

易方达行业领先企业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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	易方达行业领先混合
基金主代码	110015
交易代码	110015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 3 月 26 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	427,484,312.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在优化行业资产配置的基础上，从行业领先企业中精选行业龙头与高成长企业进行投资，力求基金资产的长期增值。
投资策略	在行业配置的基础上，本基金将从各细分行业中选择行业领先企业，然后从行业领先企业中选择行业龙头企业和具有较高成长性的公司，构造股票组合。
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	中国工商银行股份有限公司
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
客户服务电话	400 881 8088	95588
传真	020-85104666	010-66105798

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
本期已实现收益	40,279,205.96	-61,815,893.86	254,985,623.49
本期利润	249,170,850.18	-172,242,178.16	322,115,344.40
加权平均基金份额本期利润	0.6727	-0.4784	0.7671
本期基金份额净值增长率	42.10%	-19.77%	68.26%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.8737	0.6888	1.0201
期末基金资产净值	1,026,089,984.91	583,466,486.89	827,220,399.18
期末基金份额净值	2.400	1.689	2.248

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。

3.2 基金净值表现

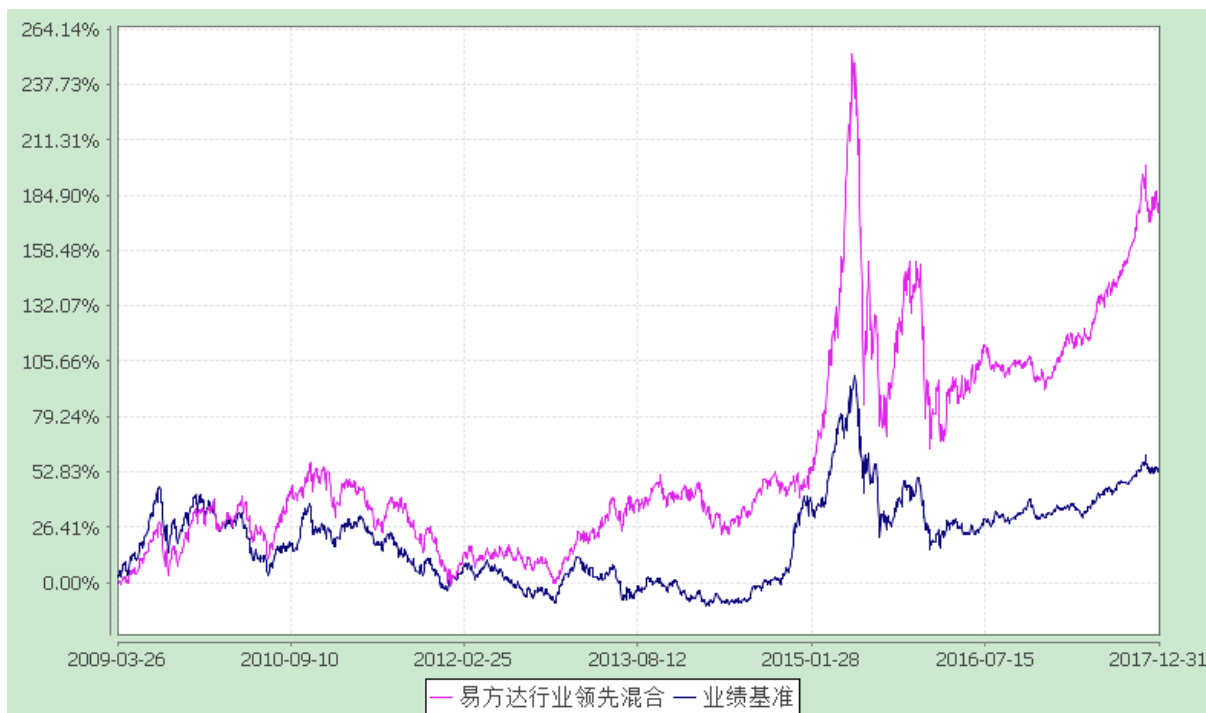
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	8.79%	1.26%	3.77%	0.64%	5.02%	0.62%
过去六个月	19.11%	1.03%	7.58%	0.56%	11.53%	0.47%
过去一年	42.10%	0.89%	16.57%	0.51%	25.53%	0.38%
过去三年	91.82%	2.07%	10.91%	1.35%	80.91%	0.72%
过去五年	150.28%	1.79%	47.82%	1.24%	102.46%	0.55%
自基金合同生效起至今	180.56%	1.62%	54.02%	1.23%	126.54%	0.39%

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

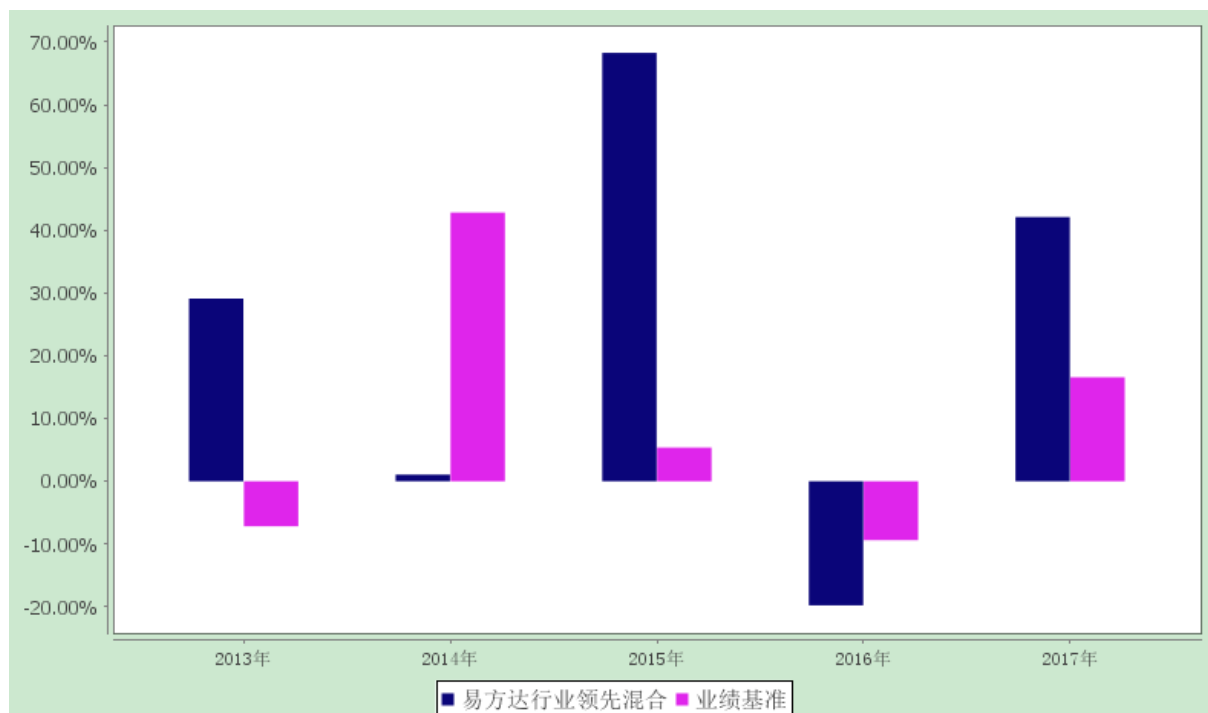
易方达行业领先企业混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2009年3月26日至2017年12月31日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 180.56%，同期业绩比较基准收益率为 54.02%。

3.2.3 过去五年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

易方达行业领先企业混合型证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年	-	-	-	-	-
2016年	1.100	20,882,083.53	20,508,494.35	41,390,577.88	-
2015年	-	-	-	-	-
合计	1.100	20,882,083.53	20,508,494.35	41,390,577.88	-

§ 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		
冯波	本基金的基金经理、研究部总经理	2010-01-01	-	16 年	硕士研究生，曾任广东发展银行行员，易方达基金管理有限公司市场拓展部研究员、市场拓展部副经理、市场部大区销售经理、北京分公司副总经理、研究部行业研究员、基金经理助理、研究部总经理助理、研究部副总经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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 and 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 年，中国经济持续回暖，受益于房地产市场活跃和国家供给侧改革的实施，PPI 逐季走强，传统行业盈利水平大幅修复。同时，居民消费支出回升，进出口额持续提高，为经济增长提供明显支撑。2017 年全年我国 GDP 增速达 6.9%，为近年来最好水平。受益于经济复苏、企业效益持续改善，以煤炭、钢铁、化工、地产为代表的周期性行业利润水平大幅反弹。金融、白酒、家电、轻工、消费电子、光伏等行业也出现明显改善。

在经济复苏和资本市场开放的大背景下，A 股市场持续向好，并出现剧烈的结构分化。2017 年上证指数收于 3307 点，上涨 6.56%，上证 50 指数全年大幅上涨 25.08%，而同期创业板指数下跌 10.67%。低估值蓝筹股和行业龙头企业表现明显好于整体市场和以中小市值为主的创业板。值得关注的是，外资持续流入成为影响 A 股市场的重要力量，进一步加剧了市场的分化行情。

基于对经济和市场相对乐观的判断，本基金在资产配置上侧重于股票市场，全年始终保持相对稳定的股票仓位。在行业配置上，本基金重点投资了家电、白酒、银行、保险、光伏、消费电子等行业，以及盈利能力持续改善的龙头企业。在个股选择上，本基金强调企业的竞争壁垒和估值与成长的匹配，不断进行结构调整，取得了较好效果。

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 2.400 元，本报告期份额净值增长率为 42.10%，同期业绩比较基准收益率为 16.57%。

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，在全球经济的持续复苏和各项改革政策实施的背景下，我们认为中国经济仍将持续、稳健的增长，企业盈利也将保持在较好水平。受地产调控、金融去杠杆、中美潜在摩擦等影响，经济的波动性可能有所增加。资本市场方面，不断深化的对外开放，使 A 股迅速向国际接轨，企业盈利改善与估值重构将同步对市场产生重要影响。企业的价值将成为决定股价的主要因素，博弈占主导的市场特征可能将一去不复返。

基于以上判断，在资产配置上，我们将不断提升自上而下的资产配置能力，把握经济变化所带来的投资机会。在行业配置上，重点关注金融、家电、消费和周期性行业的机会。在个股选择上，积极寻找竞争壁垒突出，业绩成长与估值水平合理的公司，以获取稳定的投资收益。

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

根据相关法律法规及《易方达行业领先企业混合型证券投资基金基金合同》，本基金本报告期内应分配利润 37,348,459.89 元；本报告期内未进行利润分配；本报告期末应分配尚未实施的利润为 37,348,459.89 元，本基金已于 2018 年 1 月 16 日进行了利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.90 元，总分配金额为 38,683,857.83 元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对易方达行业领先企业混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，易方达行业领先企业混合型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达行业领先企业混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，易方达行业领先企业混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达行业领先企业混合型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：易方达行业领先企业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	154,393,815.72	82,035,839.56
结算备付金	1,854,632.10	2,190,334.66
存出保证金	172,078.58	264,504.10
交易性金融资产	872,176,744.07	505,107,186.44
其中：股票投资	867,410,163.97	485,175,186.44
基金投资	-	-
债券投资	4,766,580.10	19,932,000.00
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	261,896.78	-
应收利息	32,623.68	193,744.46
应收股利	-	-
应收申购款	2,299,886.20	79,585.59
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,031,191,677.13	589,871,194.81
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017年12月31日	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	-	3,256,101.82
应付赎回款	2,711,956.57	1,109,026.46
应付管理人报酬	1,308,015.25	758,088.75
应付托管费	218,002.58	126,348.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	487,408.68	793,533.99
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	376,309.14	361,608.78
负债合计	5,101,692.22	6,404,707.92
所有者权益:		
实收基金	427,484,312.74	345,489,480.33
未分配利润	598,605,672.17	237,977,006.56

所有者权益合计	1,026,089,984.91	583,466,486.89
负债和所有者权益总计	1,031,191,677.13	589,871,194.81

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.400 元，基金份额总额 427,484,312.74 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达行业领先企业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	265,277,329.99	-154,538,924.48
1.利息收入	1,271,785.68	1,408,282.47
其中：存款利息收入	769,078.27	630,063.51
债券利息收入	253,577.86	778,218.96
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	249,129.55	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	54,742,429.96	-45,772,565.69
其中：股票投资收益	46,227,207.72	-49,507,274.23
基金投资收益	-	-
债券投资收益	10,200.00	102,202.59
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	8,505,022.24	3,632,505.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	208,891,644.22	-110,426,284.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	371,470.13	251,643.04
减：二、费用	16,106,479.81	17,703,253.68
1. 管理人报酬	11,242,572.20	9,144,094.62
2. 托管费	1,873,762.11	1,524,015.69
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,578,250.75	6,633,024.88
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	411,894.75	402,118.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	249,170,850.18	-172,242,178.16
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	249,170,850.18	-172,242,178.16

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达行业领先企业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）	345,489,480.33	237,977,006.56	583,466,486.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	249,170,850.18	249,170,850.18
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）	81,994,832.41	111,457,815.43	193,452,647.84

其中：1.基金申购款	263,258,147.36	324,978,844.40	588,236,991.76
2.基金赎回款	-181,263,314.95	-213,521,028.97	-394,784,343.92
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）	427,484,312.74	598,605,672.17	1,026,089,984.91
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）	368,038,722.73	459,181,676.45	827,220,399.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-172,242,178.16	-172,242,178.16
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）	-22,549,242.40	-7,571,913.85	-30,121,156.25
其中：1.基金申购款	128,470,421.45	86,701,148.80	215,171,570.25
2.基金赎回款	-151,019,663.85	-94,273,062.65	-245,292,726.50
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）	-	-41,390,577.88	-41,390,577.88
五、期末所有者权益（基金净值）	345,489,480.33	237,977,006.56	583,466,486.89

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

本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 1315 号《关于核准易方达行业领先企业股票型证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达行业领先企业股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达行业领先企业股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 3 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,091,745,438.87 份基金份额，其中认购资金利息折合 528,965.17 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，注册登记机构为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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“易方达行业领先企业股票型证券投资基金”更名为“易方达行业领先企业混合型证券投资基金”。

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》、《易方达行业领先企业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不

重大。

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
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	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
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

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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	97,570,723.36	5.48%	31,715,998.12	0.71%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31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	78,056.08	4.91%	15,849.66	3.25%
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	25,372.54	0.65%	25,372.54	3.20%

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。

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	11,242,572.20	9,144,094.62
其中：支付销售机构的客户维护费	1,823,040.76	1,596,171.69

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年 12月31日	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	1,873,762.11	1,524,015.69

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 2.5‰ 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\text{‰} \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

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

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。

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

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
中国工商银行-活期存款	154,393,815.72	748,776.95	82,035,839.56	589,521.26

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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
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	2017-12-28	2018-01-05	新股	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123003	蓝思转债	2017-12-08	2018-01-17	新发流通受限	100.00	100.00	5,500	550,000.00	550,000.00	-

注：以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

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
300523	辰安科技	2017-10-20	重大事项停牌	47.30	2018-02-06	42.57	64,260	3,308,112.60	3,039,498.00	-
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	-

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 868,578,444.56 元，属于第二层次的余额为 3,598,299.51 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 447,285,287.67 元，第二层次 57,821,898.77 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	867,410,163.97	84.12
	其中：股票	867,410,163.97	84.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,766,580.10	0.46
	其中：债券	4,766,580.10	0.46
	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	156,248,447.82	15.15
8	其他各项资产	2,766,485.24	0.27
9	合计	1,031,191,677.13	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	19,750,400.00	1.92
C	制造业	655,509,478.92	63.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	28,354,200.84	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	6,769,442.76	0.66

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,073,610.55	0.30
J	金融业	118,673,872.50	11.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,830,692.00	1.93
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	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,400,000.00	1.50
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	867,410,163.97	84.54

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	601012	隆基股份	2,539,839	92,551,733.16	9.02
2	600036	招商银行	2,170,534	62,988,896.68	6.14
3	000651	格力电器	1,400,000	61,180,000.00	5.96
4	000858	五粮液	650,000	51,922,000.00	5.06
5	000333	美的集团	800,000	44,344,000.00	4.32
6	002142	宁波银行	2,026,422	36,090,575.82	3.52
7	002008	大族激光	650,000	32,110,000.00	3.13
8	600703	三安光电	1,254,956	31,863,332.84	3.11
9	000568	泸州老窖	430,000	28,380,000.00	2.77
10	002475	立讯精密	1,200,000	28,128,000.00	2.74

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	600036	招商银行	61,211,767.30	10.49
2	000651	格力电器	45,087,948.69	7.73
3	002236	大华股份	39,116,999.34	6.70
4	600703	三安光电	27,603,521.79	4.73
5	002640	跨境通	24,757,373.88	4.24
6	002142	宁波银行	24,570,068.57	4.21
7	002600	江粉磁材	24,511,745.53	4.20
8	002475	立讯精密	24,316,772.81	4.17
9	601012	隆基股份	23,594,606.13	4.04
10	002456	欧菲科技	21,266,209.79	3.64
11	601688	华泰证券	20,483,111.00	3.51
12	600958	东方证券	17,553,793.00	3.01
13	600585	海螺水泥	17,378,149.58	2.98
14	300545	联得装备	17,146,552.82	2.94
15	000725	京东方 A	14,886,528.00	2.55
16	600392	盛和资源	14,109,073.00	2.42
17	300015	爱尔眼科	13,590,289.25	2.33
18	600196	复星医药	13,375,897.00	2.29
19	600801	华新水泥	13,133,608.87	2.25
20	601318	中国平安	13,046,802.00	2.24
21	600486	扬农化工	13,000,119.00	2.23
22	002635	安洁科技	12,878,823.22	2.21
23	300316	晶盛机电	12,837,644.21	2.20
24	601799	星宇股份	12,516,387.00	2.15
25	000709	河钢股份	12,415,000.00	2.13
26	300068	南都电源	12,304,263.64	2.11
27	002391	长青股份	12,102,038.45	2.07

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	601009	南京银行	25,828,990.01	4.43
2	002008	大族激光	24,087,978.50	4.13
3	002138	顺络电子	22,925,705.24	3.93

4	300393	中来股份	21,965,398.25	3.76
5	000333	美的集团	21,078,859.91	3.61
6	000513	丽珠集团	20,408,235.12	3.50
7	600409	三友化工	19,912,389.70	3.41
8	601688	华泰证券	18,913,838.16	3.24
9	002019	亿帆医药	18,502,205.22	3.17
10	600392	盛和资源	18,403,922.74	3.15
11	002567	唐人神	17,354,166.99	2.97
12	300160	秀强股份	17,070,207.31	2.93
13	600958	东方证券	16,655,134.00	2.85
14	601717	郑煤机	16,008,362.48	2.74
15	300545	联得装备	15,418,152.03	2.64
16	002635	安洁科技	15,378,341.46	2.64
17	603989	艾华集团	15,281,754.00	2.62
18	600596	新安股份	14,520,532.97	2.49
19	600801	华新水泥	14,044,900.92	2.41
20	000725	京东方 A	13,938,000.00	2.39
21	600887	伊利股份	13,848,965.00	2.37
22	300316	晶盛机电	13,528,843.11	2.32
23	601336	新华保险	12,975,170.41	2.22
24	600141	兴发集团	12,212,457.00	2.09
25	000709	河钢股份	11,985,000.00	2.05
26	002826	易明医药	11,692,223.03	2.00
27	601933	永辉超市	11,691,646.00	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	957,968,476.95
卖出股票收入（成交）总额	830,138,947.85

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）	4,766,580.10	0.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,766,580.10	0.46

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	113015	隆基转债	35,610	4,216,580.10	0.41
2	123003	蓝思转债	5,500	550,000.00	0.05

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 宁波银行（代码：002142）为易方达行业领先企业混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。2017年1月23日、2017年2月20日，宁波银监局针对宁波银行关联交易管理不到位、票据同业业务未能持续实行同业专营制管理、监管政策未严格执行、监管意见执行不力等行为，处以人民币350万元的行政处罚。2017年10月10日，宁波银监局针对宁波银行以贷转存等，处以人

民币 50 万元的行政处罚。

招商银行（代码：600036）为易方达行业领先企业混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。

2017 年 3 月 29 日，中国银监会针对招商银行批量转让个人贷款，处以人民币 50 万元的行政处罚。

本基金投资宁波银行、招商银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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	172,078.58
2	应收证券清算款	261,896.78
3	应收股利	-
4	应收利息	32,623.68
5	应收申购款	2,299,886.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,766,485.24

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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

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
25,482	16,775.93	37,531,069.81	8.78%	389,953,242.93	91.22%

9.2 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	955,512.31	0.2235%

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	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	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年3月26日)基金份额总额	4,091,745,438.87
本报告期期初基金份额总额	345,489,480.33
本报告期基金总申购份额	263,258,147.36
减：本报告期基金总赎回份额	181,263,314.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	427,484,312.74

§ 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。

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 9 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 68,000.00 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	78,458,184.01	4.41%	73,067.89	4.60%	-
招商证券	2	114,834,119.75	6.45%	106,945.07	6.73%	-
华西证券	1	128,847,796.48	7.24%	103,077.27	6.48%	-
国泰君安	1	13,213,735.00	0.74%	12,305.96	0.77%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	8,089,778.81	0.45%	7,534.01	0.47%	-
瑞银证券	1	36,043,678.23	2.02%	33,567.00	2.11%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	15,080,740.24	0.85%	14,044.53	0.88%	-
东兴证券	1	176,737,968.74	9.93%	164,595.32	10.35%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	19,412,371.27	1.09%	18,078.83	1.14%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

西部证券	1	13,850,306.50	0.78%	12,898.69	0.81%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	99,738,251.39	5.60%	92,886.59	5.84%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	28,823,876.54	1.62%	26,843.50	1.69%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	40,106,758.78	2.25%	37,342.93	2.35%	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	213,761,511.31	12.01%	199,076.32	12.52%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	218,035,078.97	12.25%	203,054.44	12.77%	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	303,461,757.71	17.04%	259,982.27	16.35%	-
广发证券	1	97,570,723.36	5.48%	78,056.08	4.91%	-
方正证券	1	55,786,154.96	3.13%	51,953.36	3.27%	-
华创证券	2	118,560,103.47	6.66%	94,848.27	5.96%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少财富证券有限责任公司一个交易单元,无新增交易单元。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	310,000,0 00.00	58.49%	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	50,000,00 0.00	9.43%	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	170,000,0 00.00	32.08%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日