	3,029,172.41	0.01
166	600118	中国卫星	96,300	3,008,412.00	0.01
167	600085	同仁堂	85,404	2,679,977.52	0.01
168	600557	康缘药业	153,265	2,594,776.45	0.01
169	600748	上实发展	307,414	2,517,720.66	0.01
170	600176	中国巨石	239,198	2,353,708.32	0.00
171	000709	河钢股份	679,800	2,270,532.00	0.00
172	002642	荣之联	108,772	2,186,317.20	0.00
173	002008	大族激光	71,358	1,612,690.80	0.00
174	600839	四川长虹	384,000	1,605,120.00	0.00
175	600016	民生银行	166,970	1,516,087.60	0.00
176	002344	海宁皮城	114,148	1,292,155.36	0.00
177	000629	*ST 钒钛	525,300	1,255,467.00	0.00
178	600582	天地科技	217,000	1,078,490.00	0.00
179	600018	上港集团	183,856	941,342.72	0.00
180	601992	金隅股份	196,400	875,944.00	0.00
181	600415	小商品城	100,746	871,452.90	0.00
182	000598	兴蓉环境	140,264	807,920.64	0.00
183	002129	中环股份	91,205	754,265.35	0.00
184	000488	晨鸣纸业	72,091	746,862.76	0.00
185	600535	天士力	17,854	740,762.46	0.00

186	600141	兴发集团	45,302	689,043.42	0.00
187	601166	兴业银行	37,077	598,422.78	0.00
188	601699	潞安环能	71,865	578,513.25	0.00
189	600036	招商银行	28,234	496,918.40	0.00
190	600717	天津港	46,807	471,814.56	0.00
191	300267	尔康制药	33,918	442,629.90	0.00
192	600418	江淮汽车	37,920	438,355.20	0.00
193	002049	紫光国芯	9,509	313,226.46	0.00
194	601318	中国平安	7,705	272,988.15	0.00
195	002672	东江环保	15,379	270,670.40	0.00
196	600373	中文传媒	13,135	265,327.00	0.00
197	601601	中国太保	8,507	236,239.39	0.00
198	000417	合肥百货	24,448	210,986.24	0.00
199	601169	北京银行	18,472	180,286.72	0.00
200	000400	许继电气	6,534	118,592.10	0.00
201	600104	上汽集团	4,864	114,060.80	0.00
202	600519	贵州茅台	341	113,945.15	0.00
203	002482	广田集团	11,117	102,832.25	0.00
204	601336	新华保险	2,301	100,737.78	0.00
205	600518	康美药业	5,464	97,532.40	0.00
206	601600	中国铝业	22,131	93,392.82	0.00
207	600999	招商证券	5,639	92,084.87	0.00
208	002050	三花智控	8,303	91,665.12	0.00
209	600660	福耀玻璃	4,371	81,431.73	0.00
210	600030	中信证券	5,038	80,910.28	0.00
211	600060	海信电器	4,280	73,273.60	0.00
212	600079	人福医药	3,639	72,598.05	0.00
213	002281	光迅科技	915	71,827.50	0.00
214	002456	欧菲光	2,087	71,542.36	0.00
215	002142	宁波银行	4,278	71,185.92	0.00
216	600298	安琪酵母	3,515	62,637.30	0.00
217	002236	大华股份	4,395	60,123.60	0.00
218	002480	新筑股份	5,177	58,758.95	0.00
219	601311	骆驼股份	3,200	52,256.00	0.00
220	002241	歌尔股份	1,953	51,793.56	0.00
221	002422	科伦药业	2,997	48,311.64	0.00
222	600109	国金证券	3,700	48,211.00	0.00
223	600485	信威集团	2,968	43,332.80	0.00
224	002056	横店东磁	3,037	42,244.67	0.00
225	300003	乐普医疗	2,351	42,153.43	0.00
226	002081	金螳螂	3,664	35,870.56	0.00
227	603766	隆鑫通用	1,662	34,536.36	0.00
228	002007	华兰生物	911	32,568.25	0.00
229	600570	恒生电子	687	32,385.18	0.00



230	600694	大商股份	780	31,145.40	0.00
231	601898	中煤能源	5,339	31,019.59	0.00
232	002431	棕榈股份	3,172	29,055.52	0.00
233	002051	中工国际	1,244	28,512.48	0.00
234	600201	生物股份	756	23,882.04	0.00
235	600000	浦发银行	1,358	22,013.18	0.00
236	600498	烽火通信	804	20,268.84	0.00
237	002419	天虹商场	1,251	18,790.02	0.00
238	600884	杉杉股份	1,055	14,854.40	0.00
239	600362	江西铜业	756	12,647.88	0.00
240	600521	华海药业	515	11,345.45	0.00
241	000402	金融街	1,018	10,485.40	0.00
242	601969	海南矿业	743	9,094.32	0.00
243	000046	泛海控股	958	8,899.82	0.00
244	600369	西南证券	744	5,304.72	0.00
245	000792	盐湖股份	259	4,939.13	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	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
4	600743	华远地产	6,845,630.40	0.01

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	600016	民生银行	663,750,026.77	1.39
2	601166	兴业银行	511,535,633.38	1.07
3	600030	中信证券	453,920,121.18	0.95
4	601169	北京银行	438,211,926.69	0.92
5	600519	贵州茅台	324,269,628.72	0.68
6	601668	中国建筑	247,438,063.24	0.52

7	601318	中国平安	244,966,385.13	0.51
8	600518	康美药业	229,781,624.28	0.48
9	601601	中国太保	228,532,847.01	0.48
10	002049	紫光国芯	203,253,103.25	0.43
11	600104	上汽集团	176,771,072.08	0.37
12	300059	东方财富	174,440,113.79	0.37
13	000333	美的集团	152,285,251.54	0.32
14	600085	同仁堂	152,076,985.69	0.32
15	600176	中国巨石	148,804,197.74	0.31
16	600352	浙江龙盛	148,795,493.40	0.31
17	600048	保利地产	143,692,037.70	0.30
18	002450	康得新	137,848,701.15	0.29
19	600887	伊利股份	137,058,704.79	0.29
20	002008	大族激光	136,802,141.59	0.29

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	66,461,734.34
卖出股票收入（成交）总额	13,463,086,858.83

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	668,643.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,308,313.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,976,956.80

**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

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	40,010,000,000.0 0	100.00%	0.00	0.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.4 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%	-

## § 10 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

## § 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 100,000.00 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	
国泰君安	1	2,135,998,059.25	15.87%	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	2,349,738,989.08	17.45%	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	5,405,606,405.07	40.15%	-	-	-
招商证券	2	3,571,743,405.43	26.53%	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

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。

#### 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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于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	中国证券报、上海证券	2016-02-23

	基金估值调整情况的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
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
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
21	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	2016-08-27
22	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	2016-10-19

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。



## 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一七年三月三十一日