

易方达科讯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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
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	40
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	45
11	备查文件目录	48
11.1	备查文件目录	48
11.2	存放地点	49
11.3	查阅方式	49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达科讯混合型证券投资基金
基金简称	易方达科讯混合
基金主代码	110029
交易代码	110029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 12 月 18 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,052,270,751.37 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	根据市场环境变化，综合运用多种投资策略，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金综合运用多种投资策略，把握多种投资机会。股票投资策略方面，一般情况下以优势企业策略和成长策略为主，辅以行业周期策略、绝对价值策略、突发事件/收购兼并策略以及新兴技术策略。在特定的市场情况下，后四种策略中一种或多种的资金容量较大、不确定性较小、收益预期较高时，也可成为主策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合基金，理论上其风险收益水平高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	陆志俊
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-85104666	021-62701216
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3	上海市浦东新区银城中路188号

	号4004-8室	
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	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码	510620	200120
法定代表人	刘晓艳	牛锡明

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）
本期已实现收益	-579,965,455.39
本期利润	-170,770,196.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0324
本期加权平均净值利润率	-3.05%
本期基金份额净值增长率	-2.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	2,092,023,865.66
期末可供分配基金份额利润	0.4141
期末基金资产净值	5,378,659,365.49
期末基金份额净值	1.0646
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	35.69%

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

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除

相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

4. 本基金已于 2008 年 1 月 4 日对原基金科讯退市时的基金份额进行了拆分，基金拆分比例为 1: 2.825206742。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

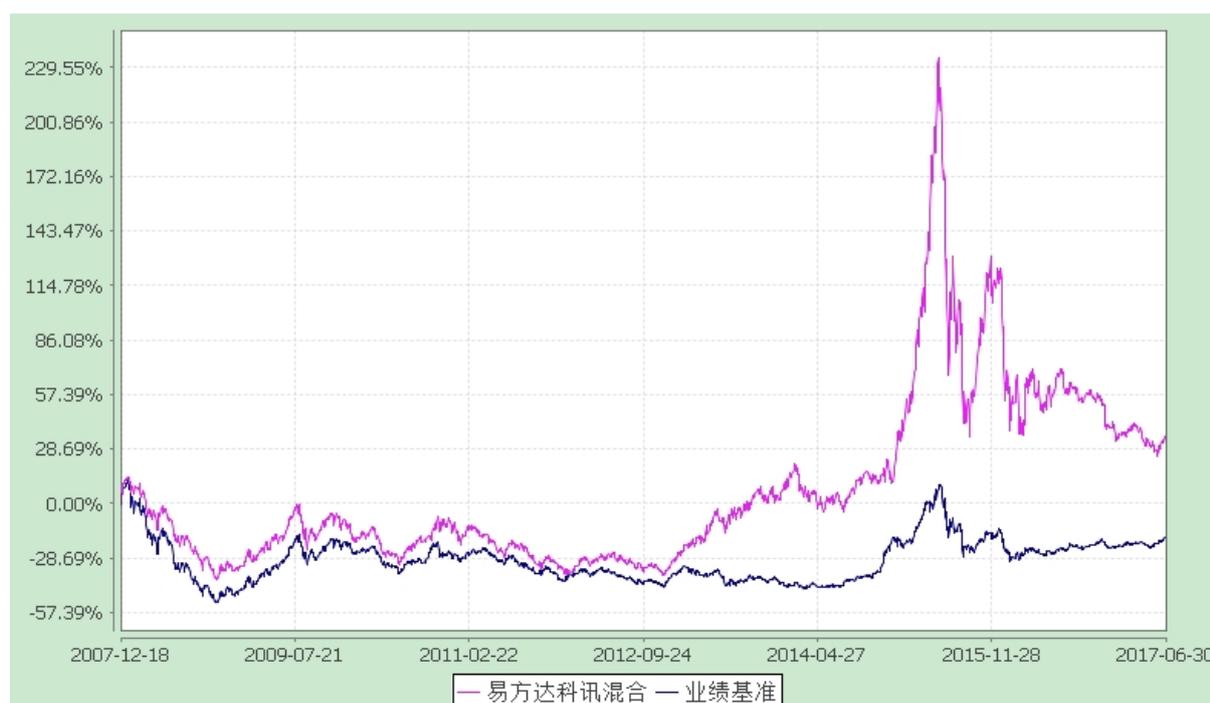
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.91%	1.10%	4.16%	0.54%	1.75%	0.56%
过去三个月	-1.20%	1.02%	4.67%	0.50%	-5.87%	0.52%
过去六个月	-2.95%	0.93%	8.13%	0.46%	-11.08%	0.47%
过去一年	-18.13%	1.00%	12.25%	0.54%	-30.38%	0.46%
过去三年	29.50%	2.48%	56.12%	1.40%	-26.62%	1.08%
自基金合同生效起至今	35.69%	1.84%	-17.75%	1.45%	53.44%	0.39%

3.2.2 自基金转型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

易方达科讯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

(2007 年 12 月 18 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：1. 本基金由原基金科讯于 2007 年 12 月 18 日转型而来。

2.自基金转型至报告期末，基金份额净值增长率为 35.69%，同期业绩比较基准收益率为-17.75%。

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		
宋昆	本基金的基金经理、易方达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、投资二部总经理	2010-09-11	-	11 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、公募基金投资部总经理助理、公募基金投资部副总经理、公募基金投资部总经理、易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
杨桢霄	本基金的基金经理助理、易方达医疗保健行业混合型证券投资基金的基金经理、易方达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2015-12-02	-	6 年	博士研究生，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员。

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，市场走势明显分化，上证综指上涨 2.86%，沪深 300 指数上涨 10.78%，而深证综指下跌 3.63%，创业板指下跌 7.34%。板块方面，上半年申万一级行业指数涨幅居前的行业包括家用电器、食品饮料、非银金融、银行等；跌幅居前的行业包括农林牧渔、纺织服装、综合、传媒等。

本基金延续了一贯的投资思路，2017 年上半年，我们认为在中国经济转型过程中战略新兴产业将成为增长的重要驱动力，其中的龙头公司有望脱颖而出成为牛股，成为本基金重点关注的对象。与此同时，报告期内，本基金也根据所配置公司的情况变化进行了个股增减持操作，同时对股

票仓位作出了适当应对。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0646 元，本报告期份额净值增长率为-2.95%，同期业绩比较基准收益率为 8.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年，由于一、二线城市的溢出效应和棚改货币化安置支撑了三、四线城市的房地产销售和投资，预计经济的内生增长动力依然较强。在经济去杠杆、金融去杠杆的大背景下，预计货币政策易紧难松，流动性压力会一直存在。目前 A 股市场的整体估值已经处于较高的水平，大幅度提升的空间不大。

放眼中长期，能使中国经济进一步焕发活力的必然是不断崛起的新兴产业。我们可以预见，在不远的将来，随着移动互联、云计算、人工智能和新能源汽车为代表的新技术的规模化运用，人类社会的进步必将大大加速。从以往繁重的生产性、事务性劳动中解放出来的人们，必将对自身的需求更加重视，娱乐、医疗、教育、体育等与“人”直接相关的产业将迎来黄金发展期。这些推动社会进步、提升人的幸福指数的新技术、新模式、新产业，将是我们关注的重点，寻找并买入其中的龙头公司，将是我们工作的重中之重。

最后，衷心感谢持有人对本基金的信任和支持，我们将努力工作，力争回报大家的信任。

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

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，基金托管人在易方达科讯混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

报告期内，易方达基金管理有限公司在易方达科讯混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达科讯混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：易方达科讯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	186,062,185.87	63,954,002.86
结算备付金		520,699.87	734,551.57
存出保证金		668,126.43	861,071.46
交易性金融资产	6.4.7.2	5,174,575,414.44	5,955,888,513.39
其中：股票投资		4,929,628,153.14	5,626,812,380.91
基金投资		-	-
债券投资		244,947,261.30	329,076,132.48
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		32,320,144.47	-
应收利息	6.4.7.5	4,794,240.90	2,922,067.84
应收股利		-	-
应收申购款		1,171,739.81	2,032,730.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,400,112,551.79	6,026,392,937.78
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		11,118,122.46	7,392,926.91
应付管理人报酬		6,452,567.19	7,895,244.75
应付托管费		1,075,427.91	1,315,874.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,192,897.27	1,113,713.38
应交税费		635,134.93	635,134.93
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	979,036.54	1,176,420.14
负债合计		21,453,186.30	19,529,314.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,788,292,332.03	1,938,171,816.44
未分配利润	6.4.7.10	3,590,367,033.46	4,068,691,807.12

所有者权益合计		5,378,659,365.49	6,006,863,623.56
负债和所有者权益总计		5,400,112,551.79	6,026,392,937.78

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0646 元，基金份额总额 5,052,270,751.37 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达科讯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		-116,498,199.05	-2,403,629,612.47
1.利息收入		3,659,511.41	5,536,194.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	309,915.87	837,890.45
债券利息收入		3,342,712.99	4,698,303.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,882.55	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-529,917,168.99	-584,763,142.84
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-554,360,798.09	-597,705,334.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-48,998.06	485,534.21
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	24,492,627.16	12,456,657.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	409,195,258.46	-1,826,711,544.28
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	564,200.07	2,308,880.40
减：二、费用		54,271,997.88	74,232,074.52
1. 管理人报酬		41,669,651.40	56,928,882.23
2. 托管费		6,944,941.93	9,488,147.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,416,547.75	7,567,601.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	240,856.80	247,443.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-170,770,196.93	-2,477,861,686.99

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-170,770,196.93	-2,477,861,686.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达科讯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）	1,938,171,816.44	4,068,691,807.12	6,006,863,623.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-170,770,196.93	-170,770,196.93
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）	-149,879,484.41	-307,554,576.73	-457,434,061.14
其中：1.基金申购款	118,293,153.60	235,262,540.92	353,555,694.52
2.基金赎回款	-268,172,638.01	-542,817,117.65	-810,989,755.66
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）	1,788,292,332.03	3,590,367,033.46	5,378,659,365.49
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）	1,999,180,581.59	8,357,890,365.64	10,357,070,947.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,477,861,686.99	-2,477,861,686.99
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）	156,041,447.09	399,923,658.63	555,965,105.72
其中：1.基金申购款	698,448,701.08	1,796,475,119.65	2,494,923,820.73
2.基金赎回款	-542,407,253.99	-1,396,551,461.02	-1,938,958,715.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-518,043,564.51	-518,043,564.51

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	2,155,222,028.68	5,761,908,772.77	7,917,130,801.45

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

本基金由科讯证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会 2007 年 12 月 6 日证监基金字[2007]330 号文《关于核准科讯证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，科讯证券投资基金由封闭式基金转型为开放式基金，调整存续期限，终止上市交易，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“易方达科讯股票型证券投资基金”。自 2007 年 12 月 18 日科讯证券投资基金在上海证券交易所终止上市之日起，由《科讯证券投资基金基金合同》修订而成的《易方达科讯股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为开放式基金，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，注册登记人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《易方达科讯股票型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》的有关规定，易方达基金管理有限公司于 2008 年 1 月 4 日对原基金科讯退市时的基金份额进行了份额拆分，拆分比例为 1: 2.825206742，并由注册登记机构进行了持有人份额的登记确认。

2015 年 7 月 25 日，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金变更基金类别并由“易方达科讯股票型证券投资基金”更名为“易方达科讯混合型证券投资基金”。

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	186,062,185.87
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	186,062,185.87

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	5,554,560,334.82	4,929,628,153.14	-624,932,181.68	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	245,091,939.33	244,947,261.30	-144,678.03
	银行间市场	-	-	-
	合计	245,091,939.33	244,947,261.30	-144,678.03
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	5,799,652,274.15	5,174,575,414.44	-625,076,859.71	

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	34,937.22
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	210.87
应收债券利息	4,758,822.18
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	270.63
合计	4,794,240.90

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	1,192,672.27
银行间市场应付交易费用	225.00
合计	1,192,897.27

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	750,000.00
应付赎回费	20,761.65
预提费用	208,274.89
合计	979,036.54

6.4.7.9 实收基金

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	5,475,712,264.49	1,938,171,816.44
本期申购	334,201,754.06	118,293,153.60
本期赎回（以“-”号填列）	-757,643,267.18	-268,172,638.01
本期末	5,052,270,751.37	1,788,292,332.03

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

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	2,858,830,542.95	1,209,861,264.17	4,068,691,807.12
本期利润	-579,965,455.39	409,195,258.46	-170,770,196.93
本期基金份额交易产生的变动数	-186,841,221.90	-120,713,354.83	-307,554,576.73
其中：基金申购款	148,395,719.98	86,866,820.94	235,262,540.92
基金赎回款	-335,236,941.88	-207,580,175.77	-542,817,117.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,092,023,865.66	1,498,343,167.80	3,590,367,033.46

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	280,476.05
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	23,319.33
其他	6,120.49
合计	309,915.87

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	2,043,448,407.70
减：卖出股票成本总额	2,597,809,205.79
买卖股票差价收入	-554,360,798.09

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	86,340,716.99

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	84,903,560.67
减：应收利息总额	1,486,154.38
买卖债券差价收入	-48,998.06

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	24,492,627.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	24,492,627.16

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	409,195,258.46
——股票投资	408,420,568.97
——债券投资	774,689.49
——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	409,195,258.46

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	564,200.07
其他	-
合计	564,200.07

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	5,416,322.75
银行间市场交易费用	225.00
合计	5,416,547.75

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		59,507.37
信息披露费		148,767.52
银行汇划费		13,381.91
银行间账户维护费		18,000.00
其他		1,200.00
合计		240,856.80

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
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	-	-	59,567,739.52	1.20%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	-	-	-
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 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	55,475.58	1.25%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	41,669,651.40
其中：支付销售机构的客户维护费	8,874,634.74	11,145,102.36

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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	6,944,941.93

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支取。

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	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
报告期初持有的基金份额	36,448,816.90	72,448,816.90
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	36,448,816.90	72,448,816.90
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.72%	1.19%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券	5,650,413.49	0.11%	5,650,413.49	0.10%

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

6.4.10.5 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
交通银行-活期存款	186,062,185.87	280,476.05	259,632,652.88	763,205.29

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通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	1,680	32,020.80
广发证券	002842	翔鹭钨业	新股网下发行	932	10,643.44
广发证券	002867	周大生	新股网下发行	3,444	68,604.48
广发证券	300599	雄塑科技	新股网下发行	3,155	22,211.20
广发证券	300625	三雄极光	新股网下发行	3,934	75,926.20
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	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	1,206	30,089.70
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	3,022	50,104.76
广发证券	300310	宜通世纪	非公开发行	1,528,280	50,203,998.00
广发证券	603028	赛福天	新股网下发行	3,309	14,096.34
广发证券	603131	上海沪工	新股网下发行	1,263	12,743.67
广发证券	603339	四方冷链	新股网下发行	2,793	28,460.67

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

本基金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	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603330	旭升	2017-	2017-	新股	11.26	11.26	1,351	15,212	15,212	-

5	股份	06-30	07-10	流通受限				.26	.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	-
603823	百合花	2016-12-09	2017-12-20	老股转让流通受限	10.60	21.18	36,764	389,698.40	778,661.52	-
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：1) 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）；

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

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
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项停牌	25.06	2017-07-07	22.54	150,000	6,235,608.65	3,759,000.00	-
300065	海兰信	2016-12-08	重大事项停牌	25.63	2017-07-06	23.07	74,904	1,021,856.84	1,919,789.52	-
300109	新开源	2017-03-27	重大事项停牌	46.46	-	-	300,000	25,240,803.57	13,938,000.00	-
300271	华宇软件	2017-06-22	重大事项停牌	16.59	2017-07-04	16.80	5,392,762	114,789,099.01	89,465,921.58	-
300291	华录百纳	2017-04-19	重大事项停牌	20.02	-	-	500,000	20,261,068.69	10,010,000.00	-
300364	中文在线	2017-02-13	重大事项停牌	37.28	-	-	1,297,128	123,972,228.60	48,356,931.84	-
300404	博济医药	2017-06-20	重大事项停牌	23.07	-	-	400,000	18,510,439.89	9,228,000.00	-

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。

本基金是混合型基金，属于证券投资基金中的中等偏高风险品种，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和分散化投资方式防范信用风险，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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：0.00%)。

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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	249,706,083.48	331,780,191.77
合计	249,706,083.48	331,780,191.77

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	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	198,204.28
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	198,204.28

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，其余亦可在银行间同业市场交易，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	186,062,185.87	-	-	-	186,062,185.87

结算备付金	520,699.87	-	-	-	520,699.87
存出保证金	668,126.43	-	-	-	668,126.43
交易性金融资产	244,947,261.30	-	-	4,929,628,153.14	5,174,575,414.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	32,320,144.47	32,320,144.47
应收利息	-	-	-	4,794,240.90	4,794,240.90
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,171,739.81	1,171,739.81
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	432,198,273.47	-	-	4,967,914,278.32	5,400,112,551.79
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	-	-	-	11,118,122.46	11,118,122.46
应付管理人报酬	-	-	-	6,452,567.19	6,452,567.19
应付托管费	-	-	-	1,075,427.91	1,075,427.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,192,897.27	1,192,897.27
应交税费	-	-	-	635,134.93	635,134.93
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	979,036.54	979,036.54
负债总计	-	-	-	21,453,186.30	21,453,186.30
利率敏感度缺口	432,198,273.47	-	-	4,946,461,092.02	5,378,659,365.49
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	63,954,002.86	-	-	-	63,954,002.86
结算备付金	734,551.57	-	-	-	734,551.57
存出保证金	861,071.46	-	-	-	861,071.46
交易性金融资产	328,878,000.00	198,132.48	-	5,626,812,380.91	5,955,888,513.39
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	-	-	-	2,922,067.84	2,922,067.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,032,730.66	2,032,730.66
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	394,427,625.89	198,132.48	-	5,631,767,179.41	6,026,392,937.78
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	-	-	-	7,392,926.91	7,392,926.91
应付管理人报酬	-	-	-	7,895,244.75	7,895,244.75
应付托管费	-	-	-	1,315,874.11	1,315,874.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,113,713.38	1,113,713.38
应交税费	-	-	-	635,134.93	635,134.93
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,176,420.14	1,176,420.14
负债总计	-	-	-	19,529,314.22	19,529,314.22
利率敏感度缺口	394,427,625.89	198,132.48	0.00	5,612,237,865.19	6,006,863,623.56

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		58,573.64	480,301.09
2. 市场利率上升 25 个基点		-58,545.64	-478,902.29

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	4,929,628,153.14	91.65	5,626,812,380.91	93.67
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	4,929,628,153.14	91.65	5,626,812,380.91	93.67

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%	280,038,338.50	461,245,965.85
2.业绩比较基准下降 5%	-280,038,338.50	-461,245,965.85	

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 4,752,950,510.20 元，属于第二层次的余额为 421,624,904.24 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 4,554,562,511.45 元，第二层次 1,401,326,001.94 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	4,929,628,153.14	91.29
	其中：股票	4,929,628,153.14	91.29
2	固定收益投资	244,947,261.30	4.54
	其中：债券	244,947,261.30	4.54
	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	186,582,885.74	3.46
7	其他各项资产	38,954,251.61	0.72
8	合计	5,400,112,551.79	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	12,076,000.00	0.22
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,667,329,918.08	49.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,228,000.00	0.06
E	建筑业	2,714,978.24	0.05
F	批发和零售业	102,125,000.00	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,348,000.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,091,462,323.81	20.29
J	金融业	11,384,331.54	0.21
K	房地产业	13,399,838.15	0.25

L	租赁和商务服务业	29,436,700.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	45,520,072.16	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	48,010,816.18	0.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	769,879,416.08	14.31
R	文化、体育和娱乐业	131,298,758.90	2.44
S	综合	414,000.00	0.01
	合计	4,929,628,153.14	91.65

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	601012	隆基股份	25,962,208	443,953,756.80	8.25
2	300015	爱尔眼科	18,030,258	419,383,801.08	7.80
3	300068	南都电源	18,268,169	307,635,965.96	5.72
4	002466	天齐锂业	5,363,193	291,489,539.55	5.42
5	300383	光环新网	20,000,000	271,200,000.00	5.04
6	002530	金财互联	8,599,627	253,345,011.42	4.71
7	600763	通策医疗	8,000,000	200,720,000.00	3.73
8	300113	顺网科技	5,260,355	141,503,549.50	2.63
9	002230	科大讯飞	3,300,000	131,670,000.00	2.45
10	300033	同花顺	2,100,000	130,641,000.00	2.43
11	002007	华兰生物	3,359,050	122,605,325.00	2.28
12	300244	迪安诊断	3,800,000	119,548,000.00	2.22
13	300346	南大光电	5,068,900	115,418,853.00	2.15
14	300327	中颖电子	3,233,596	102,504,993.20	1.91
15	002036	联创电子	6,000,000	99,000,000.00	1.84
16	600682	南京新百	2,600,000	95,940,000.00	1.78
17	300271	华宇软件	5,392,762	89,465,921.58	1.66
18	002450	康得新	3,800,000	85,576,000.00	1.59
19	002555	三七互娱	2,581,408	66,006,602.56	1.23
20	002572	索菲亚	1,600,000	65,600,000.00	1.22
21	002624	完美世界	1,812,490	62,168,407.00	1.16
22	002019	亿帆医药	3,678,903	61,364,102.04	1.14
23	002383	合众思壮	3,868,602	60,620,993.34	1.13
24	300310	宜通世纪	4,401,446	58,187,116.12	1.08

25	002460	赣锋锂业	1,216,179	56,248,278.75	1.05
26	002668	奥马电器	2,700,000	53,190,000.00	0.99
27	300007	汉威电子	2,600,000	50,076,000.00	0.93
28	300364	中文在线	1,297,128	48,356,931.84	0.90
29	000063	中兴通讯	2,000,000	47,480,000.00	0.88
30	000892	欢瑞世纪	3,900,000	39,117,000.00	0.73
31	002631	德尔未来	2,643,267	38,935,322.91	0.72
32	000921	海信科龙	2,006,800	34,537,028.00	0.64
33	300059	东方财富	2,829,263	34,007,741.26	0.63
34	300369	绿盟科技	3,000,000	33,180,000.00	0.62
35	300347	泰格医药	1,249,075	30,227,615.00	0.56
36	002776	柏堡龙	1,288,312	29,863,072.16	0.56
37	002343	慈文传媒	746,250	28,253,025.00	0.53
38	300078	思创医惠	2,570,462	27,581,057.26	0.51
39	300136	信维通信	682,996	27,333,499.92	0.51
40	300236	上海新阳	950,278	26,778,834.04	0.50
41	300225	金力泰	1,749,380	26,153,231.00	0.49
42	002059	云南旅游	2,590,344	26,032,957.20	0.48
43	300016	北陆药业	1,343,118	20,469,118.32	0.38
44	600055	万东医疗	1,550,528	19,536,652.80	0.36
45	300409	道氏技术	500,000	18,610,000.00	0.35
46	300238	冠昊生物	639,427	16,209,474.45	0.30
47	000888	峨眉山 A	1,200,000	15,240,000.00	0.28
48	300009	安科生物	886,162	14,541,918.42	0.27
49	300109	新开源	300,000	13,938,000.00	0.26
50	300207	欣旺达	1,178,700	13,896,873.00	0.26
51	002027	分众传媒	1,000,000	13,760,000.00	0.26
52	002400	省广股份	1,690,000	13,570,700.00	0.25
53	600687	刚泰控股	1,000,000	12,880,000.00	0.24
54	600198	大唐电信	1,000,000	12,770,000.00	0.24
55	300291	华录百纳	500,000	10,010,000.00	0.19
56	300229	拓尔思	800,000	9,896,000.00	0.18
57	000558	莱茵体育	1,300,500	9,883,800.00	0.18
58	300404	博济医药	400,000	9,228,000.00	0.17
59	002456	欧菲光	500,000	9,085,000.00	0.17
60	600446	金证股份	500,000	8,790,000.00	0.16
61	600728	佳都科技	1,079,681	8,356,730.94	0.16
62	300352	北信源	1,425,000	8,222,250.00	0.15
63	600036	招商银行	333,333	7,969,992.03	0.15
64	300222	科大智能	342,000	7,759,980.00	0.14
65	300182	捷成股份	749,827	7,168,346.12	0.13
66	002544	杰赛科技	300,000	6,840,000.00	0.13
67	600887	伊利股份	300,000	6,477,000.00	0.12
68	600645	中源协和	300,000	6,429,000.00	0.12

69	002664	信质电机	203,700	5,829,894.00	0.11
70	600519	贵州茅台	12,100	5,709,385.00	0.11
71	002714	牧原股份	200,000	5,444,000.00	0.10
72	600120	浙江东方	200,000	5,376,000.00	0.10
73	002033	丽江旅游	514,859	5,261,858.98	0.10
74	000049	德赛电池	100,000	5,181,000.00	0.10
75	300144	宋城演艺	240,738	5,024,202.06	0.09
76	600562	国睿科技	180,000	4,957,200.00	0.09
77	601100	恒立液压	300,000	4,887,000.00	0.09
78	002153	石基信息	200,000	4,546,000.00	0.08
79	002169	智光电气	600,000	4,512,000.00	0.08
80	002477	雏鹰农牧	1,000,000	4,430,000.00	0.08
81	002030	达安基因	200,000	4,358,000.00	0.08
82	002152	广电运通	511,875	4,253,681.25	0.08
83	600855	航天长峰	200,000	4,236,000.00	0.08
84	002241	歌尔股份	200,000	3,856,000.00	0.07
85	002642	荣之联	150,000	3,759,000.00	0.07
86	002751	易尚展示	100,000	3,705,000.00	0.07
87	300228	富瑞特装	320,000	3,603,200.00	0.07
88	600436	片仔癀	57,364	3,501,498.56	0.07
89	000977	浪潮信息	200,000	3,464,000.00	0.06
90	002292	奥飞娱乐	200,000	3,380,000.00	0.06
91	000661	长春高新	26,000	3,356,860.00	0.06
92	600850	华东电脑	153,853	3,287,838.61	0.06
93	300124	汇川技术	119,617	3,055,018.18	0.06
94	300168	万达信息	200,000	2,910,000.00	0.05
95	600276	恒瑞医药	56,160	2,841,134.40	0.05
96	002385	大北农	449,769	2,829,047.01	0.05
97	000538	云南白药	30,000	2,815,500.00	0.05
98	300368	汇金股份	183,944	2,645,114.72	0.05
99	601229	上海银行	103,424	2,641,448.96	0.05
100	300359	全通教育	200,000	2,614,000.00	0.05
101	600201	生物股份	73,100	2,600,167.00	0.05
102	000998	隆平高科	100,000	2,202,000.00	0.04
103	600637	东方明珠	100,000	2,167,000.00	0.04
104	600496	精工钢构	440,000	2,125,200.00	0.04
105	600138	中青旅	100,000	2,106,000.00	0.04
106	600340	华夏幸福	60,000	2,014,800.00	0.04
107	600674	川投能源	200,000	1,964,000.00	0.04
108	300065	海兰信	74,904	1,919,789.52	0.04
109	600343	航天动力	100,000	1,734,000.00	0.03
110	300188	美亚柏科	100,000	1,729,000.00	0.03
111	300273	和佳股份	130,000	1,580,800.00	0.03
112	600325	华发股份	179,789	1,501,238.15	0.03

113	300190	维尔利	100,000	1,476,000.00	0.03
114	000524	岭南控股	100,000	1,348,000.00	0.03
115	002672	东江环保	75,000	1,266,750.00	0.02
116	600886	国投电力	160,000	1,264,000.00	0.02
117	600006	东风汽车	200,000	1,170,000.00	0.02
118	002009	天奇股份	100,000	1,142,000.00	0.02
119	300206	理邦仪器	122,995	1,061,446.85	0.02
120	300253	卫宁健康	132,968	1,038,480.08	0.02
121	300205	天喻信息	100,000	1,038,000.00	0.02
122	300326	凯利泰	107,635	1,010,692.65	0.02
123	600587	新华医疗	50,000	889,000.00	0.02
124	600535	天士力	20,000	830,800.00	0.02
125	000028	国药一致	10,000	809,000.00	0.02
126	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.01
127	300508	维宏股份	10,383	720,580.20	0.01
128	601881	中国银河	49,321	584,947.06	0.01
129	002431	棕榈股份	50,000	551,000.00	0.01
130	300133	华策影视	48,000	537,600.00	0.01
131	300287	飞利信	53,888	494,691.84	0.01
132	601633	长城汽车	35,250	468,472.50	0.01
133	300295	三六五网	23,978	448,628.38	0.01
134	600352	浙江龙盛	45,892	437,350.76	0.01
135	002038	双鹭药业	15,000	437,250.00	0.01
136	002065	东华软件	20,000	435,800.00	0.01
137	600256	广汇能源	100,000	414,000.00	0.01
138	000768	中航飞机	20,000	368,800.00	0.01
139	601212	白银有色	39,958	325,258.12	0.01
140	600315	上海家化	10,000	324,500.00	0.01
141	300616	尚品宅配	1,858	251,870.48	0.00
142	002850	科达利	2,548	231,332.92	0.00
143	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.00
144	603986	兆易创新	2,266	176,317.46	0.00
145	300474	景嘉微	4,934	174,663.60	0.00
146	603345	安井食品	3,227	82,611.20	0.00
147	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
148	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
149	300639	凯普生物	1,046	44,894.32	0.00
150	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
151	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
152	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
153	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
154	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
155	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
156	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00

157	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
158	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
159	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
160	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
161	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
162	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
163	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
164	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
165	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
166	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
167	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	002466	天齐锂业	254,923,881.32	4.24
2	601012	隆基股份	137,146,329.05	2.28
3	002027	分众传媒	129,472,420.02	2.16
4	600104	上汽集团	108,135,327.32	1.80
5	300383	光环新网	104,035,700.35	1.73
6	000059	华锦股份	87,228,153.29	1.45
7	002668	奥马电器	79,372,624.85	1.32
8	300033	同花顺	57,590,729.02	0.96
9	002555	三七互娱	53,141,622.44	0.88
10	002460	赣锋锂业	52,922,191.33	0.88
11	002383	合众思壮	52,007,786.45	0.87
12	300113	顺网科技	48,570,486.63	0.81
13	002019	亿帆医药	46,715,678.90	0.78
14	002230	科大讯飞	39,186,968.76	0.65
15	000651	格力电器	34,659,459.18	0.58
16	002776	柏堡龙	30,517,528.38	0.51
17	300346	南大光电	30,430,912.48	0.51
18	000921	海信科龙	29,214,994.60	0.49
19	300136	信维通信	26,564,921.55	0.44
20	300225	金力泰	26,010,829.40	0.43

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	300113	顺网科技	233,800,146.29	3.89
2	002280	联络互动	225,863,967.53	3.76
3	300033	同花顺	175,533,052.61	2.92
4	002657	中科金财	140,817,336.42	2.34
5	300007	汉威电子	140,432,609.32	2.34
6	600104	上汽集团	121,849,448.37	2.03
7	002027	分众传媒	118,627,952.62	1.97
8	000059	华锦股份	102,014,100.89	1.70
9	600682	南京新百	96,621,768.74	1.61
10	300383	光环新网	69,810,805.47	1.16
11	300188	美亚柏科	69,213,117.59	1.15
12	300047	天源迪科	67,429,736.21	1.12
13	300369	绿盟科技	55,797,152.74	0.93
14	002230	科大讯飞	54,332,830.25	0.90
15	300244	迪安诊断	52,125,525.83	0.87
16	000651	格力电器	43,860,271.52	0.73
17	600198	大唐电信	41,272,286.58	0.69
18	600409	三友化工	29,517,781.09	0.49
19	000063	中兴通讯	27,214,589.15	0.45
20	300431	暴风集团	20,935,589.64	0.35

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	1,492,204,409.05
卖出股票收入（成交）总额	2,043,448,407.70

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	244,947,261.30	4.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	244,947,261.30	4.55

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	019546	16 国债 18	2,452,170	244,947,261.30	4.55

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	668,126.43
2	应收证券清算款	32,320,144.47
3	应收股利	-
4	应收利息	4,794,240.90
5	应收申购款	1,171,739.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,954,251.61

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

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
379,130	13,325.96	63,296,636.04	1.25%	4,988,974,115.33	98.75%

注：持有人户数含未确权的原持有人户数。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,194,625.71	0.0236%

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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年12月18日）基金份额总额	800,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	5,475,712,264.49
本报告期基金总申购份额	334,201,754.06
减：本报告期基金总赎回份额	757,643,267.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,052,270,751.37

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	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	973,987,389.10	27.58%	779,190.20	25.47%	-

华安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	755,643,467.61	21.40%	703,730.03	23.00%	-
渤海证券	1	200,921,748.96	5.69%	187,117.52	6.12%	-
中信建投	1	193,097,446.44	5.47%	179,831.70	5.88%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	388,027,113.93	10.99%	310,421.71	10.15%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	30,102,597.22	0.85%	28,034.51	0.92%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	254,833,921.68	7.22%	203,866.39	6.66%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	229,167,166.85	6.49%	213,424.00	6.98%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	126,832,422.46	3.59%	101,465.92	3.32%	-
万联证券	1	22,416,524.35	0.63%	20,876.73	0.68%	-
方正证券	1	356,058,389.13	10.08%	331,597.62	10.84%	-

注：a) 本报告期内本基金减少江海证券有限公司一个交易单元,新增长江证券股份有限公司一个交易单元。

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
中信证券	233,136.54	0.42%	-	-	-	-
方正证券	54,679,378.20	99.58%	-	-	-	-

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	易方达科讯混合型证券投资基金在直销中心恢复申购、转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-10
3	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
4	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
5	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
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公司旗下部分	中国证券报、上海证券	2017-02-14

	基金估值调整情况的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资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	2017-02-23
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加肯特瑞为销售机构、参加肯特瑞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	2017-03-02
12	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
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龙江银行申购及定期定额投资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	2017-03-10
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加龙江银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-10
15	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
16	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
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加朝阳永续为销售机构、参加朝阳永续申购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	2017-03-15
18	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
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中信期货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	2017-03-20
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信证券（山东）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	2017-03-20
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华龙证券定期定额投资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
22	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
23	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

24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加济安财富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	2017-03-27
25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购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	2017-03-30
26	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惠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
27	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
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券申购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	2017-04-10
29	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞安农商银行为销售机构、参加瑞安农商行申购与定期定额投资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	2017-04-13
30	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	2017-04-15
31	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
32	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
33	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资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	2017-04-22
34	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
35	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
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中证金牛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	2017-05-05
37	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加财通证券申购及定期定额投资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	2017-05-15
38	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放	中国证券报、上海证券	2017-05-15

	式基金参加川财证券费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
39	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
40	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
41	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行申购及定期定额投资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	2017-06-12
42	易方达基金管理有限公司关于增加万联证券为易方达科讯混合型证券投资基金、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金和易方达科翔混合型证券投资基金确权机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-12
43	易方达基金管理有限公司关于在中银国际证券开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务、参加中银国际证券定期定额投资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	2017-06-19
44	易方达基金管理有限公司关于陆金所官方旗舰店关闭服务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-19
45	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
46	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
47	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
48	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加佛山农商银行申购与定期定额投资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	2017-06-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会《关于核准科讯证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监基金字[2007]330号）；
- 2.《易方达科讯混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达科讯混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.中国证监会《关于同意科汇、科讯、科翔证券投资基金上市、扩募和续期的批复》（证监基

金字[2001]11 号文);

- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 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。

11.3 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