

易方达瑞财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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	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	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	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	39
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	39
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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	40

§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
§12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达瑞财混合	
基金主代码	001802	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 2 月 4 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,085,210,629.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞财混合 I	易方达瑞财混合 E
下属分级基金的交易代码	001802	001803
报告期末下属分级基金的份额总额	1,084,454,026.43 份	756,602.87 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，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。债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。在券种选择上，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，实施积极主动的债券投资管理。股票投资策略方面，本基金通过对行业景气度、竞争格局等因素的分析，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置比例确定的基础上，对公司基本面和估值情况进行综合考虑，优选个股进行股票组合的构建，并根据市场和基本面的变化动态调整。
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率×75%+沪深 300 指数收益率×25%
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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	张燕
	联系电话	020-85102688	0755-83199084
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95555
传真		020-85104666	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	深圳市福田区深南大道7088号 招商银行大厦
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	深圳市福田区深南大道7088号 招商银行大厦
邮政编码		510620	518040
法定代表人		刘晓艳	李建红

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）	
	易方达瑞财混合 I	易方达瑞财混合 E
本期已实现收益	6,940,571.88	4,053.83
本期利润	24,031,370.83	15,946.96
加权平均基金份额本期利润	0.0222	0.0211

本期加权平均净值利润率	2.14%	2.04%
本期基金份额净值增长率	2.13%	2.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
	易方达瑞财混合 I	易方达瑞财混合 E
期末可供分配利润	58,982,263.98	38,835.16
期末可供分配基金份额利润	0.0544	0.0513
期末基金资产净值	1,143,436,290.41	795,438.03
期末基金份额净值	1.054	1.051
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
	易方达瑞财混合 I	易方达瑞财混合 E
基金份额累计净值增长率	5.40%	5.10%

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。

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

易方达瑞财混合 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	1.74%	0.13%	2.17%	0.18%	-0.43%	-0.05%
过去三个月	1.15%	0.11%	1.69%	0.18%	-0.54%	-0.07%
过去六个月	2.13%	0.10%	2.61%	0.17%	-0.48%	-0.07%
过去一年	3.43%	0.12%	4.17%	0.20%	-0.74%	-0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	5.40%	0.14%	7.29%	0.25%	-1.89%	-0.11%

易方达瑞财混合 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	1.74%	0.12%	2.17%	0.18%	-0.43%	-0.06%
过去三个月	1.15%	0.11%	1.69%	0.18%	-0.54%	-0.07%
过去六个月	2.04%	0.10%	2.61%	0.17%	-0.57%	-0.07%
过去一年	3.24%	0.12%	4.17%	0.20%	-0.93%	-0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-

自基金合同生效起至今	5.10%	0.14%	7.29%	0.25%	-2.19%	-0.11%
------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

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

易方达瑞财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 2 月 4 日至 2017 年 6 月 30 日)

易方达瑞财混合 I



易方达瑞财混合 E



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，I类基金份额净值增长率为5.40%，E类基金份额净值增长率为5.10%，同期业绩比较基准收益率为7.29%。

§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		
胡剑	本基金的基金经理、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、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞富灵活配置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、易方达丰惠混合型证券投资基金的基金经理、固定收益研究部总经理	2016-02-04	-	11 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理。

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

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

2017 年上半年基本面维持震荡格局。一季度经济整体呈现回升走势，房地产和基建投资连续三个月大幅走高，成为拉动投资的主要力量；4、5 月这两项投资都有所回落，拉动经济数据略有走低。基建投资在 6 月再度发力带动各项经济数据再度好转。制造业投资持续表现偏弱，显示经济内生增长动力并不强。融资数据表现平稳，广义社融略有下滑，不过自去年底以来的各项金融监管升级，使得银行在表外理财、非标、同业投资方面的扩张迅速收缩，很多表外的融资渠道大幅减少，在一定程度上将增加实体经济中部分主体的融资难度。物价数据则在 3 月之后持续保持稳定，对市场影响不大。货币政策方面，央行保持了中性偏紧的态度，但是在维护月末、季末资金面稳定方面态度较为明确，尤其在二季度银监会出台更加严厉的银行监管措施之后，央行对待资金面的态度较一季度环比改善。

债券市场收益率受资金面波动、经济回升、监管收紧等因素影响，1 月份快速上行，之后 10 年期国开债收益率基本在 4.1%-4.3% 之间震荡，在 3 月中下旬和 6 月中下旬分别出现两拨较为明显的冲高回落。信用利差一季度相对稳定，4 月中旬受银监会加强银行监管、委外赎回预期增强影响，出现较为明显的回升，6 月开始市场情绪逐步缓解，利差再度回落，基本回到 3 月底的低点，高等级利差略有上行。

权益类资产分化严重，大盘蓝筹股表现较好，沪深 300 指数、上证 50 指数分别上涨 10.8% 和 11.5%，但创业板指数下跌 7.3%。

操作上，本组合整体维持了相对偏短的久期和仓位，有效降低了今年以来债市收益上行带来的净值波动。3 月中下旬组合进行过一次波段操作，以中高等级的中票、利率债、短融为主要增持品

种，并在 4 月上旬卖出。6 月以来组合适当提高了一些利率债的仓位，增加组合有效久期至 2 年附近。权益方面，主要配置了打新需要的最低仓位，仓位变动不大，但是积极进行结构调整，获取较为可观的超额收益。

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 1.054 元，本报告期份额净值增长率为 2.13%；E 类基金份额净值为 1.051 元，本报告期份额净值增长率为 2.04%；同期业绩比较基准收益率为 2.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为基本面在下半年出现走低的概率上升，但是短期 1-2 个月可能仍然维持相对较好的态势。债券市场有望维持区间震荡的行情，等待基本面的变化后确定方向。

经济方面，我们认为今年以来经济上行的推动力主要来自基建投资的支撑，而这一推动力有望在下半年出现下滑。首先，上半年财政支出进度显著快于往年，在赤字率一定的情况下，下半年的支出空间大幅减少；其次，随着经济的走好，针对地方政府债务的限制提到了前所未有的高度，财政部相继发文严控各类“政府隐性担保”的融资，这将在很大程度上限制地方政府的投资能力；第三，在经济走好的大环境下，财政刺激的必要性下降，因此政策层面主动推动基建投资项目的积极性也会下降。另一方面，我们观察到今年以来制造业投资一直处于偏弱的水平，说明经济实际的内生动力不强。从融资环境上来讲，自 2016 四季度以来的金融监管升级不断推动金融机构“去杠杆”，各类同业、非标、通道业务增速下降，这必然在一定程度上增加实体企业的融资难度，最终表现到企业的融资成本上，对经济造成负面影响。

监管层面，我们认为政策协调能力逐步加强，市场预期相对充分，下半年继续出现流动性冲击的可能性较小，这使得债券市场再次出现预期外大幅度上升的可能性下降。

但是短期来看，我们看到上述负面因素尚未对经济产生明显的负面冲击，微观价格、企业生产情况仍然延续上半年的相对较好的走势。房地产板块受到三、四线城市快速去库存的影响，投资可能在短期也有一定的提振。这些因素使得债市短期出现快速上涨的可能性也不大。

实际操作中，本组合计划维持目前的久期，根据市场情况适度调整结构，优选一些性价比高的个券，同时积极调整组合的流动性和灵活性，等待经济下行信号进一步增加久期和仓位。权益方面，我们维持打新的最低仓位，主要从自下而上的角度，选择真正具备投资价值的品种。

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

易方达瑞财混合 I：本报告期内未实施利润分配。

易方达瑞财混合 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：易方达瑞财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	880,706.86	626,027.81
结算备付金		-	1,723,239.77
存出保证金		63,236.04	29,107.96
交易性金融资产	6.4.7.2	1,270,796,426.00	1,157,018,492.87
其中：股票投资		84,943,449.20	1,621,215.07
基金投资		-	-
债券投资		1,185,852,976.80	1,155,397,277.80
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	21,519,985.08	28,182,920.70
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		1,293,260,353.98	1,187,579,789.11
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		147,999,500.00	65,999,701.00

应付证券清算款		27,123.89	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		558,114.30	571,262.19
应付托管费		139,528.59	142,815.54
应付销售服务费		129.38	132.64
应付交易费用	6.4.7.7	29,728.07	149,017.14
应交税费		-	-
应付利息		76,145.22	53,608.72
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	198,356.09	300,000.00
负债合计		149,028,625.54	67,216,537.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,085,210,629.30	1,085,383,364.35
未分配利润	6.4.7.10	59,021,099.14	34,979,887.53
所有者权益合计		1,144,231,728.44	1,120,363,251.88
负债和所有者权益总计		1,293,260,353.98	1,187,579,789.11

注：1.本基金合同生效日为 2016 年 2 月 4 日，2016 年度实际报告期间为 2016 年 2 月 4 日至 2016 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2017 年 6 月 30 日，I 类基金份额净值 1.054 元，E 类基金份额净值 1.051 元；基金份额总额 1,085,210,629.30 份，下属分级基金的份额总额分别为：I 类基金份额总额 1,084,454,026.43 份，E 类基金份额总额 756,602.87 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达瑞财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 2 月 4 日（基 金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		31,393,904.85	15,104,771.30
1.利息收入		31,533,728.75	17,679,173.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,522.80	637,703.68
债券利息收入		30,526,373.37	16,994,092.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		981,832.58	47,377.13
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,242,527.91	-1,777,163.48

其中：股票投资收益	6.4.7.12	276,738.26	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-18,312,682.76	-2,104,163.48
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	793,416.59	327,000.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	17,102,692.08	-797,275.63
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	11.93	37.03
减：二、费用		7,346,587.06	4,404,940.93
1. 管理人报酬		3,349,940.90	2,218,724.05
2. 托管费		837,485.26	416,010.73
3. 销售服务费		776.89	796.97
4. 交易费用	6.4.7.18	140,262.63	50,430.06
5. 利息支出		2,790,169.70	1,574,123.19
其中：卖出回购金融资产支出		2,790,169.70	1,574,123.19
6. 其他费用	6.4.7.19	227,951.68	144,855.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,047,317.79	10,699,830.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,047,317.79	10,699,830.37

注：本基金合同生效日为 2016 年 2 月 4 日，上年度可比期间为 2016 年 2 月 4 日至 2016 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达瑞财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）	1,085,383,364.35	34,979,887.53	1,120,363,251.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,047,317.79	24,047,317.79
三、本期基金份额交易产	-172,735.05	-6,106.18	-178,841.23

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	-172,735.05	-6,106.18	-178,841.23
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）	1,085,210,629.30	59,021,099.14	1,144,231,728.44
项目	上年度可比期间		
	2016年2月4日（基金合同生效日）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）	401,758,575.59	-	401,758,575.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,699,830.37	10,699,830.37
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）	493,532,614.14	6,416,365.59	499,948,979.73
其中：1.基金申购款	493,581,441.26	6,416,558.74	499,998,000.00
2.基金赎回款	-48,827.12	-193.15	-49,020.27
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）	895,291,189.73	17,116,195.96	912,407,385.69

注：本基金合同生效日为2016年2月4日，上年度可比期间为2016年2月4日至2016年6月30日。

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

易方达瑞财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]1895号《关于准予易方达瑞财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《易方达瑞财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，《易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 2 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 401,758,575.59 份基金份额，其中认购资金利息折合 8,005.85 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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 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

(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	880,706.86
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	880,706.86

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	72,142,496.05	84,943,449.20	12,800,953.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	93,631,763.07	91,856,876.80
	银行间市场	1,116,067,431.45	1,093,996,100.00
	合计	1,209,699,194.52	1,185,852,976.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,281,841,690.57	1,270,796,426.00	-11,045,264.57

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	393.89
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	-
应收债券利息	21,519,562.69
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	28.50
合计	21,519,985.08

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	6,921.55
银行间市场应付交易费用	22,806.52
合计	29,728.07

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	198,356.09
合计	198,356.09

6.4.7.9 实收基金

易方达瑞财混合 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	1,084,626,321.48	1,084,626,321.48
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-172,295.05	-172,295.05
本期末	1,084,454,026.43	1,084,454,026.43

易方达瑞财混合 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	757,042.87	757,042.87
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-440.00	-440.00

本期末	756,602.87	756,602.87
-----	------------	------------

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

易方达瑞财混合 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	58,238,121.65	-23,281,138.13	34,956,983.52
本期利润	6,940,571.88	17,090,798.95	24,031,370.83
本期基金份额交易产生的变动数	-9,383.34	3,292.97	-6,090.37
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-9,383.34	3,292.97	-6,090.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,169,310.19	-6,187,046.21	58,982,263.98

易方达瑞财混合 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	39,118.10	-16,214.09	22,904.01
本期利润	4,053.83	11,893.13	15,946.96
本期基金份额交易产生的变动数	-23.36	7.55	-15.81
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-23.36	7.55	-15.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,148.57	-4,313.41	38,835.16

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	15,882.86
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	9,026.92
其他	613.02
合计	25,522.80

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	18,619,931.41

减：卖出股票成本总额	18,343,193.15
买卖股票差价收入	276,738.26

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	1,029,366,621.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,016,212,363.96
减：应收利息总额	31,466,940.10
买卖债券差价收入	-18,312,682.76

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	793,416.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	793,416.59

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	17,102,692.08
——股票投资	11,824,575.71
——债券投资	5,278,116.37
——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	17,102,692.08

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	11.93
其他	-
合计	11.93

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	126,427.63
银行间市场交易费用	13,835.00
合计	140,262.63

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	49,588.57
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	10,995.59
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	227,951.68

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

易方达瑞财混合 I：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2017 年 7 月 20 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.50 元，分配金额为 54,222,700.89 元。

易方达瑞财混合 E：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2017 年 7 月 20 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.50 元，分配金额为 37,823.64 元。

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
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	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2月4日（基金合同 生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,349,940.90	2,218,724.05
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

基金管理费每日计算，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前 3 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、公休假等，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	上年度可比期间 2016年2月4日（基金合同 生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	837,485.26	416,010.73

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

基金托管费每日计算，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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，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		
	易方达瑞财混合 I	易方达瑞财混合 E	合计
易方达基金管理有限公司	-	776.89	776.89
招商银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	776.89	776.89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年2月4日（基金合同生效日）至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞财混合 I	易方达瑞财混合 E	合计
易方达基金管理有限公司	-	796.97	796.97
招商银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	796.97	796.97

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

销售服务费每日计提，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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，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**

本报告期内和上年度可比期间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**易方达瑞财混合 I**

无。

易方达瑞财混合 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年2月4日（基金合同生效 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
招商银行-活期存款	880,706.86	15,882.86	1,401,365.96	26,477.54

注：本基金的上述银行存款由基金托管人招商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	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
上年度可比期间 2016年2月4日（基金合同生效日）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

				位：股/张)	
广发证券	300518	盛讯达	新股网下 发行	1,306	29,019.32
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

易方达瑞财混合 I

本报告期内未发生利润分配。根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2017 年 7 月 20 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.50 元，分配金额为 54,222,700.89 元。

易方达瑞财混合 E

本报告期内未发生利润分配。根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2017 年 7 月 20 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.50 元，分配金额为 37,823.64 元。

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
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	-
603660	苏州科达	2016-11-21	2017-12-01	老股转让流通受限	8.03	40.95	26,007	208,836.21	1,064,986.65	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股流通	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

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

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) 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 119,999,500.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
170206	17 国开 06	2017-07-06	99.60	500,000	49,800,000.00
150417	15 农发 17	2017-07-07	100.01	200,000	20,002,000.00
160311	16 进出 11	2017-07-07	99.58	500,000	49,790,000.00
合计				1,200,000	119,592,000.00

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 28,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 89.72% (2016 年 12 月 31 日：99.27%)。

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	70,925,716.71	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	263,503,397.26	81,414,260.49
合计	334,429,113.97	81,414,260.49

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	225,263,787.63	223,780,006.19
AAA 以下	578,097,155.70	878,384,671.22
未评级	69,582,482.19	0.00
合计	872,943,425.52	1,102,164,677.41

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、中小板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、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、权证、国债期货、股指期货、期权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 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	880,706.86	-	-	-	880,706.86
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	63,236.04	-	-	-	63,236.04
交易性金融资产	387,948,800.00	722,682,316.00	75,221,860.80	84,943,449.20	1,270,796,426.00
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	-	-	-	21,519,985.08	21,519,985.08
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	388,892,742.90	722,682,316.00	75,221,860.80	106,463,434.28	1,293,260,353.98
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	147,999,500.00	-	-	-	147,999,500.00
应付证券清算款	-	-	-	27,123.89	27,123.89
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	558,114.30	558,114.30
应付托管费	-	-	-	139,528.59	139,528.59
应付销售服务费	-	-	-	129.38	129.38

应付交易费用	-	-	-	29,728.07	29,728.07
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	76,145.22	76,145.22
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	198,356.09	198,356.09
负债总计	147,999,500.00	-	-	1,029,125.54	149,028,625.54
利率敏感度缺口	240,893,242.90	722,682,316.00	75,221,860.80	105,434,308.74	1,144,231,728.44
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	626,027.81	-	-	-	626,027.81
结算备付金	1,723,239.77	-	-	-	1,723,239.77
存出保证金	29,107.96	-	-	-	29,107.96
交易性金融资产	126,931,000.00	878,236,538.20	150,229,739.60	1,621,215.07	1,157,018,492.87
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	-	-	-	28,182,920.70	28,182,920.70
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	129,309,375.54	878,236,538.20	150,229,739.60	29,804,135.77	1,187,579,789.11
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	65,999,701.00	-	-	-	65,999,701.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	571,262.19	571,262.19
应付托管费	-	-	-	142,815.54	142,815.54
应付销售服务费	-	-	-	132.64	132.64
应付交易费用	-	-	-	149,017.14	149,017.14
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	53,608.72	53,608.72
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	300,000.00	300,000.00
负债总计	65,999,701.00	-	-	1,216,836.23	67,216,537.23
利率敏感度缺口	63,309,674.54	878,236,538.20	150,229,739.60	28,587,299.54	1,120,363,251.88

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	5,739,666.50	6,984,881.19
2.市场利率上升25个基点	-5,678,359.56	-6,901,501.45	

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	上年度末
----	-----	------

	2017 年 6 月 30 日		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	84,943,449.20	7.42	1,621,215.07	0.14
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	84,943,449.20	7.42	1,621,215.07	0.14

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%	4,482,028.78	36,683.88
	2.业绩比较基准下降 5%	-4,482,028.78	-36,683.88

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 91,919,375.00 元，属于第二层次的余额为 1,178,877,051.00 元，无属于第三

层次的余额(2016年12月31日：第一层次2,310,314.66元，第二层次1,154,708,178.21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	84,943,449.20	6.57
	其中：股票	84,943,449.20	6.57
2	固定收益投资	1,185,852,976.80	91.69
	其中：债券	1,185,852,976.80	91.69
	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	880,706.86	0.07
7	其他各项资产	21,583,221.12	1.67
8	合计	1,293,260,353.98	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	-	-
C	制造业	34,756,556.17	3.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,618,649.54	0.75
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	41,568,243.49	3.63
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	84,943,449.20	7.42

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	500,000	24,805,000.00	2.17
2	601398	工商银行	3,157,200	16,575,300.00	1.45
3	600887	伊利股份	659,359	14,235,560.81	1.24
4	600332	白云山	397,103	11,531,871.12	1.01
5	000498	山东路桥	1,199,982	8,579,871.30	0.75
6	600104	上汽集团	185,200	5,750,460.00	0.50
7	300068	南都电源	113,700	1,914,708.00	0.17
8	603660	苏州科达	26,007	1,064,986.65	0.09
9	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.02
10	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
11	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
12	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
13	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
14	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
15	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
16	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
17	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
18	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
19	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
20	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
21	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	18,053,790.00	1.61
2	601398	工商银行	14,699,513.00	1.31
3	600500	中化国际	12,179,471.00	1.09
4	600887	伊利股份	11,993,472.25	1.07
5	000498	山东路桥	10,237,333.24	0.91
6	600332	白云山	9,995,833.14	0.89
7	603806	福斯特	4,722,392.23	0.42

8	600104	上汽集团	4,697,452.03	0.42
9	300068	南都电源	1,995,392.70	0.18
10	601952	苏垦农发	97,161.00	0.01
11	601878	浙商证券	93,364.05	0.01
12	603225	新凤鸣	85,295.96	0.01
13	601366	利群股份	74,088.00	0.01
14	603980	吉华集团	59,322.80	0.01
15	603920	世运电路	47,125.00	0.00
16	603113	金能科技	46,741.52	0.00
17	603586	金麒麟	43,723.02	0.00
18	603385	惠达卫浴	36,492.50	0.00
19	603801	志邦股份	32,998.82	0.00
20	603803	瑞斯康达	30,801.40	0.00

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	600500	中化国际	11,868,155.56	1.06
2	603806	福斯特	3,202,039.75	0.29
3	601375	中原证券	232,513.45	0.02
4	603986	兆易创新	185,698.70	0.02
5	601952	苏垦农发	173,680.50	0.02
6	601366	利群股份	147,445.00	0.01
7	603225	新凤鸣	145,156.31	0.01
8	603877	太平鸟	122,319.80	0.01
9	603980	吉华集团	109,264.32	0.01
10	603920	世运电路	102,538.25	0.01
11	603298	杭叉集团	95,544.84	0.01
12	603113	金能科技	93,028.56	0.01
13	603385	惠达卫浴	89,209.83	0.01
14	603586	金麒麟	85,727.40	0.01
15	603803	瑞斯康达	73,007.40	0.01
16	603886	元祖股份	71,806.82	0.01
17	603218	日月股份	71,666.12	0.01
18	603728	鸣志电器	69,635.59	0.01
19	603050	科林电气	68,083.56	0.01
20	603906	龙蟠科技	67,810.13	0.01

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	89,840,851.57
卖出股票收入（成交）总额	18,619,931.41

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	119,592,000.00	10.45
	其中：政策性金融债	119,592,000.00	10.45
4	企业债券	557,555,900.00	48.73
5	企业短期融资券	260,709,000.00	22.78
6	中期票据	180,641,000.00	15.79
7	可转债（可交换债）	8,145,076.80	0.71
8	同业存单	-	-
9	其他	59,210,000.00	5.17
10	合计	1,185,852,976.80	103.64

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	011755031	17 淮南矿 SCP004	600,000	60,234,000.00	5.26
2	101759015	17 远洋集团 MTN001A	500,000	50,215,000.00	4.39

3	170206	17 国开 06	500,000	49,800,000.00	4.35
4	160311	16 进出 11	500,000	49,790,000.00	4.35
5	101558043	15 金地 MTN003	500,000	49,175,000.00	4.30

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	63,236.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	21,519,985.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,583,221.12

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120001	16 以岭 EB	1,169,151.00	0.10
2	127003	海印转债	620,065.00	0.05
3	128013	洪涛转债	178,288.00	0.02

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603660	苏州科达	1,064,986.65	0.09	老股转让流通受限

§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
易方达瑞财混合 I	60	18,074,233.77	1,084,244,303.99	99.98%	209,722.44	0.02%

易方达瑞财混合 E	183	4,134.44	0.00	0.00%	756,602.87	100.00%
合计	243	4,465,887.36	1,084,244,303.99	99.91%	966,325.31	0.09%

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	易方达瑞财混合 I	1,080.63	0.0001%
	易方达瑞财混合 E	2,640.02	0.3489%
	合计	3,720.65	0.0003%

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	易方达瑞财混合 I	0
	易方达瑞财混合 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达瑞财混合 I	0
	易方达瑞财混合 E	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达瑞财混合 I	易方达瑞财混合 E
基金合同生效日（2016 年 2 月 4 日）基金份额总额	400,754,322.69	1,004,252.90
本报告期期初基金份额总额	1,084,626,321.48	757,042.87
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	172,295.05	440.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,084,454,026.43	756,602.87

§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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	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	
新时代证券	1	12,426,977.55	11.59%	9,941.52	10.13%	-
东方证券	1	240,824.34	0.22%	192.66	0.20%	-
高华证券	2	94,526,779.11	88.18%	88,032.56	89.68%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增广发证券股份有限公司四个交易单元。

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 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
新时代证券	-	-	10,000,000.00	1.02%	-	-
东方证券	-	-	31,000,000.00	3.17%	-	-
高华证券	129,148,257.09	100.00%	938,200,000.00	95.81%	-	-

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
2	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
3	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
4	易方达基金管理有限公司关于易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金、易方达保本一号混合型证券投资基金修改托管协议的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-08
5	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
6	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
7	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
8	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	1,084,244,303.99	-	-	1,084,244,303.99	99.91%
产品特有风险							
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。

§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财灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达瑞财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