

# 易方达策略成长二号混合型证券投资基金

## 2018 年年度报告摘要

2018 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：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年三月二十八日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 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。安永华明会计师事务所（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 2018 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	易方达策略成长二号混合
基金主代码	112002
交易代码	112002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 8 月 16 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,173,970,741.31 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资兼具较高内在价值和良好成长性的股票，积极把握股票市场波动所带来的获利机会，努力为基金份额持有人追求较高的中长期资本增值。
投资策略	本基金投资的总体原则是在价值区域内把握波动，在波动中实现研究的“溢价”。基金采取相对稳定的资产配置策略，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。同时，以雄厚的研究力量为依托，通过以价值成长比率（PEG）为核心的系统方法筛选出兼具较高内在价值及良好成长性的股票，并通过对相关行业和上市公司成长率变化的动态预测，积极把握行业/板块、个股的市场波动所带来的获利机会，为基金持有人追求较高的当期收益及长期资本增值。
业绩比较基准	上证 A 指收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	王永民

负责人	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942

## 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	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-311,364,820.95	133,691,787.69	-398,024,081.34
本期利润	-402,573,981.19	211,227,476.75	-669,799,447.54
加权平均基金份额本期利润	-0.3396	0.1692	-0.5258
本期基金份额净值增长率	-32.21%	17.67%	-32.44%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2793	0.1115	-0.0379
期末基金资产净值	846,026,223.30	1,324,130,310.49	1,252,806,860.29
期末基金份额净值	0.721	1.111	0.962

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	-18.25%	1.70%	-8.27%	1.13%	-9.98%	0.57%
过去六个月	-22.81%	1.61%	-8.65%	1.02%	-14.16%	0.59%
过去一年	-32.21%	1.48%	-17.05%	0.92%	-15.16%	0.56%

过去三年	-46.11%	1.49%	-19.65%	0.86%	-26.46%	0.63%
过去五年	-23.92%	1.65%	18.88%	1.12%	-42.80%	0.53%
自基金合同生效起至今	124.42%	1.58%	55.40%	1.25%	69.02%	0.33%

### 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

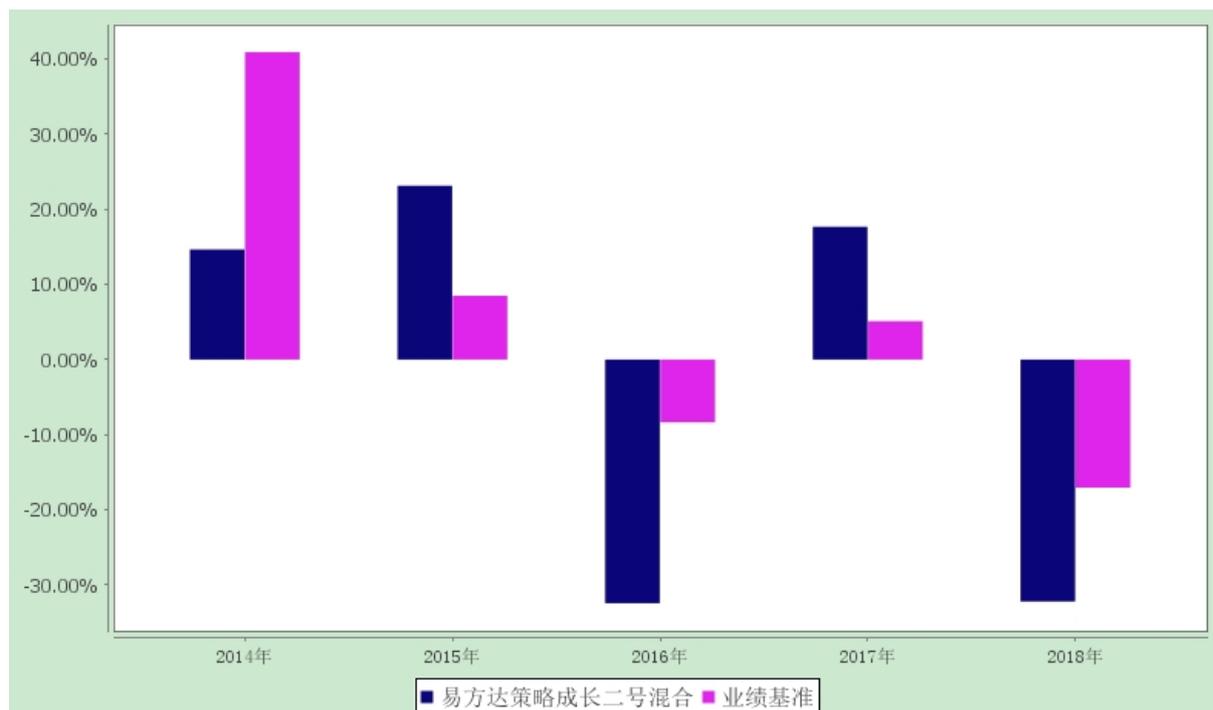
易方达策略成长二号混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2006年8月16日至2018年12月31日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 124.42%，同期业绩比较基准收益率为 55.40%。

### 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

易方达策略成长二号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
2018年	0.500	13,188,890.85	46,132,221.52	59,321,112.37	-
2017年	0.200	5,305,757.97	19,291,774.57	24,597,532.54	-
2016年	4.800	159,409,462.96	375,337,923.56	534,747,386.52	-
合计	5.500	177,904,111.78	440,761,919.65	618,666,031.43	-

## § 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、深圳等地设有分公司或子公司，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，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、基本养老保险基金投资等业务资格，是国内基金行业为数不多的“全牌照”

公司之一，在主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资等领域全面布局。截至 2018 年 12 月 31 日，易方达总资产管理规模超过 1.2 万亿元，服务近 8000 万客户，自成立以来仅公募基金累计分红达 1150 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	2017-02-17	-	8 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、易方达瑞享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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 2018 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 131 次，其中 127 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，4 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

2018 年初核算我国 GDP 同比增速为 6.6%，较 2017 年有所回落，人均 GDP 接近 1 万美元水平。回顾 2018 年，我国经济可以归纳为三条主线：经济下行压力加大、长期的经济结构调整持续以及中美贸易摩擦反复。三大矛盾交织约束经济增长速度。

资本市场方面，在盈利增速下降与估值收缩的双重叠加影响下，A 股全年经历风险释放过程。A 股总市值在 2018 年缩水超过 14 万亿元，下跌个股数占比达到 91.53%，在过往所有下跌年份中仅次于 2008 年。结构方面，上证综指全年下跌 24.59%，上证 50 指数下跌 19.83%，创业板指数下跌 28.65%，其中创业板指数连续 3 年跑输上证指数。

本基金全年保持较高仓位运行，持续配置了景气度维持高位食品饮料和医药板块，但年中对航空及水泥等周期股出现误判，对基金收益率造成一定影响。

##### 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 0.721 元，本报告期份额净值增长率为-32.21%，同期业绩比较基准收益率为-17.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年，国内经济下行压力仍然较大，来自外部的国际纷争与内部的结构调整压力目前看都将延续。经济增长三驾马车看：投资方面，土地购置额大概率成为 2019 年房地产投资的主要拖累，企业盈利能力持续走弱压抑制制造业投资，基建在高基数情况下也难有较高增长。出口方面，始终受中美贸易争端扰动。消费方面，受经济预期较悲观，及房地产带来的财富效应减弱的影响，短期难言乐观。与此同时，政府逆周期宏观调控政策持续加码，预期财政、货币、产业政策的逆周期调控在 2019 年都将更为积极。考虑到目前 A 股估值处于历史底部，股市整体走势好转可能领先于基本面好转，出现估值抢跑情况。但经济基本面见底尚需时日，目前判断市场短期难有较大级别机会。

基于以上宏观判断，市场主要机会来自逆周期调控政策对估值修复，而非短期能看到企业盈利好转。组合配置上，在维持超配食品饮料，医药生物等较高景气的行业同时，增加电子、计算机、国防军工、电气设备等估值分位较低，政策刺激受益较多的行业。由于对经济下行压力存在一定担忧，相对看空上游周期股。

#### 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、指数量化板块、投资风险管理部、监察与合规管理总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，具备投资、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债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限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《易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金合同》，本基金本报告期不满足分红条件，不进行利润分配；本报告期内 2018 年 1 月 12 日已实施的利润分配 59,321,112.37 元是对 2017 年度利润进行的分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达策略成长二号混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 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：易方达策略成长二号混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	136,407,004.22	109,586,520.19
结算备付金	4,920,985.47	7,547,006.87
存出保证金	368,319.42	618,874.42
交易性金融资产	697,015,972.56	1,221,279,649.62
其中：股票投资	695,250,502.36	1,220,794,621.23
基金投资	-	-
债券投资	1,765,470.20	485,028.39
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	13,924,210.45	3,473,665.39
应收利息	29,320.23	26,156.79
应收股利	-	-
应收申购款	85,291.48	104,670.63

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>852,751,103.83</b>	<b>1,342,636,543.91</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		
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	-	8,321,216.24
应付赎回款	184,414.15	1,762,581.49
应付管理人报酬	1,118,158.40	1,690,084.54
应付托管费	186,359.74	281,680.76
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,382,131.29	3,494,348.44
应交税费	1,803,765.91	1,803,754.10
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,050,051.04	1,152,567.85
<b>负债合计</b>	<b>6,724,880.53</b>	<b>18,506,233.42</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,173,970,741.31	1,191,303,449.35
未分配利润	-327,944,518.01	132,826,861.14
<b>所有者权益合计</b>	<b>846,026,223.30</b>	<b>1,324,130,310.49</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>852,751,103.83</b>	<b>1,342,636,543.91</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.721 元，基金份额总额 1,173,970,741.31 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达策略成长二号混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-361,491,686.69</b>	<b>256,771,332.09</b>
1.利息收入	815,288.64	1,563,284.22
其中：存款利息收入	814,049.31	917,884.69
债券利息收入	1,239.33	645,399.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-271,161,697.73	177,602,926.75
其中：股票投资收益	-280,342,994.20	168,353,682.61
基金投资收益	-	-
债券投资收益	431,409.27	26,773.34
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	8,749,887.20	9,222,470.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-91,209,160.24	77,535,689.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	63,882.64	69,432.06
<b>减：二、费用</b>	<b>41,082,294.50</b>	<b>45,543,855.34</b>
1. 管理人报酬	16,621,594.25	19,342,184.86
2. 托管费	2,770,265.74	3,223,697.51

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	21,218,372.71	22,502,519.20
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	4.51	-
7. 其他费用	472,057.29	475,453.77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-402,573,981.19</b>	<b>211,227,476.75</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-402,573,981.19</b>	<b>211,227,476.75</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达策略成长二号混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	1,191,303,449.35	132,826,861.14	1,324,130,310.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-402,573,981.19	-402,573,981.19
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）	-17,332,708.04	1,123,714.41	-16,208,993.63
其中：1.基金申购款	107,199,376.56	2,583,198.12	109,782,574.68
2.基金赎回款	-124,532,084.60	-1,459,483.71	-125,991,568.31
四、本期向基金份额持	-	-59,321,112.37	-59,321,112.37

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）	1,173,970,741.31	-327,944,518.01	846,026,223.30
项目	上年度可比期间		
	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）	1,302,172,428.84	-49,365,568.55	1,252,806,860.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	211,227,476.75	211,227,476.75
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）	-110,868,979.49	-4,437,514.52	-115,306,494.01
其中：1.基金申购款	73,779,287.45	4,140,143.54	77,919,430.99
2.基金赎回款	-184,648,266.94	-8,577,658.06	-193,225,925.00
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）	-	-24,597,532.54	-24,597,532.54
五、期末所有者权益（基金净值）	1,191,303,449.35	132,826,861.14	1,324,130,310.49

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：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

易方达策略成长二号混合型证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2006]150号文件《关于核准易方达策略成长二号混合型证券投资基金募集的批复》和《关于易方达策略成长二号混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2006]186号）的核准，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《易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金合同》向社会公开募集。经向中国证监会备案，本基金基金合同于2006年08月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,657,110,813.08份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

#### 7.4.2 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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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

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。

#### 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

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的

规定，经国务院批准，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。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方

教育费附加。

### (3) 企业所得税

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。

### (4) 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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
广发证券	2,882,868,344.89	20.61%	4,440,168,969.51	29.96%

#### 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 2018年1月1日至2018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	2,558,271.12	19.83%	585,529.24	24.58%
关联方名称	上年度可比期间 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	4,011,548.17	29.32%	288,353.13	8.25%

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。

#### 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 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	16,621,594.25
其中：支付销售机构的客户维护费	1,562,769.86	1,826,008.84

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前十个工作日内从基金资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
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,770,265.74	3,223,697.51

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前十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	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017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
中国银行-活期存款	136,407,004.22	707,335.88	109,586,520.19	817,456.27

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国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					
2018 年 1 月 1 日至 2018 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	002927	泰永长征	新股网下发行	961	14,203.58
上年度可比期间					
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	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	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	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	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	1,548	17,275.68

			发行		
广发证券	300735	光弘科技	新股网下发行	3,764	37,602.36
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	603458	勘设股份	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	新股网下发行	1,664	12,862.72
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
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

#### 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（2018 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
601860	紫金	2018-12-20	2019-01-03	新股	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

	银行			流通受限						
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	新股流通受限	13.77	10.97	105,460	1,452,184.20	1,156,896.20	-
000568	泸州老窖	2017-09-13	2019-09-16	非公开发行流通受限	48.00	37.35	208,333	9,999,984.00	7,781,237.55	-
002635	安洁科技	2017-09-11	2019-09-12	非公开发行流通受限	32.22	10.14	141,864	4,570,858.08	1,438,500.96	-

注：1) 泸州老窖股份有限公司于 2018 年 7 月 16 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 12.5 元人民币现金（含税）。

2) 苏州安洁科技股份有限公司于 2018 年 6 月 15 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 1 元人民币现金（含税）。

3) 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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 2018 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 2018 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 2018 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 686,639,337.85 元，属于第二层次的余额为 10,376,634.71 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 1,164,557,425.72 元，第二层次 56,722,223.90 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 2018 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(2017 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。

## § 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	695,250,502.36	81.53
	其中：股票	695,250,502.36	81.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,765,470.20	0.21
	其中：债券	1,765,470.20	0.21
	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	141,327,989.69	16.57
8	其他各项资产	14,407,141.58	1.69
9	合计	852,751,103.83	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	63,782,518.38	7.54
C	制造业	405,490,395.38	47.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,892,442.78	2.35
G	交通运输、仓储和邮政业	12,841,746.40	1.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,386,237.20	5.01
J	金融业	94,762,263.42	11.20
K	房地产业	36,004,058.80	4.26

L	租赁和商务服务业	8,440,040.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	11,650,800.00	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	695,250,502.36	82.18

### 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	601398	工商银行	9,519,400	50,357,626.00	5.95
2	002353	杰瑞股份	2,574,513	38,617,695.00	4.56
3	600967	内蒙一机	3,154,084	32,802,473.60	3.88
4	300164	通源石油	5,262,151	32,730,579.22	3.87
5	600007	中国国贸	2,538,121	32,487,948.80	3.84
6	002304	洋河股份	288,100	27,288,832.00	3.23
7	600339	中油工程	6,225,132	22,597,229.16	2.67
8	601328	交通银行	3,403,800	19,708,002.00	2.33
9	000568	泸州老窖	416,933	16,262,913.55	1.92
10	000001	平安银行	1,727,849	16,207,223.62	1.92

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](http://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	600967	内蒙一机	117,390,852.46	8.87
2	601318	中国平安	106,844,316.20	8.07

3	300164	通源石油	104,287,584.67	7.88
4	002142	宁波银行	101,630,475.78	7.68
5	600029	南方航空	101,305,499.09	7.65
6	601888	中国国旅	95,198,741.64	7.19
7	601398	工商银行	94,204,360.00	7.11
8	600036	招商银行	93,622,857.16	7.07
9	600585	海螺水泥	78,909,352.33	5.96
10	601336	新华保险	75,155,449.51	5.68
11	002353	杰瑞股份	74,898,688.38	5.66
12	000858	五粮液	71,251,715.98	5.38
13	603369	今世缘	71,159,318.12	5.37
14	601009	南京银行	70,400,886.93	5.32
15	300059	东方财富	67,986,110.24	5.13
16	002677	浙江美大	67,044,009.26	5.06
17	002007	华兰生物	66,407,698.43	5.02
18	000568	泸州老窖	66,270,846.10	5.00
19	000596	古井贡酒	64,864,512.46	4.90
20	002013	中航机电	63,927,784.69	4.83
21	600115	东方航空	63,909,354.05	4.83
22	600845	宝信软件	63,386,214.13	4.79
23	600760	中航沈飞	62,245,013.79	4.70
24	600426	华鲁恒升	61,487,251.81	4.64
25	600048	保利地产	54,361,365.67	4.11
26	603589	口子窖	50,683,624.12	3.83
27	600009	上海机场	50,013,989.12	3.78
28	002127	南极电商	49,708,985.59	3.75
29	000002	万科 A	48,941,845.42	3.70
30	300316	晶盛机电	48,874,985.62	3.69
31	600183	生益科技	48,578,244.84	3.67
32	601012	隆基股份	48,524,508.92	3.66
33	600030	中信证券	48,133,012.45	3.64
34	601111	中国国航	47,609,053.53	3.60
35	300122	智飞生物	47,009,368.82	3.55
36	600837	海通证券	46,956,057.36	3.55
37	600519	贵州茅台	46,856,773.90	3.54
38	600258	首旅酒店	44,244,717.92	3.34
39	002304	洋河股份	43,377,238.88	3.28
40	300383	光环新网	42,480,796.00	3.21
41	000789	万年青	40,392,922.35	3.05
42	603866	桃李面包	39,378,777.77	2.97
43	300226	上海钢联	39,267,861.49	2.97
44	600176	中国巨石	38,843,680.88	2.93
45	002508	老板电器	38,576,556.67	2.91
46	601601	中国太保	38,391,124.21	2.90

47	601288	农业银行	38,365,062.00	2.90
48	600339	中油工程	38,240,671.92	2.89
49	600007	中国国贸	37,557,876.32	2.84
50	600809	山西汾酒	37,270,314.34	2.81
51	300618	寒锐钴业	37,121,925.02	2.80
52	300253	卫宁健康	36,615,529.40	2.77
53	002468	申通快递	35,425,514.90	2.68
54	300529	健帆生物	35,385,691.70	2.67
55	000963	华东医药	35,136,023.18	2.65
56	000977	浪潮信息	34,724,681.56	2.62
57	000786	北新建材	34,233,173.27	2.59
58	300601	康泰生物	34,006,394.92	2.57
59	000001	平安银行	33,778,160.20	2.55
60	601003	柳钢股份	33,547,682.31	2.53
61	300348	长亮科技	33,434,542.48	2.53
62	000418	小天鹅 A	33,204,960.21	2.51
63	601225	陕西煤业	32,737,162.30	2.47
64	300121	阳谷华泰	32,520,357.22	2.46
65	601117	中国化学	32,501,692.36	2.45
66	600362	江西铜业	32,292,462.55	2.44
67	002415	海康威视	32,137,487.58	2.43
68	600276	恒瑞医药	32,022,893.56	2.42
69	002697	红旗连锁	31,953,497.06	2.41
70	600779	水井坊	31,123,344.70	2.35
71	600588	用友网络	30,912,199.33	2.33
72	603338	浙江鼎力	30,455,109.80	2.30
73	601628	中国人寿	30,447,976.17	2.30
74	000661	长春高新	30,127,009.38	2.28
75	600027	华电国际	30,020,360.54	2.27
76	300523	辰安科技	29,395,289.22	2.22
77	601699	潞安环能	29,220,463.70	2.21
78	002299	圣农发展	29,157,825.51	2.20
79	300377	赢时胜	28,837,975.31	2.18
80	002440	闰土股份	28,444,457.90	2.15
81	300114	中航电测	28,222,199.42	2.13
82	002475	立讯精密	28,144,567.21	2.13
83	603357	设计总院	27,988,240.98	2.11
84	601186	中国铁建	27,730,066.90	2.09
85	601233	桐昆股份	27,720,225.27	2.09
86	300347	泰格医药	27,685,609.57	2.09
87	600567	山鹰纸业	27,613,089.12	2.09
88	600050	中国联通	27,116,848.00	2.05
89	600570	恒生电子	26,848,593.99	2.03
90	603885	吉祥航空	26,782,025.58	2.02

91	600060	海信电器	26,748,486.72	2.02
92	000717	韶钢松山	26,491,390.40	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	600036	招商银行	115,420,865.81	8.72
2	002142	宁波银行	111,076,461.35	8.39
3	600519	贵州茅台	101,728,985.43	7.68
4	601888	中国国旅	100,849,078.25	7.62
5	601318	中国平安	95,814,158.16	7.24
6	600967	内蒙一机	92,345,707.50	6.97
7	600585	海螺水泥	89,613,895.30	6.77
8	600029	南方航空	88,910,758.68	6.71
9	000002	万科 A	84,868,466.25	6.41
10	601336	新华保险	80,419,156.96	6.07
11	600809	山西汾酒	79,717,331.63	6.02
12	300164	通源石油	79,588,830.54	6.01
13	600009	上海机场	72,704,185.50	5.49
14	000568	泸州老窖	71,729,299.68	5.42
15	601699	潞安环能	68,793,858.99	5.20
16	601009	南京银行	66,873,943.64	5.05
17	600258	首旅酒店	65,315,814.64	4.93
18	600760	中航沈飞	64,060,155.82	4.84
19	300059	东方财富	62,415,451.08	4.71
20	603369	今世缘	60,748,660.35	4.59
21	603799	华友钴业	60,233,246.73	4.55
22	002677	浙江美大	59,299,157.12	4.48
23	002013	中航机电	58,281,248.29	4.40
24	600426	华鲁恒升	57,327,193.59	4.33
25	600115	东方航空	56,902,680.96	4.30
26	600183	生益科技	55,610,817.23	4.20
27	601012	隆基股份	54,907,061.52	4.15
28	002007	华兰生物	54,830,925.64	4.14
29	000858	五粮液	54,437,889.27	4.11
30	601628	中国人寿	54,282,767.32	4.10
31	600030	中信证券	53,852,855.82	4.07
32	600845	宝信软件	53,617,985.64	4.05
33	002127	南极电商	52,991,372.51	4.00

34	600188	兖州煤业	51,775,605.85	3.91
35	601601	中国太保	50,892,631.19	3.84
36	300226	上海钢联	49,792,925.41	3.76
37	300122	智飞生物	48,216,300.25	3.64
38	600048	保利地产	47,484,437.06	3.59
39	601003	柳钢股份	47,015,651.33	3.55
40	300316	晶盛机电	46,853,666.53	3.54
41	000786	北新建材	43,016,735.99	3.25
42	601111	中国国航	42,298,518.76	3.19
43	000651	格力电器	41,068,872.70	3.10
44	601398	工商银行	40,503,102.10	3.06
45	600837	海通证券	40,473,111.41	3.06
46	000789	万年青	39,803,874.90	3.01
47	600606	绿地控股	39,602,903.65	2.99
48	002384	东山精密	38,186,260.61	2.88
49	600703	三安光电	38,071,312.79	2.88
50	300383	光环新网	37,862,100.52	2.86
51	000717	韶钢松山	37,795,927.99	2.85
52	002153	石基信息	37,417,417.06	2.83
53	601288	农业银行	36,650,448.37	2.77
54	000596	古井贡酒	36,534,121.90	2.76
55	000977	浪潮信息	36,083,752.49	2.73
56	600136	当代明诚	35,735,725.86	2.70
57	603589	口子窖	35,416,897.90	2.67
58	601233	桐昆股份	35,283,748.07	2.66
59	600309	万华化学	34,147,953.83	2.58
60	600050	中国联通	34,127,243.23	2.58
61	600176	中国巨石	34,095,520.36	2.57
62	600690	青岛海尔	34,056,741.28	2.57
63	300618	寒锐钴业	34,048,060.08	2.57
64	300253	卫宁健康	34,028,860.76	2.57
65	600028	中国石化	33,560,708.00	2.53
66	300348	长亮科技	32,469,636.69	2.45
67	000528	柳工	31,793,444.88	2.40
68	600027	华电国际	31,741,247.38	2.40
69	002468	申通快递	31,293,962.30	2.36
70	601225	陕西煤业	31,184,625.29	2.36
71	002415	海康威视	31,150,793.60	2.35
72	600436	片仔癀	31,144,618.85	2.35
73	600570	恒生电子	31,020,724.74	2.34
74	000963	华东医药	30,906,457.82	2.33
75	002353	杰瑞股份	30,421,102.12	2.30
76	601117	中国化学	30,217,766.63	2.28
77	000661	长春高新	30,186,254.46	2.28

78	300377	赢时胜	30,122,748.22	2.27
79	600125	铁龙物流	29,656,345.18	2.24
80	300529	健帆生物	29,417,254.64	2.22
81	002299	圣农发展	29,269,442.28	2.21
82	000418	小天鹅 A	29,039,208.81	2.19
83	601186	中国铁建	28,919,574.45	2.18
84	603338	浙江鼎力	28,635,008.39	2.16
85	002475	立讯精密	27,926,471.55	2.11
86	600362	江西铜业	27,753,966.09	2.10
87	300601	康泰生物	27,040,770.02	2.04
88	600567	山鹰纸业	26,856,568.00	2.03
89	600779	水井坊	26,681,398.90	2.02

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

#### 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	6,920,967,424.87
卖出股票收入（成交）总额	7,074,956,624.27

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）	1,765,470.20	0.21
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,765,470.20	0.21

#### 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	113020	桐昆转债	17,660	1,765,470.20	0.21

#### 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 交通银行（代码：601328）为易方达策略成长二号混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。2018年7月26日，中国人民银行针对交通银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户，罚款人民币130万元。2018年11月9日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司关于以下违规事实：（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力，处以罚款690万元人民币。2018年11月9日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位的违规事实，处以罚款50万元人民币。

平安银行（代码：000001）为易方达策略成长二号混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。

2018年2月7日，大连银监局针对平安银行贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现，贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票的违法事实，对平安银行处以人民币四十万元行政处罚。2018年3月14日，中国人民银行针对平安银行违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定，给予警告，没收违法所得3,036,061.39元，并处罚款10,308,084.15元，合计处罚金额13,344,145.54元。2018年6月28日，天津银监局针对平安银行贷款前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；贷后管理失职，流动资金贷款被挪用，罚款人民币50万元。2018年7月26日，中国人民银行针对平安银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，罚款人民币140万元。

本基金投资交通银行、平安银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除交通银行、平安银行外，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	368,319.42
2	应收证券清算款	13,924,210.45
3	应收股利	-
4	应收利息	29,320.23
5	应收申购款	85,291.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,407,141.58

### 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	000568	泸州老窖	7,781,237.55	0.92	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

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
47,997	24,459.25	2,830,791.04	0.24%	1,171,139,950.27	99.76%

### 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	1,686,647.06	0.1437%

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年8月16日)基金份额	3,657,110,813.08
-------------------------	------------------

总额	
本报告期期初基金份额总额	1,191,303,449.35
本报告期基金总申购份额	107,199,376.56
减：本报告期基金总赎回份额	124,532,084.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,173,970,741.31

## § 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 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 8 日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官（副总经理级），聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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 13 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 100,000.00 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率	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	1,744,494,782.96	12.47%	1,624,651.14	12.59%	-
国泰君安	1	449,280,447.24	3.21%	418,416.52	3.24%	-
中金公司	1	918,461,475.27	6.57%	855,364.72	6.63%	-
中信证券	2	1,902,995,959.14	13.60%	1,772,263.85	13.74%	-
中信建投	1	1,114,307,625.42	7.97%	1,037,753.53	8.04%	-
高华证券	1	342,290,377.96	2.45%	318,775.72	2.47%	-
申万宏源	1	517,787,299.43	3.70%	482,217.49	3.74%	-
兴业证券	1	219,614,995.28	1.57%	204,526.14	1.59%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	948,322,896.79	6.78%	883,171.04	6.85%	-
银河证券	1	458,286,238.49	3.28%	426,802.66	3.31%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	2,882,868,344.89	20.61%	2,558,271.12	19.83%	-
广州证券	1	2,491,087,568.64	17.81%	2,319,943.98	17.98%	-

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	489,637.63	13.42%	-	-	-	-
国泰君安	313.50	0.01%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	3,159,367.90	86.57%	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一九年三月二十八日