

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年三月三十日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达瑞享混合	
基金主代码	001437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 6 月 26 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	152,201,373.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
下属分级基金的交易代码	001437	001438
报告期末下属分级基金的份额总额	86,180,797.49 份	66,020,576.23 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	易方达基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南
	联系电话	020-85102688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn
		贺倩
		010-66060069
		tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400 881 8088	95599
传真	020-85104666	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年		2016 年		2015 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
本期已实现收益	-1,355,360.37	-1,068,999.69	5,772,247.63	4,774,740.94	3,592,761.02	13,233,910.73
本期利润	1,939,798.17	-28,925.56	3,281,763.67	3,172,678.19	2,587,704.93	13,213,808.75
加权平均基金份额本期利润	0.0213	-0.0004	0.0294	0.0482	0.0209	0.0030
本期基金份额净值增长率	2.16%	1.96%	5.79%	5.53%	22.70%	1.30%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
期末可供分配基金份额利润	0.3088	0.0756	0.2981	0.0689	0.2271	0.0126
期末基金资产	114,283,813.32	71,953,661.62	115,881,377.23	75,418,012.62	196,111,194.13	62,548,924.68

净值						
期末基金份额净值	1.326	1.090	1.298	1.069	1.227	1.013

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.本基金合同于 2015 年 6 月 26 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达瑞享混合 I

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.42%	1.22%	0.89%	0.01%	-7.31%	1.21%
过去六个月	-0.45%	1.28%	1.79%	0.01%	-2.24%	1.27%
过去一年	2.16%	1.19%	3.55%	0.01%	-1.39%	1.18%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	32.60%	1.53%	9.07%	0.01%	23.53%	1.52%

易方达瑞享混合 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.44%	1.21%	0.89%	0.01%	-7.33%	1.20%
过去六个月	-0.55%	1.28%	1.79%	0.01%	-2.34%	1.27%
过去一年	1.96%	1.19%	3.55%	0.01%	-1.59%	1.18%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	9.00%	1.27%	9.07%	0.01%	-0.07%	1.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 6 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日)

易方达瑞享混合 I

(2015 年 6 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日)



易方达瑞享混合 E

(2015 年 6 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，I 类基金份额净值增长率为 32.60%，E 类基金份额净值增长

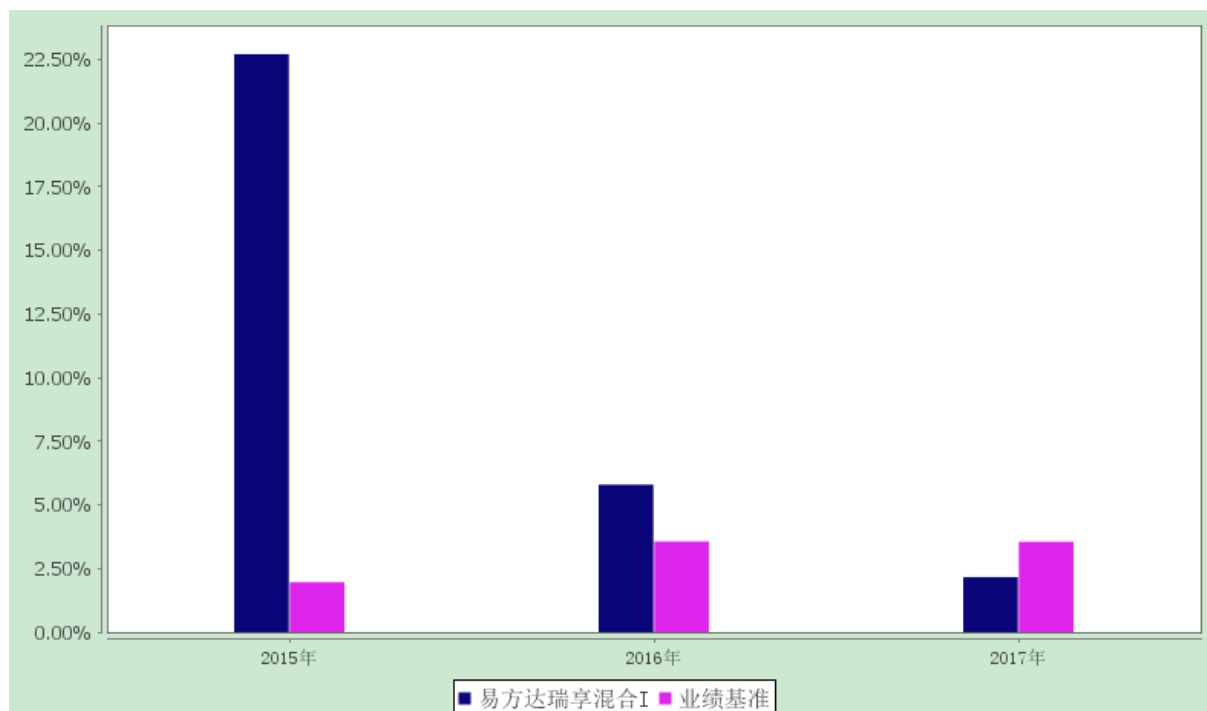
率为 9.00%，同期业绩比较基准收益率为 9.07%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

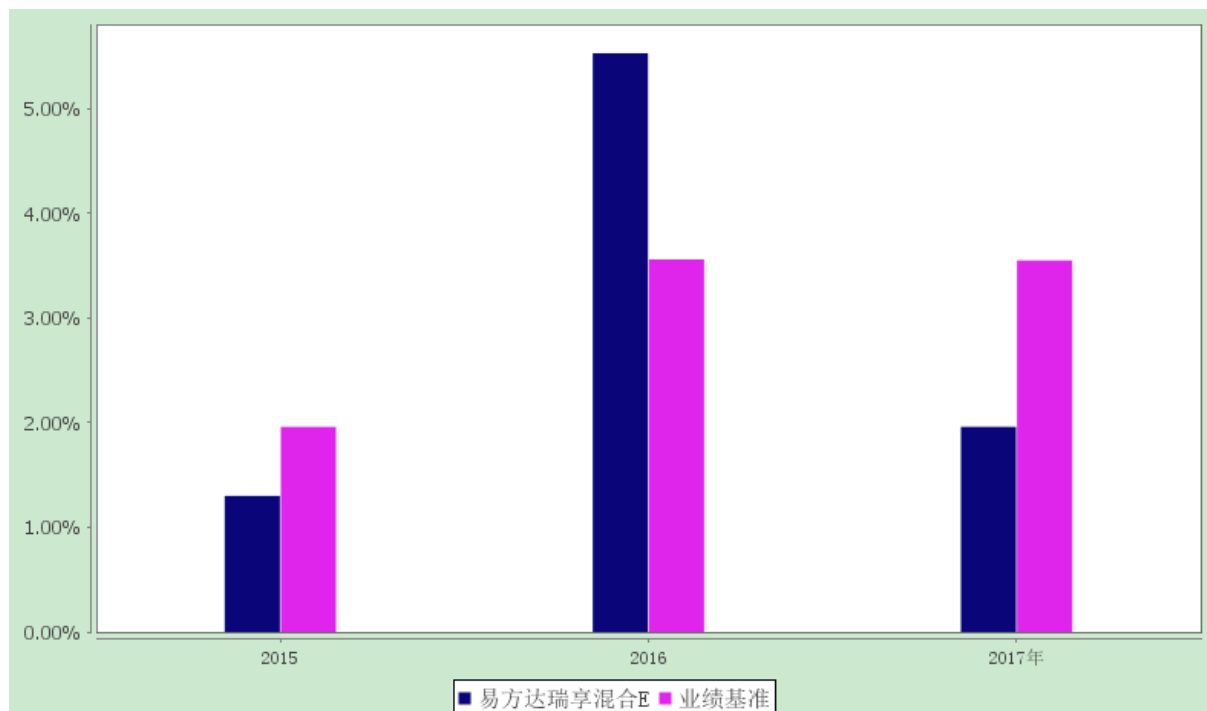
易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达瑞享混合 I



易方达瑞享混合 E



注：本基金合同生效日为 2015 年 6 月 26 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续

期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于 2001 年 4 月 17 日，总部设在广州，在北京、上海、香港、深圳、成都、大连等地设有办公场所，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为投资人的资产实现持续稳定的保值增值，成为国内领先的综合性资产管理机构，具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一，拥有公募、社保、年金、专户、QDII、QFII、RQFII、保险资金委托投资、基本养老保险基金投资等业务资格，投资业务包括主动权益、指数量化、固定收益、国际投资、多资产投资、另类投资等六大板块，为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至 2017 年 12 月 31 日，易方达旗下管理的各类资产规模总计 12338 亿元，其中公募基金规模 6077 亿元；服务各类客户总数 6703 万户，公募基金累计分红 931 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理 (助理)期 限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
梁裕宁	本基金的基金经理、易方达策略成长证券投资基金的基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金的基金经理	2016-01-23	2017-12-30	7 年	硕士研究生，曾任普华永道会计师事务所高级审计师，中山华通五金制品有限公司总裁助理，QQ Distinction Pty Ltd 董事、财务负责人，易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、投资经理兼行业研究员。
武	本基金的基金经理、易方达策略成	2017-	-	6 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理

阳	长证券投资基金的基金经理（自 2015 年 08 月 05 日至 2017 年 12 月 29 日）	12-30			有限公司行业研究员、易方达策略成长二号混合型证券投资基金的基金经理助理。
---	--	-------	--	--	--------------------------------------

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对我司旗下所有投资组合 2017 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 36 次，其中 33 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 我国经济数据高于年初预期，全年 GDP 增速 6.9%，较 2016 年有所回升。其中消费的占比进一步提升，整体经济结构进一步改善。房地产市场持续活跃，居民消费力提升，经济增长从“L”向“U”型方向发展。同时，受经济增长加速影响，货币政策持续收紧，财政政策并未加强。

A 股市场 2017 年震荡上行，上证指数全年温和上涨 6.56%，但市场风格分化极为严重。大消费行业超额收益显著，其中白酒、家电行业出现普遍复苏，ROE 持续改善。叠加货币政策收紧、市场风险偏好下降，白酒，家电行业均迎来了盈利与估值上升的戴维斯双击周期。全年来看，上证 50 指数 2017 年大涨 25.08%，同期创业板指数下跌 10.67%。

本基金全年对白酒、家电等价值股配置较低，高估了市场风险偏好修复速度，导致业绩波动较大，超额收益缺失。

本基金年初基于对当时宏观经济状况的研究，判断财政政策发力概率较大，加大了建筑等周期行业配置，该误判导致收益落后较大。其后，经济数据的持续向好导致财政政策支撑经济预期减弱。

三季度，随着金融去杠杆阶段性结束，市场风险偏好修复，本基金高配周期股和新能源汽车等高弹性品种，阶段性取得较大超额收益。但国庆后，市场无风险收益率大幅走高，价值股一枝独秀，组合未能及时做出反应，导致全年收益不尽如人意。

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 1.326 元，本报告期份额净值增长率为 2.16%；E 类基金份额净值为 1.090 元，本报告期份额净值增长率为 1.96%；同期业绩比较基准收益率为 3.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，国内金融去杠杆、资金脱虚向实的趋势仍在进行中，预计市场资金面将保持稳中偏紧，这一过程伴随着全球发达经济体持续复苏带来的利率上行，将持续较长时间，市场预计难以依靠估值提升而大幅上涨。同时，美国基建计划及原油价格上行都为国内带来一定输入性通胀风险，但目前整体可控。从另一个角度来看，部分成长股经过长期调整后已经进入价值区间，一些高增长的优质公司值得投资者加大配置力度。

在下一阶段的资产配置上，我们将选择较为灵活的股票仓位，同时加强对组合配置方向的积极调整以应对市场变化。本基金将重点关注：一是受益于利率上行及通胀预期的行业，如银行、保险、石油石化、有色金属、食品饮料等；二是行业集中度快速提升的行业，如地产等；三是高端制造、信息娱乐、大消费等部分行业中自下而上选择优质成长公司的投资机会。

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、中国证券投资基金业协会相关指引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，公司首席运营官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，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提

供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达瑞享混合 I：本报告期内未实施利润分配。

易方达瑞享混合 E：本报告期内未实施利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—易方达基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计了 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	96,644,186.06	11,198,656.10
结算备付金	2,073,417.80	2,089,014.51
存出保证金	300,780.80	376,087.41
交易性金融资产	76,020,177.09	176,365,768.43
其中：股票投资	75,750,496.14	176,182,785.63
基金投资	-	-
债券投资	269,680.95	182,982.80
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	13,660,466.65	3,987,930.25
应收利息	9,159.68	9,456.02
应收股利	-	-
应收申购款	5,647.82	70,908.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	188,713,835.90	194,097,821.11
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	1,547,750.90
应付赎回款	965,199.59	12,121.03
应付管理人报酬	127,291.55	131,109.54
应付托管费	23,867.18	24,583.05
应付销售服务费	12,250.34	12,871.07
应付交易费用	987,103.14	1,009,985.02
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,649.16	60,010.65
负债合计	2,476,360.96	2,798,431.26
所有者权益：		
实收基金	152,201,373.72	159,828,135.15
未分配利润	34,036,101.22	31,471,254.70
所有者权益合计	186,237,474.94	191,299,389.85
负债和所有者权益总计	188,713,835.90	194,097,821.11

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，I 类基金份额净值 1.326 元，E 类基金份额净值 1.090 元；基金份额总额 152,201,373.72 份，下属分级基金的份额总额分别为：I 类基金份额总额 86,180,797.49 份，E 类基金份额总额 66,020,576.23 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	11,688,224.50	20,331,899.88
1.利息收入	187,922.71	505,034.04
其中：存款利息收入	182,949.51	236,654.86
债券利息收入	4,973.20	208,380.90
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	59,998.28
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	7,008,562.89	23,752,949.35
其中：股票投资收益	6,085,120.26	22,530,977.62
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-4,906.77	676,881.39
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	928,349.40	545,090.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,335,232.67	-4,092,546.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	156,506.23	166,463.20
减：二、费用	9,777,351.89	13,877,458.02
1. 管理人报酬	1,649,354.74	1,670,393.86
2. 托管费	309,254.08	313,198.88
3. 销售服务费	164,647.84	137,043.19
4. 交易费用	7,234,396.74	11,627,718.37
5. 利息支出	-	4,654.80
其中：卖出回购金融资产支出	-	4,654.80
6. 其他费用	419,698.49	124,448.92

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,910,872.61	6,454,441.86
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,910,872.61	6,454,441.86

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	159,828,135.15	31,471,254.70	191,299,389.85
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数（本 期利润）	-	1,910,872.61	1,910,872.61
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)	-7,626,761.43	653,973.91	-6,972,787.52
其中：1.基金申购款	57,958,532.21	13,797,843.71	71,756,375.92
2.基金赎回款	-65,585,293.64	-13,143,869.80	-78,729,163.44
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)	152,201,373.72	34,036,101.22	186,237,474.94
项目	上年度可比期间		

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	221,583,987.03	37,076,131.78	258,660,118.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,454,441.86	6,454,441.86
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)	-61,755,851.88	-12,059,318.94	-73,815,170.82
其中：1.基金申购款	52,323,545.43	8,735,901.94	61,059,447.37
2.基金赎回款	-114,079,397.31	-20,795,220.88	-134,874,618.19
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)	159,828,135.15	31,471,254.70	191,299,389.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1041号《关于准予易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基

基金份额总额为 213,801,701.29 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,200.00 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 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

除下述事项外，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。根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（以下简称“估值业务指引”），自2017年12月15日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益影响金额为人民币849,495.54元。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

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

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

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

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

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)	基金托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,649,354.74	1,670,393.86
其中：支付销售机构的客户维护费	36,382.76	23,469.29

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	309,254.08	313,198.88

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E	合计
易方达基金管理有限 公司	-	158,033.62	158,033.62
中国农业银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	158,033.62	158,033.62
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E	合计
易方达基金管理有限 公司	-	133,834.51	133,834.51
中国农业银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	133,834.51	133,834.51

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

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 E 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 E 类基金份额前一日基金资产净值

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日

	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
报告期初持有的基金份额	78,645,384.75	61,148,860.70	158,645,384.75	61,148,860.70
报告期内申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	80,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	78,645,384.75	61,148,860.70	78,645,384.75	61,148,860.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	91.26%	92.62%	88.10%	86.67%

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

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达瑞享混合 I

无。

易方达瑞享混合 E

无。

7.4.8.5 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12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期存款	96,644,186.06	147,074.65	11,198,656.10	176,098.58

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

7.4.8.6 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12月31日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券	002841	视源股份	新股网下 发行	798	15,209.88
广发证券	002842	翔鹭钨业	新股网下 发行	932	10,643.44
广发证券	002919	名臣健康	新股网下 发行	821	10,311.76
广发证券	300599	雄塑科技	新股网下 发行	2,051	14,439.04
广发证券	300625	三雄极光	新股网下 发行	2,065	39,854.50
广发证券	300627	华测导航	新股网下 发行	1,498	19,129.46
广发证券	300639	凯普生物	新股网下 发行	1,046	19,235.94
广发证券	300647	超频三	新股网下 发行	1,244	11,146.24
广发证券	300658	延江股份	新股网下 发行	1,110	21,545.10
广发证券	300697	电工合金	新股网下 发行	1,630	12,436.90
广发证券	300723	一品红	新股网下 发行	1,561	26,615.05
广发证券	300726	宏达电子	新股网下 发行	1,548	17,275.68
广发证券	300735	光弘科技	新股网下 发行	3,387	33,836.13
广发证券	603041	美思德	新股网下 发行	1,034	13,359.28
广发证券	603043	广州酒家	新股网下 发行	1,810	23,855.80
广发证券	603089	正裕工业	新股网下 发行	1,087	12,641.81
广发证券	603208	欧派股份	新股网下 发行	1,221	30,317.43
广发证券	603458	勤设股份	新股网下 发行	1,320	38,755.20
广发证券	603507	振江股份	新股网下 发行	1,093	28,691.25
广发证券	603535	嘉诚国际	新股网下 发行	1,340	20,327.80
广发证券	603557	起步股份	新股网下	1,664	12,862.72

			发行		
广发证券	603630	拉芳家化	新股网下发行	1,985	36,504.15
广发证券	603639	海利尔	新股网下发行	563	14,046.85
广发证券	603683	晶华新材	新股网下发行	1,095	10,227.30
广发证券	603848	好太太	新股网下发行	1,377	10,864.53
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	002790	瑞尔特	新股网下发行	1,889	31,319.62
广发证券	300518	盛讯达	新股网下发行	722	16,042.84
广发证券	603028	赛福天	新股网下发行	3,309	14,096.34
广发证券	603131	上海沪工	新股网下发行	1,263	12,743.67
广发证券	603313	恒康家居	新股网下发行	1,030	15,872.30

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
000568	泸州老窖	2017-09-13	2018-09-14	非公开发行流	48.00	61.72	52,083	2,499,984.00	3,214,562.76	-

				通受限						
000568	泸州老窖	2017-09-13	2019-09-16	非公开发行流通受限	48.00	59.97	52,083	2,499,984.00	3,123,417.51	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
300713	英可瑞	2017-10-23	2018-11-01	老股转让流通受限	40.29	74.87	7,008	282,352.32	524,688.96	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

注：1) 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；

2) 根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东以外的股东减持所持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%。持有上市公司非公开发行股份的股东，通过集中竞价交易减持该部分股份的，除遵守前款规定外，自股份解除限售之日起 12 个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%。

7.4.9.2 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
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项停牌	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项停牌	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
601003	柳钢股份	2017-10-17	重大事项停牌	7.98	2018-01-18	7.50	550,000	4,333,294.00	4,389,000.00	-

601600	中国铝业	2017-09-12	重大事项 停牌	6.66	2018-02-26	7.28	400,000	3,156,962.50	2,664,000.00	-
--------	------	------------	------------	------	------------	------	---------	--------------	--------------	---

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.10 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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 62,041,446.85 元，属于第二层次的余额为 13,978,730.24 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 172,533,688.75 元，第二层次 3,832,079.68 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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)增值税

根据财政部、国家税务总局颁布的财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局颁布的财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除上述事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	75,750,496.14	40.14
	其中：股票	75,750,496.14	40.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	269,680.95	0.14
	其中：债券	269,680.95	0.14
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	98,717,603.86	52.31
8	其他各项资产	13,976,054.95	7.41
9	合计	188,713,835.90	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,462,000.00	10.99
C	制造业	45,658,974.43	24.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,366,112.55	2.88
J	金融业	-	-
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	32,323.20	0.02
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	4,197,000.00	2.25
S	综合	-	-
	合计	75,750,496.14	40.67

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002019	亿帆医药	299,950	6,673,887.50	3.58
2	600703	三安光电	250,000	6,347,500.00	3.41
3	000568	泸州老窖	104,166	6,337,980.27	3.40
4	600559	老白干酒	200,000	6,194,000.00	3.33
5	002456	欧菲科技	299,931	6,175,579.29	3.32
6	600188	兖州煤业	400,000	5,808,000.00	3.12
7	603993	洛阳钼业	800,000	5,504,000.00	2.96
8	002153	石基信息	200,000	5,332,000.00	2.86
9	000983	西山煤电	500,000	5,070,000.00	2.72
10	601003	柳钢股份	550,000	4,389,000.00	2.36

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.efunds.com.cn 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002716	金贵银业	41,859,484.69	21.88
2	002497	雅化集团	33,965,297.45	17.76
3	002008	大族激光	32,741,358.17	17.12
4	600519	贵州茅台	31,516,824.58	16.48
5	600809	山西汾酒	30,211,332.25	15.79
6	601012	隆基股份	29,668,555.00	15.51
7	600782	新钢股份	26,487,557.26	13.85
8	002466	天齐锂业	24,734,491.62	12.93
9	603993	洛阳钼业	22,595,608.76	11.81
10	600702	沱牌舍得	21,165,360.46	11.06
11	603969	银龙股份	21,042,644.00	11.00
12	600110	诺德股份	20,528,159.00	10.73
13	600885	宏发股份	19,460,105.93	10.17
14	002460	赣锋锂业	19,444,233.00	10.16
15	002530	金财互联	19,075,874.44	9.97
16	000002	万科A	18,885,586.74	9.87
17	600089	特变电工	18,727,977.57	9.79
18	300340	科恒股份	18,241,017.20	9.54
19	300294	博雅生物	18,057,393.72	9.44

20	600068	葛洲坝	17,687,024.80	9.25
21	000958	东方能源	17,265,896.85	9.03
22	300113	顺网科技	17,220,692.29	9.00
23	603799	华友钴业	17,059,066.00	8.92
24	000418	小天鹅 A	17,004,809.11	8.89
25	601669	中国电建	16,985,815.70	8.88
26	000725	京东方 A	16,566,000.00	8.66
27	002456	欧菲科技	16,547,653.97	8.65
28	002019	亿帆医药	16,477,624.00	8.61
29	300457	赢合科技	16,398,207.00	8.57
30	000711	京蓝科技	16,272,526.65	8.51
31	002597	金禾实业	16,230,847.56	8.48
32	600136	当代明诚	16,073,510.58	8.40
33	601618	中国中冶	15,450,577.36	8.08
34	300450	先导智能	15,193,004.16	7.94
35	300618	寒锐钴业	15,146,579.42	7.92
36	600392	盛和资源	14,960,357.32	7.82
37	000932	*ST 华菱	14,448,948.74	7.55
38	600884	杉杉股份	14,403,016.71	7.53
39	600567	山鹰纸业	14,374,309.00	7.51
40	600963	岳阳林纸	14,083,221.04	7.36
41	002230	科大讯飞	13,835,376.20	7.23
42	300097	智云股份	13,824,297.32	7.23
43	603288	海天味业	13,732,477.82	7.18
44	601988	中国银行	13,627,935.00	7.12
45	600970	中材国际	13,603,142.38	7.11
46	002365	永安药业	13,048,610.78	6.82
47	601088	中国神华	12,870,213.00	6.73
48	002127	南极电商	12,723,011.98	6.65
49	000807	云铝股份	12,585,193.00	6.58
50	600703	三安光电	12,565,810.00	6.57
51	000933	神火股份	12,554,746.52	6.56
52	601668	中国建筑	12,462,000.00	6.51
53	600183	生益科技	12,446,036.99	6.51
54	300319	麦捷科技	12,123,145.85	6.34
55	002542	中化岩土	11,836,054.34	6.19
56	600373	中文传媒	11,829,123.36	6.18
57	002572	索菲亚	11,793,721.76	6.17
58	601600	中国铝业	11,790,716.00	6.16
59	000568	泸州老窖	11,720,078.00	6.13
60	300545	联得装备	11,596,996.20	6.06
61	300568	星源材质	11,503,047.96	6.01
62	300059	东方财富	11,226,462.26	5.87
63	601678	滨化股份	11,198,366.32	5.85

64	300197	铁汉生态	11,108,525.60	5.81
65	002262	恩华药业	10,932,340.34	5.71
66	000980	众泰汽车	10,818,202.00	5.66
67	002236	大华股份	10,562,069.00	5.52
68	300648	星云股份	10,335,049.00	5.40
69	603869	北部湾旅	10,293,287.85	5.38
70	300628	亿联网络	10,262,917.00	5.36
71	600298	安琪酵母	10,069,411.35	5.26
72	601717	郑煤机	9,982,786.53	5.22
73	002384	东山精密	9,778,202.60	5.11
74	002153	石基信息	9,636,013.00	5.04
75	002155	湖南黄金	9,621,352.00	5.03
76	601888	中国国旅	9,560,795.28	5.00
77	600231	凌钢股份	9,488,972.00	4.96
78	000998	隆平高科	9,419,505.50	4.92
79	002635	安洁科技	9,370,620.00	4.90
80	300122	智飞生物	9,167,471.00	4.79
81	601766	中国中车	9,149,200.00	4.78
82	002032	苏泊尔	9,129,127.63	4.77
83	002562	兄弟科技	8,935,806.00	4.67
84	000877	天山股份	8,825,188.00	4.61
85	002304	洋河股份	8,742,428.24	4.57
86	300085	银之杰	8,705,409.70	4.55
87	002668	奥马电器	8,440,642.22	4.41
88	002068	黑猫股份	8,429,388.89	4.41
89	002285	世联行	8,407,330.00	4.39
90	603026	石大胜华	8,375,783.00	4.38
91	603040	新坐标	8,294,284.99	4.34
92	300409	道氏技术	8,219,298.10	4.30
93	600258	首旅酒店	8,204,295.03	4.29
94	000401	冀东水泥	8,197,746.00	4.29
95	300576	容大感光	8,164,551.00	4.27
96	601699	潞安环能	8,062,702.00	4.21
97	300672	国科微	8,011,800.36	4.19
98	300430	诚益通	7,998,565.00	4.18
99	002009	天奇股份	7,955,347.05	4.16
100	000596	古井贡酒	7,952,199.23	4.16
101	601800	中国交建	7,888,299.25	4.12
102	000600	建投能源	7,870,844.00	4.11
103	300024	机器人	7,830,490.75	4.09
104	600779	水井坊	7,794,454.45	4.07
105	002431	棕榈股份	7,772,657.90	4.06
106	300274	阳光电源	7,715,911.30	4.03
107	000065	北方国际	7,709,369.30	4.03

108	300359	全通教育	7,672,831.41	4.01
109	300078	思创医惠	7,644,827.15	4.00
110	600150	中国船舶	7,396,789.20	3.87
111	002573	清新环境	7,393,340.94	3.86
112	000963	华东医药	7,375,874.15	3.86
113	002039	黔源电力	7,260,887.16	3.80
114	002383	合众思壮	7,254,465.60	3.79
115	300346	南大光电	7,226,855.19	3.78
116	600409	三友化工	7,193,515.20	3.76
117	002812	创新股份	7,150,426.95	3.74
118	300474	景嘉微	7,095,139.93	3.71
119	002858	力盛赛车	7,037,194.00	3.68
120	300212	易华录	7,024,059.00	3.67
121	002391	长青股份	6,921,310.00	3.62
122	300679	电连技术	6,885,355.78	3.60
123	600188	兖州煤业	6,864,847.00	3.59
124	600491	龙元建设	6,797,126.00	3.55
125	300188	美亚柏科	6,740,559.00	3.52
126	600072	中船科技	6,735,976.50	3.52
127	600446	金证股份	6,730,507.60	3.52
128	600362	江西铜业	6,724,269.00	3.52
129	002120	韵达股份	6,719,457.85	3.51
130	600172	黄河旋风	6,605,367.80	3.45
131	300137	先河环保	6,591,852.00	3.45
132	002050	三花智控	6,577,940.76	3.44
133	000957	中通客车	6,534,238.00	3.42
134	000825	太钢不锈	6,461,778.00	3.38
135	600559	老白干酒	6,447,366.96	3.37
136	601069	西部黄金	6,355,600.00	3.32
137	002434	万里扬	6,349,636.00	3.32
138	603111	康尼机电	6,326,053.85	3.31
139	002807	江阴银行	6,312,902.00	3.30
140	000639	西王食品	6,281,500.00	3.28
141	600489	中金黄金	6,234,319.00	3.26
142	600596	新安股份	6,171,576.00	3.23
143	600028	中国石化	6,159,423.00	3.22
144	600486	扬农化工	5,953,761.00	3.11
145	603345	安井食品	5,893,547.24	3.08
146	300662	科锐国际	5,855,690.80	3.06
147	603138	海量数据	5,846,419.24	3.06
148	000661	长春高新	5,780,692.00	3.02
149	300308	中际旭创	5,754,432.00	3.01
150	600038	中直股份	5,737,875.12	3.00
151	002826	易明医药	5,691,622.50	2.98

152	000970	中科三环	5,638,331.86	2.95
153	600569	安阳钢铁	5,623,009.00	2.94
154	603959	百利科技	5,619,067.40	2.94
155	002002	鸿达兴业	5,588,825.18	2.92
156	002245	澳洋顺昌	5,576,960.00	2.92
157	300316	晶盛机电	5,571,581.98	2.91
158	002707	众信旅游	5,339,496.67	2.79
159	600338	西藏珠峰	5,318,064.75	2.78
160	000538	云南白药	5,290,709.00	2.77
161	600031	三一重工	5,288,498.00	2.76
162	000830	鲁西化工	5,246,064.25	2.74
163	000717	韶钢松山	5,195,899.63	2.72
164	601186	中国铁建	5,095,105.00	2.66
165	600497	驰宏锌锗	5,094,304.00	2.66
166	601799	星宇股份	4,981,483.00	2.60
167	000983	西山煤电	4,942,745.97	2.58
168	002430	杭氧股份	4,895,898.93	2.56
169	600549	厦门钨业	4,891,140.80	2.56
170	000961	中南建设	4,881,208.00	2.55
171	000928	中钢国际	4,876,610.00	2.55
172	603797	联泰环保	4,856,039.00	2.54
173	600595	中孚实业	4,832,440.00	2.53
174	000895	双汇发展	4,773,025.87	2.50
175	300467	迅游科技	4,749,756.00	2.48
176	002601	龙麟佰利	4,731,639.84	2.47
177	603939	益丰药房	4,675,772.71	2.44
178	300156	神雾环保	4,662,771.95	2.44
179	601000	唐山港	4,656,500.00	2.43
180	600201	生物股份	4,628,562.00	2.42
181	600701	工大高新	4,604,047.00	2.41
182	300161	华中数控	4,574,250.50	2.39
183	600019	宝钢股份	4,511,525.16	2.36
184	300355	蒙草生态	4,479,045.00	2.34
185	300393	中来股份	4,433,393.00	2.32
186	601688	华泰证券	4,400,033.00	2.30
187	601388	怡球资源	4,384,147.00	2.29
188	600545	卓郎智能	4,367,764.00	2.28
189	002739	万达电影	4,362,216.36	2.28
190	603903	中持股份	4,357,059.28	2.28
191	000960	锡业股份	4,343,890.00	2.27
192	601003	柳钢股份	4,333,294.00	2.27
193	601225	陕西煤业	4,313,133.06	2.25
194	002496	辉丰股份	4,312,356.00	2.25
195	600734	实达集团	4,280,313.00	2.24

196	600988	赤峰黄金	4,275,274.00	2.23
197	600196	复星医药	4,259,896.00	2.23
198	002092	中泰化学	4,238,902.00	2.22
199	603677	奇精机械	4,216,323.91	2.20
200	002240	威华股份	4,203,279.00	2.20
201	600977	中国电影	4,187,702.28	2.19
202	002251	步步高	4,177,686.00	2.18
203	600213	亚星客车	4,173,738.11	2.18
204	002457	青龙管业	4,155,288.00	2.17
205	600585	海螺水泥	4,137,796.88	2.16
206	300327	中颖电子	4,117,745.00	2.15
207	002766	索菱股份	4,068,935.48	2.13
208	603626	科森科技	4,057,680.30	2.12
209	002636	金安国纪	4,049,348.00	2.12
210	002108	沧州明珠	4,042,048.00	2.11
211	600438	通威股份	4,033,997.00	2.11
212	002640	跨境通	3,992,626.00	2.09
213	600660	福耀玻璃	3,982,543.61	2.08
214	601117	中国化学	3,946,760.42	2.06
215	600141	兴发集团	3,926,710.84	2.05
216	002797	第一创业	3,923,690.47	2.05
217	002080	中材科技	3,922,576.62	2.05
218	603337	杰克股份	3,897,545.76	2.04
219	601200	上海环境	3,869,193.49	2.02
220	603323	吴江银行	3,829,000.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002716	金贵银业	46,471,412.10	24.29
2	600519	贵州茅台	41,398,896.63	21.64
3	002008	大族激光	36,403,467.81	19.03
4	002497	雅化集团	35,531,050.97	18.57
5	601012	隆基股份	32,959,811.03	17.23
6	600809	山西汾酒	29,935,540.06	15.65
7	002466	天齐锂业	29,025,374.73	15.17
8	600110	诺德股份	26,576,472.60	13.89
9	600782	新钢股份	26,072,187.00	13.63
10	002530	金财互联	24,104,149.13	12.60

11	601669	中国电建	22,920,666.90	11.98
12	600068	葛洲坝	22,490,224.02	11.76
13	600702	沱牌舍得	22,276,483.70	11.64
14	600392	盛和资源	21,687,703.63	11.34
15	601668	中国建筑	21,437,271.00	11.21
16	603969	银龙股份	20,894,203.00	10.92
17	600885	宏发股份	19,890,971.06	10.40
18	000002	万科A	19,020,261.29	9.94
19	000958	东方能源	18,594,139.44	9.72
20	603993	洛阳钼业	18,550,227.06	9.70
21	603799	华友钴业	18,542,909.87	9.69
22	002460	赣锋锂业	18,488,046.59	9.66
23	600089	特变电工	18,291,156.93	9.56
24	300294	博雅生物	17,701,431.17	9.25
25	300618	寒锐钴业	17,096,131.92	8.94
26	000711	京蓝科技	16,934,306.05	8.85
27	002597	金禾实业	16,790,716.16	8.78
28	300113	顺网科技	16,693,148.97	8.73
29	300340	科恒股份	16,298,608.99	8.52
30	000418	小天鹅A	16,170,606.55	8.45
31	601800	中国交建	16,024,986.61	8.38
32	000932	*ST 华菱	15,886,236.86	8.30
33	600567	山鹰纸业	15,778,884.00	8.25
34	600963	岳阳林纸	15,448,115.41	8.08
35	000725	京东方A	15,390,000.00	8.04
36	300457	赢合科技	15,371,049.46	8.04
37	002262	恩华药业	15,011,296.20	7.85
38	300450	先导智能	14,968,245.89	7.82
39	600884	杉杉股份	14,801,980.11	7.74
40	601618	中国中冶	14,787,041.16	7.73
41	002127	南极电商	14,063,573.00	7.35
42	601600	中国铝业	13,944,643.54	7.29
43	600183	生益科技	13,887,789.09	7.26
44	601717	郑煤机	13,858,396.48	7.24
45	002365	永安药业	13,557,732.35	7.09
46	000858	五粮液	13,479,576.41	7.05
47	603288	海天味业	13,248,538.27	6.93
48	601988	中国银行	13,122,500.00	6.86
49	002230	科大讯飞	12,937,109.84	6.76
50	600362	江西铜业	12,528,567.44	6.55
51	601088	中国神华	12,456,730.00	6.51
52	300097	智云股份	12,394,574.75	6.48
53	300545	联得装备	12,351,622.36	6.46
54	300078	思创医惠	12,261,230.12	6.41

55	300059	东方财富	12,155,661.19	6.35
56	300648	星云股份	12,126,044.00	6.34
57	600779	水井坊	11,972,275.30	6.26
58	002542	中化岩土	11,840,150.05	6.19
59	600373	中文传媒	11,762,084.70	6.15
60	600970	中材国际	11,719,574.80	6.13
61	002572	索菲亚	11,675,082.19	6.10
62	300319	麦捷科技	11,427,802.27	5.97
63	002236	大华股份	11,374,170.53	5.95
64	600136	当代明诚	11,275,337.37	5.89
65	000933	神火股份	11,255,821.69	5.88
66	601678	滨化股份	11,139,215.06	5.82
67	601186	中国铁建	10,834,999.45	5.66
68	000980	众泰汽车	10,431,555.00	5.45
69	002019	亿帆医药	10,238,680.34	5.35
70	002032	苏泊尔	10,132,627.88	5.30
71	300568	星源材质	10,126,269.07	5.29
72	000807	云铝股份	10,102,641.28	5.28
73	002635	安洁科技	9,949,519.04	5.20
74	600497	驰宏锌锗	9,944,854.40	5.20
75	300197	铁汉生态	9,851,441.80	5.15
76	601390	中国中铁	9,843,215.42	5.15
77	600298	安琪酵母	9,804,091.00	5.12
78	000998	隆平高科	9,777,094.12	5.11
79	300628	亿联网络	9,661,603.00	5.05
80	002456	欧菲科技	9,597,945.59	5.02
81	603869	北部湾旅	9,522,701.59	4.98
82	002384	东山精密	9,513,027.26	4.97
83	601766	中国中车	9,374,086.00	4.90
84	601888	中国国旅	9,311,514.73	4.87
85	300085	银之杰	9,107,345.55	4.76
86	300122	智飞生物	9,071,211.20	4.74
87	002668	奥马电器	8,915,911.27	4.66
88	601699	潞安环能	8,810,455.75	4.61
89	300672	国科微	8,644,550.30	4.52
90	002601	龙蟠佰利	8,632,118.72	4.51
91	002138	顺络电子	8,611,386.06	4.50
92	002068	黑猫股份	8,608,598.00	4.50
93	603040	新坐标	8,582,339.00	4.49
94	002812	创新股份	8,522,169.60	4.45
95	600231	凌钢股份	8,483,718.00	4.43
96	000401	冀东水泥	8,461,527.87	4.42
97	002562	兄弟科技	8,442,790.00	4.41
98	002304	洋河股份	8,359,101.81	4.37

99	000600	建投能源	8,313,857.84	4.35
100	000877	天山股份	8,288,744.48	4.33
101	603026	石大胜华	8,225,425.00	4.30
102	002431	棕榈股份	8,214,916.26	4.29
103	600258	首旅酒店	7,936,268.05	4.15
104	600491	龙元建设	7,888,551.32	4.12
105	002285	世联行	7,787,507.00	4.07
106	600409	三友化工	7,759,235.62	4.06
107	300024	机器人	7,734,171.45	4.04
108	002155	湖南黄金	7,698,746.21	4.02
109	000065	北方国际	7,590,707.22	3.97
110	002573	清新环境	7,585,972.76	3.97
111	002009	天奇股份	7,561,538.56	3.95
112	600547	山东黄金	7,507,466.00	3.92
113	300430	诚益通	7,506,509.70	3.92
114	300576	容大感光	7,434,251.12	3.89
115	002039	黔源电力	7,430,153.68	3.88
116	000568	泸州老窖	7,375,776.92	3.86
117	000596	古井贡酒	7,225,699.04	3.78
118	600988	赤峰黄金	7,197,240.00	3.76
119	300274	阳光电源	7,140,972.71	3.73
120	000963	华东医药	7,125,300.76	3.72
121	000957	中通客车	7,073,098.57	3.70
122	002120	韵达股份	7,063,667.52	3.69
123	300409	道氏技术	6,995,437.64	3.66
124	600446	金证股份	6,990,917.86	3.65
125	600150	中国船舶	6,954,476.78	3.64
126	300359	全通教育	6,931,301.63	3.62
127	002050	三花智控	6,838,551.00	3.57
128	300188	美亚柏科	6,835,835.31	3.57
129	300679	电连技术	6,760,586.10	3.53
130	300346	南大光电	6,724,003.88	3.51
131	002761	多喜爱	6,717,384.75	3.51
132	300137	先河环保	6,708,470.00	3.51
133	002391	长青股份	6,702,420.00	3.50
134	603111	康尼机电	6,587,620.50	3.44
135	002826	易明医药	6,538,467.00	3.42
136	300212	易华录	6,438,968.00	3.37
137	300474	景嘉微	6,434,252.50	3.36
138	600072	中船科技	6,423,998.14	3.36
139	600172	黄河旋风	6,309,727.00	3.30
140	002807	江阴银行	6,283,975.00	3.28
141	600596	新安股份	6,212,016.10	3.25
142	002383	合众思壮	6,197,258.40	3.24

143	000970	中科三环	6,153,843.00	3.22
144	000639	西王食品	6,109,604.67	3.19
145	002434	万里扬	6,089,019.01	3.18
146	600489	中金黄金	6,066,133.00	3.17
147	600028	中国石化	6,021,631.00	3.15
148	600486	扬农化工	5,874,531.34	3.07
149	000830	鲁西化工	5,806,796.00	3.04
150	600038	中直股份	5,767,088.42	3.01
151	000661	长春高新	5,742,074.56	3.00
152	600338	西藏珠峰	5,677,689.00	2.97
153	000825	太钢不锈	5,670,199.00	2.96
154	300316	晶盛机电	5,623,182.00	2.94
155	601069	西部黄金	5,602,512.00	2.93
156	002245	澳洋顺昌	5,581,507.18	2.92
157	300662	科锐国际	5,565,940.24	2.91
158	600595	中孚实业	5,537,084.00	2.89
159	002002	鸿达兴业	5,531,215.63	2.89
160	603345	安井食品	5,439,057.65	2.84
161	600031	三一重工	5,362,163.00	2.80
162	601799	星宇股份	5,340,906.00	2.79
163	603959	百利科技	5,254,153.57	2.75
164	300308	中际旭创	5,247,034.28	2.74
165	002430	杭氧股份	5,219,414.55	2.73
166	000895	双汇发展	5,171,754.50	2.70
167	603138	海量数据	5,149,956.80	2.69
168	600703	三安光电	5,081,567.00	2.66
169	002858	力盛赛车	5,055,354.00	2.64
170	600438	通威股份	4,997,909.00	2.61
171	002707	众信旅游	4,996,295.00	2.61
172	600701	工大高新	4,983,837.80	2.61
173	600039	四川路桥	4,865,000.00	2.54
174	603939	益丰药房	4,858,852.23	2.54
175	000538	云南白药	4,835,035.00	2.53
176	603986	兆易创新	4,736,859.72	2.48
177	600569	安阳钢铁	4,728,488.00	2.47
178	002739	万达电影	4,703,229.81	2.46
179	600213	亚星客车	4,683,005.00	2.45
180	600549	厦门钨业	4,680,034.00	2.45
181	002200	云投生态	4,673,646.90	2.44
182	600201	生物股份	4,641,841.67	2.43
183	300156	神雾环保	4,628,477.83	2.42
184	601688	华泰证券	4,611,238.00	2.41
185	000717	韶钢松山	4,506,301.00	2.36
186	002496	辉丰股份	4,384,330.00	2.29

187	603626	科森科技	4,371,990.80	2.29
188	300355	蒙草生态	4,371,754.44	2.29
189	000961	中南建设	4,345,234.00	2.27
190	002153	石基信息	4,323,562.00	2.26
191	600019	宝钢股份	4,322,816.00	2.26
192	600585	海螺水泥	4,306,898.12	2.25
193	600196	复星医药	4,285,860.00	2.24
194	600977	中国电影	4,240,140.71	2.22
195	603337	杰克股份	4,158,178.55	2.17
196	002766	索菱股份	4,101,070.50	2.14
197	601000	唐山港	4,096,513.00	2.14
198	603677	奇精机械	4,083,210.46	2.13
199	300467	迅游科技	4,079,520.00	2.13
200	300296	利亚德	4,065,410.00	2.13
201	601388	怡球资源	4,008,700.00	2.10
202	000960	锡业股份	3,994,435.95	2.09
203	300327	中颖电子	3,952,119.27	2.07
204	603903	中持股份	3,951,186.66	2.07
205	000928	中钢国际	3,925,146.40	2.05
206	002080	中材科技	3,864,909.32	2.02
207	000930	中粮生化	3,853,918.34	2.01
208	002307	北新路桥	3,840,017.00	2.01
209	603323	吴江银行	3,827,959.36	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,310,304,902.13
卖出股票收入（成交）总额	2,421,155,439.63

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
	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）	269,680.95	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	269,680.95	0.14

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	128021	兄弟转债	2,715	269,680.95	0.14

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	300,780.80
2	应收证券清算款	13,660,466.65
3	应收股利	-
4	应收利息	9,159.68
5	应收申购款	5,647.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,976,054.95

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601003	柳钢股份	4,389,000.00	2.36	重大事项停牌
2	000568	泸州老窖	3,214,562.76	1.73	非公开发行流通受限
3	000568	泸州老窖	3,123,417.51	1.68	非公开发行流通受限

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东以外的股东减持所持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%。持有上市公司非公开发行股份的股东，通过集中竞价交易减持该部分股份的，除遵守前款规定外，自股份解除限售之日起 12 个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达瑞享混合 I	585	147,317.60	78,645,384.75	91.26%	7,535,412.74	8.74%
易方达瑞享混合 E	536	123,172.72	61,148,860.70	92.62%	4,871,715.53	7.38%
合计	1,121	135,772.86	139,794,245.45	91.85%	12,407,128.27	8.15%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达瑞享混合 I	1,170,088.98	1.3577%
	易方达瑞享混合 E	7,875.77	0.0119%
	合计	1,177,964.75	0.7740%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达瑞享混合 I	易方达瑞享混合 E
基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日）基金份额总额	160,122,734.71	53,678,966.58
本报告期期初基金份额总额	89,272,210.95	70,555,924.20
本报告期基金总申购份额	19,942,002.30	38,016,529.91
减：本报告期基金总赎回份额	23,033,415.76	42,551,877.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	86,180,797.49	66,020,576.23

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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）。

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 3 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 60,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比重	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	2,184,399,323.19	46.29%	2,034,336.93	46.29%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	1,288,964,519.94	27.32%	1,200,411.83	27.32%	-
申万宏源	2	1,245,447,093.15	26.39%	1,159,886.66	26.39%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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12月31日	139,794,245.45	-	-	139,794,245.45	91.85%
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>							

易方达基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日