

易方达瑞程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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46

§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达瑞程混合	
基金主代码	003961	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 15 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	700,070,599.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C
下属分级基金的交易代码	003961	003962
报告期末下属分级基金的份额总额	700,010,979.90 份	59,619.12 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	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场因素、估值及流动性因素、政策因素等分析，并重点考虑债券市场情况，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，以确定资产的最优配置比例。本基金在债券投资上主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。本基金在股票投资上结合对行业景气度、行业竞争格局的判断以及对公司基本面、估值水平等因素进行定量和定性的分析，选择优质行业、个股进行配置，追求业绩的长期稳健增值。
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	朱萍
	联系电话	020-85102688	021-61618888
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	Zhup02@spdb.com.cn

客户服务电话	400 881 8088	95528
传真	020-85104666	021-63602540
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	上海市中山东一路12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	上海市中山东一路12号
邮政编码	510620	200120
法定代表人	刘晓艳	高国富

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）	
	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C
本期已实现收益	14,541,633.32	665.88
本期利润	29,317,857.29	1,344.59
加权平均基金份额本期利润	0.0419	0.0400
本期加权平均净值利润率	4.12%	3.94%
本期基金份额净值增长率	4.18%	4.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C
期末可供分配利润	15,941,948.45	1,293.25

期末可供分配基金份额利润	0.0228	0.0217
期末基金资产净值	730,729,106.99	62,169.94
期末基金份额净值	1.0439	1.0428
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C
基金份额累计净值增长率	4.39%	4.28%

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

易方达瑞程混合 A

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	2.01%	0.14%	1.98%	0.15%	0.03%	-0.01%
过去三个月	2.95%	0.14%	1.40%	0.16%	1.55%	-0.02%
过去六个月	4.18%	0.12%	2.07%	0.14%	2.11%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.39%	0.11%	1.76%	0.16%	2.63%	-0.05%

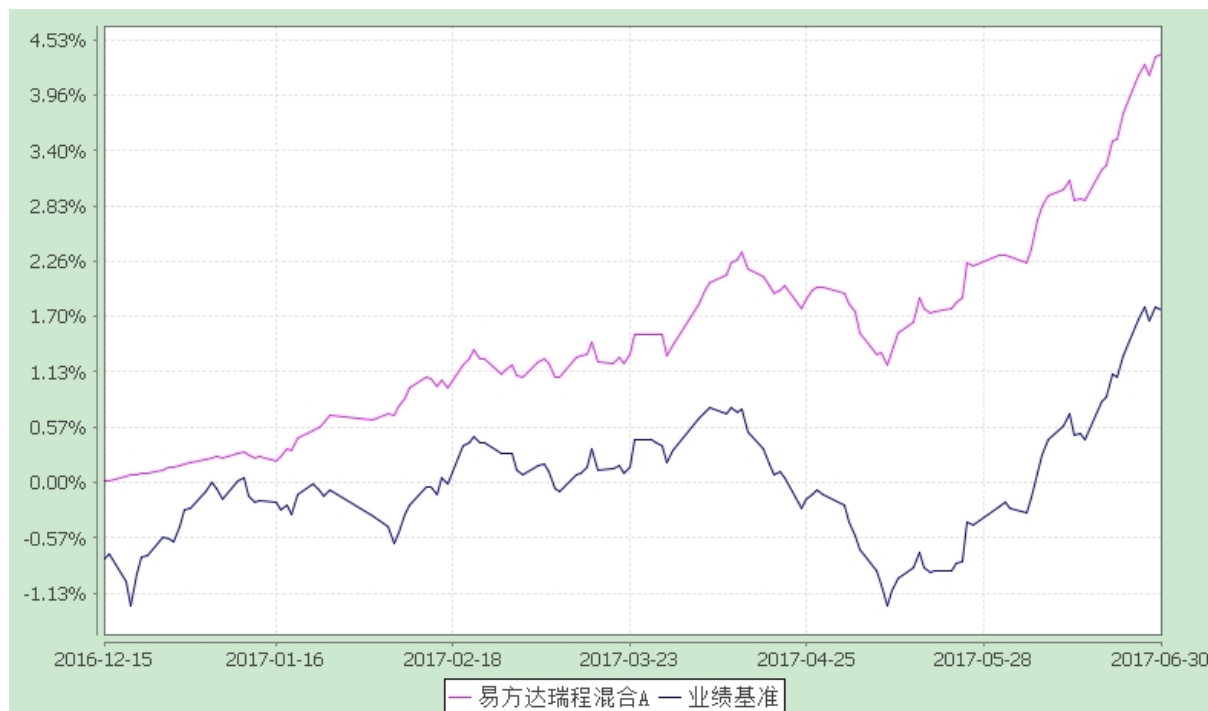
易方达瑞程混合 C

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	2.00%	0.14%	1.98%	0.15%	0.02%	-0.01%
过去三个月	2.90%	0.14%	1.40%	0.16%	1.50%	-0.02%
过去六个月	4.08%	0.12%	2.07%	0.14%	2.01%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.28%	0.11%	1.76%	0.16%	2.52%	-0.05%

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

易方达瑞程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
 (2016 年 12 月 15 日至 2017 年 6 月 30 日)

易方达瑞程混合 A



易方达瑞程混合 C



注：1.本基金合同于 2016 年 12 月 15 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

3. 自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 4.39%，C 类基金份额净值增长率为 4.28%，同期业绩比较基准收益率为 1.76%。

§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		
张清华	本基金的基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新享灵活配置混合型证	2016-12-15	-	10 年	硕士研究生，曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员、易方达基金管理有限公司投资经理。

	券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、固定收益基金投资部总经理				
林森	本基金的基金经理、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2016 年 12 月 10 日至 2017 年 3 月 6 日）、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理	2017-01-26	-	7 年	硕士研究生，曾任道富银行风险管理部风险管理经理、外汇利率交易部利率交易员，太平洋资产管理公司基金管理部基金经理、易方达基金管理有限公司投资经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理助理。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，张清华的“任职日期”为基金合同生效之日，林森的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关助理协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 16 次，其中 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

2017 年上半年债券市场波动较大。基本上，1、2 月经济数据开局良好，基建投资快速上行，房地产投资相对稳定，制造业投资有所下滑，但是仍然相对稳健。补库存需求带动大宗商品价格进一步回升。货币政策进一步收紧，一方面是为了应对美联储加息带来的汇率贬值压力；另一方面也是为了抑制金融资产泡沫进一步膨胀，一季度中国人民银行连续两次上调公开市场操作利率。4 月债券市场出现比较明显的调整。一方面，4 月公布的 3 月各项经济数据大幅超出市场预期，显示经济复苏态势仍然较为稳健。另一方面，金融去杠杆进程推进引发了担忧，市场流动性出现较快的萎缩。同一时间，货币政策保持中性态势，货币市场利率维持高位。银行在负债端的压力也逐步

显现，反映银行融资成本的同业存单利率进一步攀升至高位。5 月，在无风险利率快速上行后，信用债收益率的调整相对滞后，信用利差逐步扩大。进入 6 月，监管协调不断加强，货币政策有所缓和，央行在公开市场通过逆回购方式投放流动性。前期对于季末资金面紧张和监管政策加强的担忧得以缓解，银行同业存单的发行利率从高位开始快速回落。同时，5 月的经济数据有所回落，市场对于经济复苏的前景出现分歧。在多重因素叠加作用下，无风险利率也跟随回落，信用债收益率的下行速度更快，信用利差有所缩窄。但是整体来看，二季度末的利率水平比一季度末仍然出现了比较明显的调整。

权益方面表现相对分化。一季度经济改善持续，企业补库存动力较为强劲，大宗商品价格依然维持高位，通胀预期有所回升，部分盈利改善较多的行业出现明显上涨。4 月开始的流动性冲击对股票市场产生显著影响，6 月流动性冲击缓解后，市场得到一定的修复，同时市场分化也进一步加剧。

报告期内，组合仍然维持中性偏低的久期，保持合适的杠杆比例和组合流动性，继续优化信用债的资质结构，权益类资产维持了较为稳定的配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0439 元，本报告期份额净值增长率为 4.18%；C 类基金份额净值为 1.0428 元，本报告期份额净值增长率为 4.08%；同期业绩比较基准收益率为 2.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年下半年宏观经济运行相对平稳。首先基建投资在下半年存在退出的风险，当前对于地方政府债务的约束可能会对基建产生一定的负面影响，但是考虑到基建投资仍然是支撑经济的主要力量，预计基建投资退出的速度和幅度都会比较温和。其次是地产投资的韧性仍然存在。这一轮地产周期由于供给迟迟没有跟上，尽管销售出现回落但是地产库存仍在下滑。当前全国库存水平都处于偏低状态，存在一定的补库存需求，这意味着地产投资的韧性仍然较强。另外一方面，随着监管协调的加强和央行货币政策有望转向偏中性，银行体系的资产增速下滑速度有望放缓，整体资金的供需有望达到均衡。利率总体处于震荡格局，趋势性的下行需要看到基建和地产投资出现明显的趋势性下滑。需要警惕海外货币紧缩可能带来的全球利率上行压力，这是下半年市场面临的主要风险。

股票市场仍然难以出现趋势性行情，考虑到当前利率偏高，风险偏好难以持续回升，趋势性行情仍需等待。市场对于确定性盈利的安全感寻找仍将持续，结构分化将会进一步加剧。

下半年组合仍然维持中性偏低的久期，保持合适的杠杆比例和组合流动性，继续优化信用债的资质结构，权益类资产继续维持较为稳定的配置比例。

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

易方达瑞程混合 A：本报告期内未实施利润分配。

易方达瑞程混合 C：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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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：易方达瑞程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	3,370,893.22	610,168,326.39
结算备付金		688,145.08	-
存出保证金		91,005.39	-
交易性金融资产	6.4.7.2	699,383,304.39	-
其中：股票投资		150,058,309.19	-
基金投资		-	-
债券投资		549,324,995.20	-
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	18,800,148.20	90,000,000.00
应收证券清算款		184,065.85	6,194.44
应收利息	6.4.7.5	8,880,051.68	1,497,168.28
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		731,397,613.81	701,671,689.11
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		-	-
应付赎回款		2,966.40	-
应付管理人报酬		355,922.01	183,799.38
应付托管费		59,320.33	30,633.24
应付销售服务费		5.49	3.04
应付交易费用	6.4.7.7	9,602.35	-
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	178,520.30	400.00
负债合计		606,336.88	214,835.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	700,070,599.02	700,056,369.95
未分配利润	6.4.7.10	30,720,677.91	1,400,483.50
所有者权益合计		730,791,276.93	701,456,853.45
负债和所有者权益总计		731,397,613.81	701,671,689.11

注：1.本基金合同生效日为2016年12月15日，2016年度实际报告期间为2016年12月15日至2016年12月31日。

2.报告截止日2017年6月30日，A类基金份额净值1.0439元，C类基金份额净值1.0428元；基金份额总额700,070,599.02份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额700,010,979.90份，C类基金份额总额59,619.12份。

6.2 利润表

会计主体：易方达瑞程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
一、收入		33,127,131.06
1.利息收入		14,490,839.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,120,741.07
债券利息收入		9,874,818.01
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		495,279.93
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,859,314.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,616,341.75
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,110,297.09
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	1,353,270.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	14,776,902.68
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	74.53
减：二、费用		3,807,929.18
1. 管理人报酬		2,115,652.13
2. 托管费		352,608.67
3. 销售服务费		33.64
4. 交易费用	6.4.7.18	173,411.91
5. 利息支出		976,836.28
其中：卖出回购金融资产支出		976,836.28
6. 其他费用	6.4.7.19	189,386.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,319,201.88
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,319,201.88

注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 15 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达瑞程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）	700,056,369.95	1,400,483.50	701,456,853.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,319,201.88	29,319,201.88
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）	14,229.07	992.53	15,221.60
其中：1.基金申购款	31,903.44	1,314.63	33,218.07
2.基金赎回款	-17,674.37	-322.10	-17,996.47
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）	700,070,599.02	30,720,677.91	730,791,276.93

注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 15 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达瑞程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[2016]2801号《关于准予易方达瑞程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《易方达瑞程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，《易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 700,056,369.95 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.12 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 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。

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融

负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失):

卖出交易所上市债券: 于成交日确认债券投资收益/(损失), 并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账;

卖出银行间同业市场交易债券: 于成交日确认债券投资收益/(损失), 并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认, 并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认, 并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方, 经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用, 本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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按直线法近似计算。

6.4.4.11 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) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同, 其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(4) 在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;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 营业税、增值税、企业所得税

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。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）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，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

证券投资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，股权的股息、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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

(3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人

所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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	3,370,893.22
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	3,370,893.22

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	135,283,355.69	150,058,309.19	14,774,953.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	85,067,185.17	84,728,995.20	-338,189.97
	银行间市场	464,255,860.85	464,596,000.00	340,139.15
	合计	549,323,046.02	549,324,995.20	1,949.18
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	684,606,401.71	699,383,304.39	14,776,902.68	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	18,800,148.20	-
合计	18,800,148.20	-

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	585.50
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	278.73
应收债券利息	8,869,942.92
应收买入返售证券利息	9,207.72
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	36.81
合计	8,880,051.68

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	4,565.39
银行间市场应付交易费用	5,036.96
合计	9,602.35

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	-
预提费用	178,520.30
合计	178,520.30

6.4.7.9 实收基金

易方达瑞程混合 A

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	700,022,049.85	700,022,049.85
本期申购	3,104.36	3,104.36
本期赎回（以“-”号填列）	-14,174.31	-14,174.31
本期末	700,010,979.90	700,010,979.90

易方达瑞程混合 C

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	34,320.10	34,320.10
本期申购	28,799.08	28,799.08
本期赎回（以“-”号填列）	-3,500.06	-3,500.06
本期末	59,619.12	59,619.12

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

易方达瑞程混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,400,417.84	-	1,400,417.84
本期利润	14,541,633.32	14,776,223.97	29,317,857.29
本期基金份额交易产生的变动数	-102.71	-45.33	-148.04
其中：基金申购款	64.73	48.98	113.71
基金赎回款	-167.44	-94.31	-261.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,941,948.45	14,776,178.64	30,718,127.09

易方达瑞程混合 C

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	65.66	-	65.66
本期利润	665.88	678.71	1,344.59
本期基金份额交易产生的变动数	561.71	578.86	1,140.57
其中：基金申购款	606.25	594.67	1,200.92
基金赎回款	-44.54	-15.81	-60.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,293.25	1,257.57	2,550.82

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	73,835.20
定期存款利息收入	4,032,944.50
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,418.18
其他	543.19
合计	4,120,741.07

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	12,403,638.88
减：卖出股票成本总额	8,787,297.13
买卖股票差价收入	3,616,341.75

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	280,612,933.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	278,178,261.17
减：应收利息总额	3,544,969.88
买卖债券差价收入	-1,110,297.09

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	1,353,270.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,353,270.18

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	14,776,902.68
——股票投资	14,774,953.50
——债券投资	1,949.18
——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	14,776,902.68

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	74.53
其他	-
合计	74.53

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	167,861.91
银行间市场交易费用	5,550.00
合计	173,411.91

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	4,766.25
银行间账户维护费	6,000.00

其他	100.00
合计	189,386.55

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
上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)	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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	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管理费	2,115,652.13
其中:支付销售机构的客户维护费	-

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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托管费	352,608.67

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

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		
	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	33.64	33.64
浦发银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	33.64	33.64

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，按前一日 C 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 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

易方达瑞程混合 A

无。

易方达瑞程混合 C

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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行-活期存款	3,370,893.22	73,835.20
浦发银行-定期存款	-	165,277.78

注：本基金的上述银行存款由基金托管人上海浦东发展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	002867	周大生	新股网下发行	3,444	68,604.48
广发证券	300625	三雄极光	新股网下	3,934	75,926.20

			发行		
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	300669	沪宁股份	新股网下发行	841	9,251.00
广发证券	603041	美思德	新股网下发行	1,034	13,359.28
广发证券	603042	华脉科技	新股网下发行	1,232	13,872.32
广发证券	603043	广州酒家	新股网下发行	1,810	23,855.80
广发证券	603630	拉芳家化	新股网下发行	1,985	36,504.15

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

易方达瑞程混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达瑞程混合 C

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
002859	洁美科技	2017-03-24	2018-04-09	老股转让流通受限	29.82	73.00	6,666	198,780.12	486,618.00	-
002860	星帅尔	2017-03-31	2018-04-12	老股转让	19.81	48.90	7,980	158,083.80	390,222.00	-

				流通受限						
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	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603305	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	-
603331	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	-
603617	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	-
603933	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：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
000061	农产品	2017-06-28	重大事项停牌	9.06	-	-	82,400	998,591.00	746,544.00	-
000100	TCL 集团	2017-04-21	重大事项停牌	3.43	2017-07-26	3.72	379,000	1,331,655.71	1,299,970.00	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大事项停牌	24.93	-	-	28,300	1,271,012.60	705,519.00	-
00242	胜利精	2017-	重大事	7.68	-	-	64,800	526,598.00	497,664.00	-

6	密	01-16	项停牌							
300085	银之杰	2017-06-30	重大事项停牌	18.50	2017-07-07	18.88	47,000	967,094.07	869,500.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项停牌	6.46	-	-	279,700	2,108,651.00	1,806,862.00	-

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。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。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 70.85% (2016 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	112,600,667.40	-
A-1 以下	0.00	-
未评级	288,584,162.55	-
合计	401,184,829.95	-

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	63,948,964.32	-
AAA 以下	93,061,143.85	-
未评级	0.00	-
合计	157,010,108.17	-

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。

本基金的投资范围包括国内依法发行、上市的股票(包括创业板、中小板以及其他依法发行、上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、国债期货、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	3,370,893.22	-	-	-	3,370,893.22
结算备付金	688,145.08	-	-	-	688,145.08
存出保证金	91,005.39	-	-	-	91,005.39
交易性金融资产	396,653,052.40	147,969,000.00	4,702,942.80	150,058,309.19	699,383,304.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	18,800,148.20	-	-	-	18,800,148.20
应收证券清算款	-	-	-	184,065.85	184,065.85
应收利息	-	-	-	8,880,051.68	8,880,051.68
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	419,603,244.29	147,969,000.00	4,702,942.80	159,122,426.72	731,397,613.81
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	-	-	-	2,966.40	2,966.40
应付管理人报酬	-	-	-	355,922.01	355,922.01
应付托管费	-	-	-	59,320.33	59,320.33
应付销售服务费	-	-	-	5.49	5.49
应付交易费用	-	-	-	9,602.35	9,602.35
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	178,520.30	178,520.30
负债总计	-	-	-	606,336.88	606,336.88
利率敏感度缺口	419,603,244.29	147,969,000.00	4,702,942.80	158,516,089.84	730,791,276.93
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2016 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	610,168,326.39	-	-	-	610,168,326.39
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	90,000,000.00	-	-	-	90,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	6,194.44	6,194.44
应收利息	-	-	-	1,497,168.28	1,497,168.28
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	700,168,326.39	-	-	1,503,362.72	701,671,689.11
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	183,799.38	183,799.38
应付托管费	-	-	-	30,633.24	30,633.24
应付销售服务费	-	-	-	3.04	3.04
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	-	-	-	400.00	400.00
负债总计	-	-	-	214,835.66	214,835.66
利率敏感度缺口	700,168,326.39	-	-	1,288,527.06	701,456,853.45

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	1,222,340.86	-
	2.市场利率上升 25 个基点	-1,211,799.92	-

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	150,058,309.19	20.53	-	-
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	150,058,309.19	20.53	-	-

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%	8,886,904.42	-
2.业绩比较基准下降 5%	-8,886,904.42	-	

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 148,103,352.99 元，属于第二层次的余额为 551,279,951.40 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：无属于第一层次的余额，无属于第二层次的余额，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	150,058,309.19	20.52
	其中：股票	150,058,309.19	20.52
2	固定收益投资	549,324,995.20	75.11
	其中：债券	549,324,995.20	75.11
	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	18,800,148.20	2.57
	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	4,059,038.30	0.55
7	其他各项资产	9,155,122.92	1.25
8	合计	731,397,613.81	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	513,015.00	0.07
B	采矿业	4,506,154.00	0.62
C	制造业	55,953,974.92	7.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,775,016.00	0.52
E	建筑业	6,624,711.50	0.91
F	批发和零售业	3,098,471.70	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	3,854,760.00	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,495,077.64	0.62
J	金融业	46,958,561.81	6.43
K	房地产业	8,614,439.50	1.18
L	租赁和商务服务业	2,464,612.12	0.34
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,429,515.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,050,189.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	4,719,811.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	150,058,309.19	20.53

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	601318	中国平安	168,150	8,341,921.50	1.14
2	000651	格力电器	109,100	4,491,647.00	0.61
3	600036	招商银行	178,600	4,270,326.00	0.58
4	601166	兴业银行	223,850	3,774,111.00	0.52

5	000002	万科 A	113,900	2,844,083.00	0.39
6	600900	长江电力	179,900	2,766,862.00	0.38
7	000725	京东方 A	625,200	2,600,832.00	0.36
8	600016	民生银行	286,800	2,357,496.00	0.32
9	000063	中兴通讯	94,200	2,236,308.00	0.31
10	600519	贵州茅台	4,650	2,194,102.50	0.30
11	002466	天齐锂业	36,900	2,005,515.00	0.27
12	000333	美的集团	46,000	1,979,840.00	0.27
13	600309	万华化学	67,680	1,938,355.20	0.27
14	601390	中国中铁	221,650	1,921,705.50	0.26
15	000001	平安银行	204,300	1,918,377.00	0.26
16	600585	海螺水泥	83,400	1,895,682.00	0.26
17	600015	华夏银行	204,240	1,883,092.80	0.26
18	601211	国泰君安	91,650	1,879,741.50	0.26
19	000069	华侨城 A	183,500	1,846,010.00	0.25
20	601988	中国银行	497,400	1,840,380.00	0.25
21	002241	歌尔股份	94,000	1,812,320.00	0.25
22	601989	中国重工	279,700	1,806,862.00	0.25
23	601668	中国建筑	186,500	1,805,320.00	0.25
24	601328	交通银行	291,750	1,797,180.00	0.25
25	600028	中国石化	301,000	1,784,930.00	0.24
26	601398	工商银行	328,450	1,724,362.50	0.24
27	000338	潍柴动力	129,500	1,709,400.00	0.23
28	601336	新华保险	33,200	1,706,480.00	0.23
29	601225	陕西煤业	238,000	1,682,660.00	0.23
30	000568	泸州老窖	32,800	1,659,024.00	0.23
31	000963	华东医药	33,048	1,642,485.60	0.22
32	601111	中国国航	166,700	1,625,325.00	0.22
33	600104	上汽集团	51,950	1,613,047.50	0.22
34	600029	南方航空	184,950	1,609,065.00	0.22
35	002142	宁波银行	82,400	1,590,320.00	0.22
36	601688	华泰证券	83,750	1,499,125.00	0.21
37	000895	双汇发展	58,700	1,394,125.00	0.19
38	002146	荣盛发展	136,200	1,344,294.00	0.18
39	002594	比亚迪	26,600	1,328,670.00	0.18
40	000783	长江证券	139,800	1,323,906.00	0.18
41	000100	TCL 集团	379,000	1,299,970.00	0.18
42	000858	五粮液	23,300	1,296,878.00	0.18
43	002081	金螳螂	117,800	1,293,444.00	0.18
44	002736	国信证券	97,500	1,291,875.00	0.18
45	300070	碧水源	68,900	1,284,985.00	0.18
46	002007	华兰生物	35,100	1,281,150.00	0.18
47	002230	科大讯飞	31,700	1,264,830.00	0.17
48	000402	金融街	105,900	1,241,148.00	0.17

49	600208	新潮中宝	273,400	1,230,300.00	0.17
50	600019	宝钢股份	180,800	1,213,168.00	0.17
51	002202	金风科技	77,300	1,195,831.00	0.16
52	601600	中国铝业	263,800	1,192,376.00	0.16
53	002673	西部证券	82,404	1,171,784.88	0.16
54	001979	招商蛇口	53,700	1,147,032.00	0.16
55	000768	中航飞机	62,100	1,145,124.00	0.16
56	601555	东吴证券	101,450	1,139,283.50	0.16
57	002456	欧菲光	62,500	1,135,625.00	0.16
58	000938	紫光股份	18,300	1,118,496.00	0.15
59	000709	河钢股份	259,400	1,086,886.00	0.15
60	300144	宋城演艺	51,900	1,083,153.00	0.15
61	600031	三一重工	132,500	1,077,225.00	0.15
62	300015	爱尔眼科	45,150	1,050,189.00	0.14
63	600887	伊利股份	48,150	1,039,558.50	0.14
64	600188	兖州煤业	84,850	1,038,564.00	0.14
65	000559	万向钱潮	96,720	1,027,166.40	0.14
66	002739	万达电影	20,000	1,019,400.00	0.14
67	002424	贵州百灵	53,700	1,012,782.00	0.14
68	000027	深圳能源	149,800	1,008,154.00	0.14
69	600030	中信证券	58,950	1,003,329.00	0.14
70	300002	神州泰岳	119,500	996,630.00	0.14
71	601288	农业银行	274,800	967,296.00	0.13
72	601169	北京银行	104,850	961,474.50	0.13
73	000686	东北证券	94,200	946,710.00	0.13
74	600837	海通证券	61,750	916,987.50	0.13
75	002183	怡亚通	105,900	913,917.00	0.13
76	002500	山西证券	92,500	886,150.00	0.12
77	000156	华数传媒	58,700	875,217.00	0.12
78	300133	华策影视	78,100	874,720.00	0.12
79	002024	苏宁云商	77,300	869,625.00	0.12
80	300085	银之杰	47,000	869,500.00	0.12
81	300251	光线传媒	105,900	867,321.00	0.12
82	000876	新希望	102,500	842,550.00	0.12
83	601601	中国太保	24,749	838,248.63	0.11
84	600867	通化东宝	43,800	798,912.00	0.11
85	002027	分众传媒	55,400	762,304.00	0.10
86	000061	农产品	82,400	746,544.00	0.10
87	002074	国轩高科	22,900	722,495.00	0.10
88	600252	中恒集团	176,700	713,868.00	0.10
89	000503	海虹控股	28,300	705,519.00	0.10
90	000625	长安汽车	48,800	703,696.00	0.10
91	601939	建设银行	111,650	686,647.50	0.09
92	000157	中联重科	149,100	669,459.00	0.09

93	600068	葛洲坝	59,300	666,532.00	0.09
94	601018	宁波港	109,800	620,370.00	0.08
95	600297	广汇汽车	77,870	586,361.10	0.08
96	601766	中国中车	56,400	570,768.00	0.08
97	002415	海康威视	17,400	562,020.00	0.08
98	601618	中国中冶	111,650	559,366.50	0.08
99	002299	圣农发展	34,500	513,015.00	0.07
100	002426	胜利精密	64,800	497,664.00	0.07
101	600111	北方稀土	43,000	487,190.00	0.07
102	002859	洁美科技	6,666	486,618.00	0.07
103	600383	金地集团	41,550	476,578.50	0.07
104	601633	长城汽车	29,800	396,042.00	0.05
105	002860	星帅尔	7,980	390,222.00	0.05
106	601186	中国铁建	31,450	378,343.50	0.05
107	600048	保利地产	33,200	331,004.00	0.05
108	000826	启迪桑德	8,500	298,520.00	0.04
109	600839	四川长虹	76,500	276,930.00	0.04
110	600637	东方明珠	12,700	275,209.00	0.04
111	002153	石基信息	11,600	263,668.00	0.04
112	603833	欧派家居	2,329	255,863.94	0.04
113	000728	国元证券	19,800	241,956.00	0.03
114	300024	机器人	10,000	195,000.00	0.03
115	000630	铜陵有色	67,100	190,564.00	0.03
116	300017	网宿科技	9,286	112,082.02	0.02
117	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
118	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
119	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
120	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.01
121	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
122	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
123	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
124	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
125	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
126	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
127	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
128	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
129	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
130	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
131	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
132	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
133	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
134	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
135	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
136	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	601318	中国平安	6,604,730.00	0.94
2	601166	兴业银行	4,079,678.30	0.58
3	600036	招商银行	3,642,129.62	0.52
4	600016	民生银行	2,844,169.53	0.41
5	000651	格力电器	2,787,754.00	0.40
6	600900	长江电力	2,534,683.35	0.36
7	000002	万 科 A	2,523,548.00	0.36
8	601390	中国中铁	2,178,000.00	0.31
9	601989	中国重工	2,108,651.00	0.30
10	600015	华夏银行	2,089,903.00	0.30
11	000001	平安银行	2,017,259.00	0.29
12	000725	京东方 A	2,005,390.00	0.29
13	600028	中国石化	1,942,110.00	0.28
14	601988	中国银行	1,930,173.00	0.28
15	601328	交通银行	1,896,428.00	0.27
16	601211	国泰君安	1,892,796.24	0.27
17	600519	贵州茅台	1,790,635.64	0.26
18	601668	中国建筑	1,790,041.00	0.26
19	601688	华泰证券	1,685,776.00	0.24
20	601336	新华保险	1,641,200.00	0.23

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	601318	中国平安	550,152.00	0.08
2	601166	兴业银行	410,841.50	0.06
3	600036	招商银行	364,721.00	0.05
4	601228	广州港	334,046.65	0.05
5	600016	民生银行	238,220.00	0.03
6	300625	三雄极光	221,827.60	0.03
7	600900	长江电力	211,241.00	0.03
8	601952	苏垦农发	196,511.25	0.03

9	601988	中国银行	190,593.00	0.03
10	601878	浙商证券	184,266.44	0.03
11	601390	中国中铁	177,355.50	0.03
12	600015	华夏银行	169,950.00	0.02
13	601688	华泰证券	169,946.00	0.02
14	600028	中国石化	169,440.00	0.02
15	600519	贵州茅台	159,390.83	0.02
16	601211	国泰君安	158,427.50	0.02
17	601328	交通银行	156,712.50	0.02
18	603225	新凤鸣	149,882.63	0.02
19	000002	万科A	149,112.00	0.02
20	601668	中国建筑	146,720.00	0.02

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	144,070,652.82
卖出股票收入（成交）总额	12,403,638.88

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,968,000.00	5.47
	其中：政策性金融债	39,968,000.00	5.47
4	企业债券	80,757,892.40	11.05
5	企业短期融资券	110,402,000.00	15.11
6	中期票据	69,636,000.00	9.53
7	可转债（可交换债）	3,971,102.80	0.54
8	同业存单	244,590,000.00	33.47

9	其他	-	-
10	合计	549,324,995.20	75.17

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111717029	17 光大银行 CD029	1,000,000	97,870,000.00	13.39
2	041654052	16 西南水泥 CP002	500,000	50,195,000.00	6.87
3	111714059	17 江苏银行 CD059	500,000	48,935,000.00	6.70
4	111708089	17 中信银行 CD089	500,000	48,895,000.00	6.69
5	111715075	17 民生银行 CD075	500,000	48,890,000.00	6.69

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

7.12.117 民生银行 CD075（代码：111715075）为易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的前十大持仓证券。2016 年 10 月 8 日，中国人民银行营业管理部对民生银行违反《征信管理条例》相关规定处以人民币 40 万元的行政处罚。2017 年 3 月 29 日，中国银监会针对民生银行批量转让个人贷款、安排回购条件以及未按规定进行信息披露；违规转让非不良贷款，处以人民币 70 万元的行政处罚。

本基金投资 17 民生银行 CD075 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 17 民生银行 CD075 外，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。

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	91,005.39
2	应收证券清算款	184,065.85
3	应收股利	-
4	应收利息	8,880,051.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,155,122.92

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
易方达瑞程混合 A	77	9,091,051.69	699,999,000.00	100.00%	11,979.90	0.00%
易方达瑞程混合 C	209	285.26	0.00	0.00%	59,619.12	100.00%
合计	286	2,447,799.30	699,999,000.00	99.99%	71,599.02	0.01%

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	易方达瑞程混合 A	2,779.95	0.0004%
	易方达瑞程混合 C	12,680.04	21.2684%
	合计	15,459.99	0.0022%

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	易方达瑞程混合 A	0
	易方达瑞程混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达瑞程混合 A	0
	易方达瑞程混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 15 日）基金份额总额	700,022,049.85	34,320.10
本报告期期初基金份额总额	700,022,049.85	34,320.10
本报告期基金总申购份额	3,104.36	28,799.08
减：本报告期基金总赎回份额	14,174.31	3,500.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	700,010,979.90	59,619.12

§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	
申万宏源	2	153,559,804.02	100.00%	141,573.90	100.00%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增申万宏源证券有限公司两个交易单元。

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。

10.7.2 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

				比例		
申万宏源	101,450,218.20	100.00%	1,268,100,000.00	100.00%	-	-

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	易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-26
2	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
3	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
4	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
5	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
6	易方达基金管理有限公司关于易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-13
7	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
8	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
9	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
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	2017-04-19
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购周大生珠宝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	2017-04-22

12	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
13	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
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购南京华脉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	2017-05-25
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	2017-06-17
16	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
17	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购杭州沪宁电梯部件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	2017-06-23
18	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	699,999,000.00	-	-	699,999,000.00	99.99%
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程灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达瑞程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