

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44

§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	50
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达瑞享混合	
基金主代码	001437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 26 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	166,484,147.29 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	92,532,786.13 份	73,951,361.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例，严格遵守低估值的股票投资逻辑，以绝对收益为目标，力争获得稳健、持续的投资收益。
业绩比较基准	一年期人民币定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	林葛
	联系电话	020-85102688	010-66060069
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95599
传真		020-85104666	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	北京市东城区建国门内大街69 号

办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	510620	100031
法定代表人	刘晓艳	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
本期已实现收益	-3,684,559.34	-2,577,805.89
本期利润	2,270,115.50	75,750.03
加权平均基金份额本期利润	0.0246	0.0010
本期加权平均净值利润率	1.81%	0.09%
本期基金份额净值增长率	2.62%	2.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
期末可供分配利润	26,421,857.15	4,259,133.14
期末可供分配基金份额利润	0.2855	0.0576
期末基金资产净值	123,225,817.79	81,020,253.79
期末基金份额净值	1.332	1.096
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E

基金份额累计净值增长率	33.20%	9.60%
-------------	--------	-------

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达瑞享混合 I

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.80%	1.29%	0.29%	0.01%	5.51%	1.28%
过去三个月	-5.73%	1.35%	0.88%	0.01%	-6.61%	1.34%
过去六个月	2.62%	1.10%	1.76%	0.01%	0.86%	1.09%
过去一年	0.38%	1.03%	3.55%	0.01%	-3.17%	1.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	33.20%	1.59%	7.28%	0.01%	25.92%	1.58%

易方达瑞享混合 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.79%	1.28%	0.29%	0.01%	5.50%	1.27%
过去三个月	-5.76%	1.34%	0.88%	0.01%	-6.64%	1.33%
过去六个月	2.53%	1.09%	1.76%	0.01%	0.77%	1.08%
过去一年	0.18%	1.03%	3.55%	0.01%	-3.37%	1.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	9.60%	1.27%	7.28%	0.01%	2.32%	1.26%

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2017年6月30日)

易方达瑞享混合 I



易方达瑞享混合 E



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 33.20%，E 类基金份额净值增长率为 9.60%，同期业绩比较基准收益率为 7.28%。

§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、大连等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2017年6月30日，易方达的总资产管理规模达到11000亿元，其中公募基金管理规模4842亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理 (助理)期 限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
梁裕宁	本基金的基金经理、易方达策略成长证券投资基金的基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金的基金经理	2016-01-23	-	7年	硕士研究生，曾任普华永道会计师事务所高级审计师，中山华通五金制品有限公司总裁助理，QQ Distinction Pty Ltd 董事、财务负责人，易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、投资经理兼行业研究员。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信

用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 16 次，其中 14 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；2 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，国内经济维持弱复苏，PPI 及核心 CPI 均出现走弱迹象，但绝对值仍处高位。房地产市场虽有所降温，但销量维持高位震荡，其低库存为国内投资增速提供一定支持。与此同时，出口数据向好，国内消费平稳，经济增长压力不大的情况下为国内金融市场去杠杆提供了一个不错的时间窗口。上半年国内流动性持续偏紧，银行间利率震荡上行，A 股风险偏好维持低位，防御气氛浓厚。

截至本报告期末，上证指数收于 3192 点，上涨 2.86%，创业板指数收于 1818 点，下跌 7.34%。市场热度持续下降，上证日均成交额进一步萎缩到 2000 亿元以下。A 股结构性分化严重，大部分中信行业指数均下跌。家电、食品饮料走出独立行情，上半年均取得 19% 以上收益，电子元器件及银行收益也接近 10%，计算机、传媒、纺织服装、农林牧渔、国防军工等估值较高行业跌幅较大，上半年均超过 10%。流动性持续偏紧，经济数据维持底部运行，导致市场风险偏好进一步收

缩，成长股及周期股资金持续撤出，向稳定性高的消费股和价值股集中，存量市场博弈迹象明显。

受到对财政政策持续发力的预期判断失误的影响，本基金上半年配置了较多的基建及建筑类相关标的，导致净值出现较大回撤，并止损离场。本基金后期逐步从配置上向景气周期向上的价值股及部分估值进入合理区间的成长股切换，净值逐步企稳回升。

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 1.332 元，本报告期份额净值增长率为 2.62%；E 类基金份额净值为 1.096 元，本报告期份额净值增长率为 2.53%；同期业绩比较基准收益率为 1.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们仍然维持震荡市的判断，但市场结构性分化可能得到一定缓和。我们判断下半年经济数据从短期高点逐步回落概率较大，央行货币政策上可能从偏紧向中性方向发展。在“趋弱的经济”加上“偏松的流动性”情况下，防御属性较强的价值股将面临一定分化，而内生增长较强的成长股关注度有望提高。

在下一阶段资产配置上，我们将维持较高的股票仓位，以景气周期持续向上的价值股为主，并适当增加估值合理的成长股配置。结构上比较看好白酒、家电等估值较低、景气周期持续的行业，并增加新能源、医药等行业周期好转、估值合理的成长股。

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，公司常务副总裁担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	24,245,361.95	11,198,656.10
结算备付金		2,280,974.41	2,089,014.51
存出保证金		244,068.71	376,087.41
交易性金融资产	6.4.7.2	187,788,453.41	176,365,768.43
其中：股票投资		187,788,453.41	176,182,785.63
基金投资		-	-
债券投资		-	182,982.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		66,019.00	3,987,930.25
应收利息	6.4.7.5	4,816.06	9,456.02
应收股利		-	-
应收申购款		433,721.31	70,908.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		215,063,414.85	194,097,821.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,868,128.17	1,547,750.90
应付赎回款		304,024.40	12,121.03
应付管理人报酬		131,731.96	131,109.54
应付托管费		24,699.74	24,583.05
应付销售服务费		13,196.56	12,871.07
应付交易费用	6.4.7.7	1,296,330.79	1,009,985.02

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	179,231.65	60,010.65
负债合计		10,817,343.27	2,798,431.26
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	166,484,147.29	159,828,135.15
未分配利润	6.4.7.10	37,761,924.29	31,471,254.70
所有者权益合计		204,246,071.58	191,299,389.85
负债和所有者权益总计		215,063,414.85	194,097,821.11

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，I 类基金份额净值 1.332 元，E 类基金份额净值 1.096 元；基金份额总额 166,484,147.29 份，下属分级基金的份额总额分别为：I 类基金份额总额 92,532,786.13 份，E 类基金份额总额 73,951,361.16 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		7,220,791.11	20,428,863.14
1.利息收入		98,984.39	417,540.98
其中：存款利息收入	6.4.7.11	94,071.89	153,821.08
债券利息收入		4,912.50	203,721.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	59,998.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,610,906.94	15,779,335.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,254,413.92	14,715,972.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,906.77	637,645.84
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	648,413.75	425,717.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	8,608,230.76	4,150,431.99

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	124,482.90	81,554.37
减：二、费用		4,874,925.58	9,106,215.41
1. 管理人报酬		834,967.88	906,099.90
2. 托管费		156,556.50	169,893.72
3. 销售服务费		84,930.56	63,602.72
4. 交易费用	6.4.7.18	3,589,442.08	7,722,908.19
5. 利息支出		-	4,654.80
其中：卖出回购金融资产支出		-	4,654.80
6. 其他费用	6.4.7.19	209,028.56	239,056.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,345,865.53	11,322,647.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,345,865.53	11,322,647.73

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	159,828,135.15	31,471,254.70	191,299,389.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,345,865.53	2,345,865.53
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）	6,656,012.14	3,944,804.06	10,600,816.20
其中：1.基金申购款	48,481,913.48	11,451,787.31	59,933,700.79
2.基金赎回款	-41,825,901.34	-7,506,983.25	-49,332,884.59
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）	166,484,147.29	37,761,924.29	204,246,071.58
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	221,583,987.03	37,076,131.78	258,660,118.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,322,647.73	11,322,647.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-69,761,201.93	-13,888,985.56	-83,650,187.49
其中：1.基金申购款	25,070,064.35	3,242,950.03	28,313,014.38
2.基金赎回款	-94,831,266.28	-17,131,935.59	-111,963,201.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	151,822,785.10	34,509,793.95	186,332,579.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1041号《关于准予易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为213,801,701.29份基金份额,其中认购资金利息折合1,200.00份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

投资基金会计核算业务指引》、《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	24,245,361.95
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	24,245,361.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	184,297,927.43	187,788,453.41	3,490,525.98
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	184,297,927.43	187,788,453.41	3,490,525.98

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,793.48
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	923.76
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	98.82
合计	4,816.06

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,296,330.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,296,330.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	711.35
预提费用	178,520.30
合计	179,231.65

6.4.7.9 实收基金

易方达瑞享混合 I

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	89,272,210.95	89,272,210.95
本期申购	16,135,604.00	16,135,604.00

本期赎回（以“-”号填列）	-12,875,028.82	-12,875,028.82
本期末	92,532,786.13	92,532,786.13

易方达瑞享混合 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,555,924.20	70,555,924.20
本期申购	32,346,309.48	32,346,309.48
本期赎回（以“-”号填列）	-28,950,872.52	-28,950,872.52
本期末	73,951,361.16	73,951,361.16

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

易方达瑞享混合 I

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,812,316.99	-2,203,150.71	26,609,166.28
本期利润	-3,684,559.34	5,954,674.84	2,270,115.50
本期基金份额交易产生的变动数	1,294,099.50	519,650.38	1,813,749.88
其中：基金申购款	5,709,055.74	579,778.68	6,288,834.42
基金赎回款	-4,414,956.24	-60,128.30	-4,475,084.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,421,857.15	4,271,174.51	30,693,031.66

易方达瑞享混合 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,295,465.09	-1,433,376.67	4,862,088.42
本期利润	-2,577,805.89	2,653,555.92	75,750.03
本期基金份额交易产生的变动数	541,473.94	1,589,580.24	2,131,054.18
其中：基金申购款	3,832,350.55	1,330,602.34	5,162,952.89
基金赎回款	-3,290,876.61	258,977.90	-3,031,898.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,259,133.14	2,809,759.49	7,068,892.63

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	76,874.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,906.69
其他	2,290.59
合计	94,071.89

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,180,270,330.44
减：卖出股票成本总额	1,182,524,744.36
买卖股票差价收入	-2,254,413.92

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	190,736.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	186,906.77
减：应收利息总额	8,736.00
买卖债券差价收入	-4,906.77

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	648,413.75
基金投资产生的股利收益	-
合计	648,413.75

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	8,608,230.76

——股票投资	8,604,306.79
——债券投资	3,923.97
——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	8,608,230.76

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	124,482.90
其他	-
合计	124,482.90

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	3,589,442.08
银行间市场交易费用	-
合计	3,589,442.08

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	11,908.26
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	209,028.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	834,967.88	906,099.90
其中：支付销售机构的客户维护费	19,206.26	4,288.93

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	156,556.50	169,893.72

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	合计
易方达基金管理有限公司	-	80,856.45	80,856.45
中国农业银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	80,856.45	80,856.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	合计
易方达基金管理有限公司	-	62,885.51	62,885.51
中国农业银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	62,885.51	62,885.51

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

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 E 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 E 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E	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	78,645,384.75	61,148,860.70	158,645,384.75	61,148,860.70
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	-	-	80,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	78,645,384.75	61,148,860.70	78,645,384.75	61,148,860.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	84.99%	82.69%	90.38%	94.36%

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达瑞享混合 I

无。

易方达瑞享混合 E

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期存款	24,245,361.95	76,874.61	9,899,886.47	118,767.61

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	002841	视源股份	新股网下发行	798	15,209.88
广发证券	002842	翔鹭钨业	新股网下发行	932	10,643.44
广发证券	300599	雄塑科技	新股网下发行	2,051	14,439.04
广发证券	300625	三雄极光	新股网下发行	2,065	39,854.50
广发证券	300627	华测导航	新股网下发行	1,498	19,129.46
广发证券	300639	凯普生物	新股网下发行	1,046	19,235.94
广发证券	300647	超频三	新股网下发行	1,244	11,146.24
广发证券	300658	延江股份	新股网下发行	1,110	21,545.10
广发证券	603041	美思德	新股网下发行	1,034	13,359.28
广发证券	603043	广州酒家	新股网下发行	1,810	23,855.80
广发证券	603089	正裕工业	新股网下发行	1,087	12,641.81
广发证券	603208	欧派股份	新股网下发行	1,221	30,317.43
广发证券	603630	拉芳家化	新股网下发行	1,985	36,504.15
广发证券	603639	海利尔	新股网下发行	563	14,046.85
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	002790	瑞尔特	新股网下发行	1,889	31,319.62
广发证券	300518	盛讯达	新股网下发行	722	16,042.84
广发证券	603028	赛福天	新股网下发行	3,309	14,096.34
广发证券	603131	上海沪工	新股网下发行	1,263	12,743.67

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达瑞享混合 I

本报告期内未发生利润分配。

易方达瑞享混合 E

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股流通	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

				受限						
60330 5	旭升 股份	2017- 06-30	2017- 07-10	新股 流通 受限	11.26	11.26	1,351	15,212 .26	15,212 .26	-
60333 1	百达 精工	2017- 06-27	2017- 07-05	新股 流通 受限	9.63	9.63	999	9,620. 37	9,620. 37	-
60361 7	君禾 股份	2017- 06-23	2017- 07-03	新股 流通 受限	8.93	8.93	832	7,429. 76	7,429. 76	-
60366 0	苏州 科达	2016- 11-21	2017- 12-01	老股 转让 流通 受限	8.03	40.95	26,007	208,83 6.21	1,064, 986.65	-
60382 3	百合 花	2016- 12-09	2017- 12-20	老股 转让 流通 受限	10.60	21.18	36,764	389,69 8.40	778,66 1.52	-
60393 3	睿能 科技	2017- 06-28	2017- 07-06	新股 流通 受限	20.20	20.20	857	17,311 .40	17,311 .40	-

注：1) 苏州科达科技股份有限公司于 2017 年 6 月 23 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 0.72 元人民币现金（含税）；

2) 百合花集团股份有限公司于 2017 年 5 月 26 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 1.25 元人民币现金（含税）；

3) 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
30008 5	银之杰	2017- 06-30	重大事 项停牌	18.50	2017- 07-07	18.88	199,950	3,511,099.87	3,699,075.00	-
60013 6	当代明 诚	2017- 02-13	重大事 项停牌	15.07	-	-	300,000	4,974,757.00	4,521,000.00	-
60106 9	西部黄 金	2017- 04-17	重大事 项停牌	24.44	-	-	180,000	4,576,032.00	4,399,200.00	-
60171 7	郑煤机	2017- 04-24	重大事 项停牌	7.55	-	-	600,014	4,901,886.39	4,530,105.70	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00% (2016 年 12 月 31 日：0.10%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	188,990.30
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	188,990.30

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,245,361.95	-	-	-	24,245,361.95
结算备付金	2,280,974.41	-	-	-	2,280,974.41
存出保证金	244,068.71	-	-	-	244,068.71
交易性金融资产	-	-	-	187,788,453.41	187,788,453.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	66,019.00	66,019.00
应收利息	-	-	-	4,816.06	4,816.06
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	433,721.31	433,721.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	26,770,405.07	-	-	188,293,009.78	215,063,414.85
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	-	-	-	8,868,128.17	8,868,128.17
应付赎回款	-	-	-	304,024.40	304,024.40
应付管理人报酬	-	-	-	131,731.96	131,731.96
应付托管费	-	-	-	24,699.74	24,699.74
应付销售服务费	-	-	-	13,196.56	13,196.56
应付交易费用	-	-	-	1,296,330.79	1,296,330.79
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	179,231.65	179,231.65
负债总计	-	-	-	10,817,343.27	10,817,343.27
利率敏感度缺口	26,770,405.07	-	-	177,475,666.51	204,246,071.58
上年度末					
2016 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	11,198,656.10	-	-	-	11,198,656.10
结算备付金	2,089,014.51	-	-	-	2,089,014.51
存出保证金	376,087.41	-	-	-	376,087.41
交易性金融资产	182,982.80	-	-	176,182,785.63	176,365,768.43

衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	3,987,930.25	3,987,930.25
应收利息	-	-	9,456.02	9,456.02
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	70,908.39	70,908.39
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	13,846,740.82	-	180,251,080.29	194,097,821.11
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	1,547,750.90
应付赎回款	-	-	12,121.03	12,121.03
应付管理人报酬	-	-	131,109.54	131,109.54
应付托管费	-	-	24,583.05	24,583.05
应付销售服务费	-	-	12,871.07	12,871.07
应付交易费用	-	-	1,009,985.02	1,009,985.02
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	60,010.65
负债总计	-	-	2,798,431.26	2,798,431.26
利率敏感度缺口	13,846,740.82	-	177,452,649.03	191,299,389.85

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日

1.市场利率下降 25 个基点	-	142.40
2.市场利率上升 25 个基点	-	-142.18

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	187,788,453.41	91.94	176,182,785.63	92.10
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	187,788,453.41	91.94	176,182,785.63	92.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	9,820,605.82	11,253,891.25
	2.业绩比较基准下降 5%	-9,820,605.82	-11,253,891.25

注：股票投资业绩基准取上证 A 指。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 170,639,072.71 元，属于第二层次的余额为 17,149,380.70 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 172,533,688.75 元，第二层次 3,832,079.68 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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价

值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	187,788,453.41	87.32
	其中：股票	187,788,453.41	87.32
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	26,526,336.36	12.33
7	其他各项资产	748,625.08	0.35
8	合计	215,063,414.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,471,027.96	5.13
C	制造业	134,082,299.16	65.65

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	510.24	0.00
F	批发和零售业	12,510,000.00	6.12
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,597,914.62	3.23
J	金融业	833.49	0.00
K	房地产业	12,482,652.82	6.11
L	租赁和商务服务业	1,012,215.12	0.50
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	10,631,000.00	5.20
S	综合	-	-
	合计	187,788,453.41	91.94

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
1	000002	万科A	499,906	12,482,652.82	6.11
2	002008	大族激光	300,000	10,392,000.00	5.09
3	002304	洋河股份	99,954	8,677,006.74	4.25
4	600519	贵州茅台	18,000	8,493,300.00	4.16
5	000725	京东方A	2,000,000	8,320,000.00	4.07
6	300294	博雅生物	200,000	8,248,000.00	4.04
7	600885	宏发股份	199,952	7,976,085.28	3.91
8	000963	华东医药	150,000	7,455,000.00	3.65
9	000418	小天鹅A	157,405	7,364,979.95	3.61
10	600110	诺德股份	500,000	7,045,000.00	3.45
11	002597	金禾实业	300,000	6,558,000.00	3.21
12	603993	洛阳钼业	1,199,966	6,071,827.96	2.97
13	300545	联得装备	80,000	5,784,000.00	2.83
14	601012	隆基股份	300,000	5,130,000.00	2.51

15	603939	益丰药房	150,000	5,055,000.00	2.47
16	601717	郑煤机	600,014	4,530,105.70	2.22
17	600136	当代明诚	300,000	4,521,000.00	2.21
18	601069	西部黄金	180,000	4,399,200.00	2.15
19	600486	扬农化工	99,956	4,219,142.76	2.07
20	603288	海天味业	100,000	4,078,000.00	2.00
21	600660	福耀玻璃	150,000	3,906,000.00	1.91
22	002497	雅化集团	400,000	3,880,000.00	1.90
23	300618	寒锐钴业	40,000	3,772,000.00	1.85
24	300085	银之杰	199,950	3,699,075.00	1.81
25	600782	新钢股份	1,000,000	3,650,000.00	1.79
26	600567	山鹰纸业	1,000,000	3,580,000.00	1.75
27	600373	中文传媒	150,000	3,526,500.00	1.73
28	601678	滨化股份	500,000	3,475,000.00	1.70
29	603138	海量数据	65,000	2,891,200.00	1.42
30	002716	金贵银业	150,000	2,878,500.00	1.41
31	002466	天齐锂业	50,000	2,717,500.00	1.33
32	002858	力盛赛车	50,000	2,583,500.00	1.26
33	002050	三花智控	150,000	2,448,000.00	1.20
34	300474	景嘉微	50,000	1,770,000.00	0.87
35	600963	岳阳林纸	200,000	1,506,000.00	0.74
36	002530	金财互联	50,000	1,473,000.00	0.72
37	603660	苏州科达	26,007	1,064,986.65	0.52
38	300662	科锐国际	40,056	1,012,215.12	0.50
39	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.38
40	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
41	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
42	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
43	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
44	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
45	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
46	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
47	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
48	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
49	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
50	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
51	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
52	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
53	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
54	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
55	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
56	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
57	002880	卫光生物	98	7,418.60	0.00
58	603380	易德龙	98	2,670.50	0.00

59	601878	浙商证券	49	833.49	0.00
60	603879	永悦科技	27	623.70	0.00
61	603316	诚邦股份	24	510.24	0.00
62	603536	惠发股份	8	191.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002716	金贵银业	27,331,063.09	14.29
2	002008	大族激光	27,275,549.17	14.26
3	600110	诺德股份	20,528,159.00	10.73
4	002530	金财互联	19,075,874.44	9.97
5	600089	特变电工	18,727,977.57	9.79
6	300294	博雅生物	18,057,393.72	9.44
7	600068	葛洲坝	17,687,024.80	9.25
8	000958	东方能源	17,265,896.85	9.03
9	300113	顺网科技	17,220,692.29	9.00
10	600885	宏发股份	16,557,408.93	8.66
11	002597	金禾实业	16,230,847.56	8.48
12	000002	万科 A	13,994,540.04	7.32
13	603288	海天味业	13,732,477.82	7.18
14	601669	中国电建	13,691,178.70	7.16
15	603969	银龙股份	13,486,714.00	7.05
16	002497	雅化集团	12,947,531.86	6.77
17	000418	小天鹅 A	12,109,842.11	6.33
18	600519	贵州茅台	11,938,315.58	6.24
19	300545	联得装备	11,596,996.20	6.06
20	000711	京蓝科技	11,447,685.65	5.98
21	601618	中国中冶	11,364,577.36	5.94
22	600963	岳阳林纸	11,352,189.04	5.93
23	300059	东方财富	11,226,462.26	5.87
24	300197	铁汉生态	11,108,525.60	5.81
25	600884	杉杉股份	11,014,666.89	5.76
26	002262	恩华药业	10,932,340.34	5.71
27	000980	众泰汽车	10,818,202.00	5.66
28	600970	中材国际	10,532,890.00	5.51
29	300628	亿联网络	10,262,917.00	5.36
30	000725	京东方 A	10,086,000.00	5.27

31	002155	湖南黄金	9,621,352.00	5.03
32	002019	亿帆医药	9,505,288.00	4.97
33	300097	智云股份	9,504,316.72	4.97
34	002635	安洁科技	9,370,620.00	4.90
35	601717	郑煤机	9,188,105.53	4.80
36	601766	中国中车	9,149,200.00	4.78
37	002032	苏泊尔	9,129,127.63	4.77
38	603993	洛阳钼业	9,061,453.76	4.74
39	300340	科恒股份	8,991,792.20	4.70
40	000877	天山股份	8,825,188.00	4.61
41	002304	洋河股份	8,742,428.24	4.57
42	300085	银之杰	8,705,409.70	4.55
43	603799	华友钴业	8,619,613.00	4.51
44	300319	麦捷科技	8,478,179.00	4.43
45	002068	黑猫股份	8,429,388.89	4.41
46	600258	首旅酒店	8,204,295.03	4.29
47	000401	冀东水泥	8,197,746.00	4.29
48	300576	容大感光	8,164,551.00	4.27
49	601088	中国神华	7,953,955.00	4.16
50	000596	古井贡酒	7,952,199.23	4.16
51	601800	中国交建	7,888,299.25	4.12
52	000600	建投能源	7,870,844.00	4.11
53	300024	机器人	7,830,490.75	4.09
54	600779	水井坊	7,794,454.45	4.07
55	002431	棕榈股份	7,772,657.90	4.06
56	300359	全通教育	7,672,831.41	4.01
57	600150	中国船舶	7,396,789.20	3.87
58	002573	清新环境	7,393,340.94	3.86
59	600392	盛和资源	7,378,471.32	3.86
60	000963	华东医药	7,375,874.15	3.86
61	600782	新钢股份	7,350,082.00	3.84
62	002383	合众思壮	7,254,465.60	3.79
63	600409	三友化工	7,193,515.20	3.76
64	002858	力盛赛车	7,037,194.00	3.68
65	601678	滨化股份	6,971,944.98	3.64
66	603869	北部湾旅	6,884,514.85	3.60
67	002466	天齐锂业	6,844,107.62	3.58
68	300188	美亚柏科	6,740,559.00	3.52
69	600446	金证股份	6,730,507.60	3.52
70	600362	江西铜业	6,724,269.00	3.52
71	300618	寒锐钴业	6,654,036.42	3.48
72	002460	赣锋锂业	6,493,832.00	3.39
73	601668	中国建筑	6,410,000.00	3.35
74	600298	安琪酵母	6,356,158.64	3.32

75	601069	西部黄金	6,355,600.00	3.32
76	002807	江阴银行	6,312,902.00	3.30
77	000639	西王食品	6,281,500.00	3.28
78	600489	中金黄金	6,234,319.00	3.26
79	601888	中国国旅	6,142,719.28	3.21
80	600486	扬农化工	5,953,761.00	3.11
81	603138	海量数据	5,846,419.24	3.06
82	000661	长春高新	5,780,692.00	3.02
83	300308	中际装备	5,754,432.00	3.01
84	600038	中直股份	5,737,875.12	3.00
85	002826	易明医药	5,691,622.50	2.98
86	300316	晶盛机电	5,571,581.98	2.91
87	601600	中国铝业	5,476,791.00	2.86
88	300474	景嘉微	5,212,419.49	2.72
89	601012	隆基股份	5,127,329.00	2.68
90	601186	中国铁建	5,095,105.00	2.66
91	600497	驰宏锌锗	5,094,304.00	2.66
92	600136	当代明诚	4,974,757.00	2.60
93	000961	中南建设	4,881,208.00	2.55
94	000928	中钢国际	4,876,610.00	2.55
95	603797	联泰环保	4,856,039.00	2.54
96	603040	新坐标	4,734,142.00	2.47
97	002601	龙蟠佰利	4,731,639.84	2.47
98	603939	益丰药房	4,675,772.71	2.44
99	300156	神雾环保	4,662,771.95	2.44
100	601000	唐山港	4,656,500.00	2.43
101	600201	生物股份	4,628,562.00	2.42
102	600701	工大高新	4,604,047.00	2.41
103	300355	蒙草生态	4,479,045.00	2.34
104	600545	新疆城建	4,367,764.00	2.28
105	002739	万达电影	4,362,216.36	2.28
106	000960	锡业股份	4,343,890.00	2.27
107	002542	中化岩土	4,330,129.31	2.26
108	002496	辉丰股份	4,312,356.00	2.25
109	600988	赤峰黄金	4,275,274.00	2.23
110	603677	奇精机械	4,216,323.91	2.20
111	600977	中国电影	4,187,702.28	2.19
112	002251	步步高	4,177,686.00	2.18
113	002457	青龙管业	4,155,288.00	2.17
114	600585	海螺水泥	4,137,796.88	2.16
115	300327	中颖电子	4,117,745.00	2.15
116	002108	沧州明珠	4,042,048.00	2.11
117	000998	隆平高科	4,004,162.00	2.09
118	600660	福耀玻璃	3,982,543.61	2.08

119	002797	第一创业	3,923,690.47	2.05
120	002080	中材科技	3,922,576.62	2.05
121	600072	中船科技	3,850,232.00	2.01
122	603323	吴江银行	3,829,000.00	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002716	金贵银业	29,337,346.51	15.34
2	002530	金财互联	22,545,836.13	11.79
3	600068	葛洲坝	22,490,224.02	11.76
4	002008	大族激光	20,368,922.68	10.65
5	601669	中国电建	19,580,655.90	10.24
6	600110	诺德股份	19,010,747.60	9.94
7	000958	东方能源	18,594,139.44	9.72
8	600089	特变电工	18,291,156.93	9.56
9	300113	顺网科技	16,693,148.97	8.73
10	601800	中国交建	16,024,986.61	8.38
11	601668	中国建筑	15,343,177.00	8.02
12	002262	恩华药业	15,011,296.20	7.85
13	603969	银龙股份	13,502,338.00	7.06
14	000858	五粮液	13,479,576.41	7.05
15	600392	盛和资源	12,635,878.73	6.61
16	600362	江西铜业	12,528,567.44	6.55
17	000711	京蓝科技	12,319,367.10	6.44
18	300059	东方财富	12,155,661.19	6.35
19	600779	水井坊	11,972,275.30	6.26
20	601717	郑煤机	11,751,199.60	6.14
21	600963	岳阳林纸	11,394,082.24	5.96
22	600884	杉杉股份	11,338,216.11	5.93
23	601600	中国铝业	10,900,643.54	5.70
24	601186	中国铁建	10,834,999.45	5.66
25	601618	中国中冶	10,629,041.16	5.56
26	002597	金禾实业	10,449,683.16	5.46
27	000980	众泰汽车	10,431,555.00	5.45
28	603799	华友钴业	10,283,831.08	5.38
29	002019	亿帆医药	10,238,680.34	5.35
30	002032	苏泊尔	10,132,627.88	5.30
31	002635	安洁科技	9,949,519.04	5.20
32	600497	驰宏锌锗	9,944,854.40	5.20

33	300197	铁汉生态	9,851,441.80	5.15
34	601390	中国中铁	9,843,215.42	5.15
35	600519	贵州茅台	9,751,463.92	5.10
36	300628	亿联网络	9,661,603.00	5.05
37	300294	博雅生物	9,425,052.17	4.93
38	601766	中国中车	9,374,086.00	4.90
39	603288	海天味业	9,291,293.27	4.86
40	600970	中材国际	9,098,094.80	4.76
41	600885	宏发股份	8,994,956.14	4.70
42	300340	科恒股份	8,850,829.99	4.63
43	300097	智云股份	8,722,515.38	4.56
44	002601	龙麟佰利	8,632,118.72	4.51
45	002138	顺络电子	8,611,386.06	4.50
46	002068	黑猫股份	8,608,598.00	4.50
47	002497	雅化集团	8,516,089.00	4.45
48	000401	冀东水泥	8,461,527.87	4.42
49	000600	建投能源	8,313,857.84	4.35
50	000877	天山股份	8,288,744.48	4.33
51	002431	棕榈股份	8,214,916.26	4.29
52	601088	中国神华	7,969,358.00	4.17
53	600258	首旅酒店	7,936,268.05	4.15
54	300319	麦捷科技	7,933,975.90	4.15
55	600409	三友化工	7,759,235.62	4.06
56	300024	机器人	7,734,171.45	4.04
57	002155	湖南黄金	7,698,746.21	4.02
58	002573	清新环境	7,585,972.76	3.97
59	600547	山东黄金	7,507,466.00	3.92
60	300576	容大感光	7,434,251.12	3.89
61	000596	古井贡酒	7,225,699.04	3.78
62	600988	赤峰黄金	7,197,240.00	3.76
63	600446	金证股份	6,990,917.86	3.65
64	600150	中国船舶	6,954,476.78	3.64
65	300359	全通教育	6,931,301.63	3.62
66	300078	思创医惠	6,928,241.00	3.62
67	300545	联得装备	6,892,183.60	3.60
68	300188	美亚柏科	6,835,835.31	3.57
69	002761	多喜爱	6,717,384.75	3.51
70	002826	易明医药	6,538,467.00	3.42
71	603869	北部湾旅	6,447,418.59	3.37
72	002807	江阴银行	6,283,975.00	3.28
73	002383	合众思壮	6,197,258.40	3.24
74	600298	安琪酵母	6,163,941.00	3.22
75	000639	西王食品	6,109,604.67	3.19
76	600489	中金黄金	6,066,133.00	3.17

77	600038	中直股份	5,767,088.42	3.01
78	000661	长春高新	5,742,074.56	3.00
79	002460	赣锋锂业	5,713,953.59	2.99
80	601888	中国国旅	5,707,893.73	2.98
81	300316	晶盛机电	5,623,182.00	2.94
82	300085	银之杰	5,382,457.81	2.81
83	002466	天齐锂业	5,332,727.28	2.79
84	300308	中际装备	5,247,034.28	2.74
85	600701	工大高新	4,983,837.80	2.61
86	600039	四川路桥	4,865,000.00	2.54
87	603986	兆易创新	4,736,859.72	2.48
88	002739	万达电影	4,703,229.81	2.46
89	002200	云投生态	4,673,646.90	2.44
90	600201	生物股份	4,641,841.67	2.43
91	300156	神雾环保	4,628,477.83	2.42
92	603040	新坐标	4,593,650.00	2.40
93	002542	中化岩土	4,521,689.60	2.36
94	000418	小天鹅 A	4,414,511.80	2.31
95	002496	辉丰股份	4,384,330.00	2.29
96	300355	蒙草生态	4,371,754.44	2.29
97	000961	中南建设	4,345,234.00	2.27
98	600585	海螺水泥	4,306,898.12	2.25
99	600977	中国电影	4,240,140.71	2.22
100	000998	隆平高科	4,188,312.72	2.19
101	601000	唐山港	4,096,513.00	2.14
102	603677	奇精机械	4,083,210.46	2.13
103	300296	利亚德	4,065,410.00	2.13
104	000960	锡业股份	3,994,435.95	2.09
105	300327	中颖电子	3,952,119.27	2.07
106	600782	新钢股份	3,937,100.00	2.06
107	000928	中钢国际	3,925,146.40	2.05
108	002080	中材科技	3,864,909.32	2.02
109	000930	中粮生化	3,853,918.34	2.01
110	002307	北新路桥	3,840,017.00	2.01
111	603323	吴江银行	3,827,959.36	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,185,526,105.35
卖出股票收入（成交）总额	1,180,270,330.44

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	244,068.71
2	应收证券清算款	66,019.00
3	应收股利	-
4	应收利息	4,816.06
5	应收申购款	433,721.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	748,625.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达瑞享混合 I	880	105,150.89	78,645,384.75	84.99%	13,887,401.38	15.01%
易方达瑞享混合 E	812	91,073.10	61,148,860.70	82.69%	12,802,500.46	17.31%
合计	1,692	98,394.89	139,794,245.45	83.97%	26,689,901.84	16.03%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达瑞享混合 I	1,371,716.70	1.4824%
	易方达瑞享混合 E	8,377.51	0.0113%
	合计	1,380,094.21	0.8290%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达瑞享混合 I	>=100
	易方达瑞享混合 E	0
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达瑞享混合 I	10~50
	易方达瑞享混合 E	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日）基金份额总额	160,122,734.71	53,678,966.58
本报告期期初基金份额总额	89,272,210.95	70,555,924.20
本报告期基金总申购份额	16,135,604.00	32,346,309.48
减：本报告期基金总赎回份额	12,875,028.82	28,950,872.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	92,532,786.13	73,951,361.16

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2017 年 3 月 10 日发布公告，自 2017 年 3 月 10 日起聘任关秀霞女士担任公司

首席国际业务官（副总经理级）；于 2017 年 4 月 19 日发布公告，自 2017 年 4 月 19 日起聘任高松凡先生担任公司首席养老金业务官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	858,824,828.00	36.36%	799,825.42	36.36%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

兴业证券	1	1,033,658,252.52	43.76%	962,645.18	43.76%	-
申万宏源	2	469,423,837.35	19.87%	437,175.45	19.87%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购海利尔药业集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-06
2	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东翔鹭钨业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-10
3	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州视源电子科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-13
4	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东雄塑科技集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-14
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	2017-01-17

6	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购浙江正裕工业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-20
7	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江山欧派门业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-03
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	2017-02-09
9	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购拉芳家化股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-04
10	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	2017-03-10
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东三雄极光照明股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-11
12	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购上海华测导航技术股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-16
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加宜信普泽费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-22
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏美思德化学股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-24
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加泛华普益费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-05
16	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东凯普生物科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-07
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	2017-04-19
18	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购深圳市超频三科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-26
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳新兰德费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-02
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	2017-05-11

		理人网站	
21	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	2017-05-12
22	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购厦门延江新材料股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-20
23	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	2017-05-24
24	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州酒家集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-21
25	关于易方达基金管理有限公司上海直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年01月01日~2017年06月30日	139,794,245.45	-	-	139,794,245.45	83.97%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

§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享灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；

2. 《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

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

二〇一七年八月二十九日