

## 易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第二季度报告

基金管理人：易方达基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一八年七月十九日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及监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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 易方达量化策略精选混合

基金主代码 002216

基金运作方式 货币市场型

基金合同生效日 2017年12月19日

报告期末基金份额总额 169,864,100.00份

基金类型 本基金采用量化分析进行投资管理，追求货币资产长期稳健增值。

基金经理 王海峰

基金投资目标 本基金主要通过量化模型对宏观经济、信用环境、利率水平、股票市场、债券市场等进行分析，运用量化模型结合不低于量化资产比例，多层次、多角度地进行投资，精选多种量化因子进行投资，从而在控制风险的前提下，追求资产的长期稳健增值。

投资策略 本基金的投资策略包括但不限于：一是构造多种量化策略，形成组合，实现收益；二是通过量化模型对宏观经济、利率水平、股票市场、债券市场等进行分析，运用量化模型结合不低于量化资产比例，多层次、多角度地进行投资，精选多种量化因子进行投资，从而在控制风险的前提下，追求资产的长期稳健增值。

风险收益特征 本基金为货币型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、商品基金和债券型基金，高于货币型基金和现金类理财产品。

基金管理人 易方达基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 易方达量化策略精选混合A

下属分级基金的交易代码 002216

报告期末下属分级基金的份额总额 137,302,063.00份

单位：人民币元

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图（2017年12月19日至2018年6月30日）

易方达量化策略精选混合A

易方达量化策略精选混合C

注：本基金合同于2017年12月19日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十二部分、投资范围、三、投资策略和四、投资限制）的相关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为-11.20%，C类基金份额净值增长率为-11.50%，同期业绩比较基准收益率为-6.11%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名 职务 任本基金的基金经理时间 说明

王海峰 研究员、研究助理、研究员、基金经理 2017-1 - 8年 师从易方达研究部研究员，历任易方达基金研究部研究员、摩根士丹利华鑫基金研究员、易方达基金研究员、易方达基金量化投资部研究员、易方达基金量化投资部基金经理，现任易方达基金量化投资部基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内，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，以诚信服务于公众，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 公平交易专项说明

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范交易环节的不公平交易，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共27次，其中26次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，1次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按相关规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《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，以诚信服务于公众，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。

4.5 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范交易环节的不公平交易，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.6 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0.9885元，本报告期份额净值增长率为-6.92%；C类基金份额净值为0.9885元，本报告期份额净值增长率为-7.14%；同期业绩比较基准收益率为-6.43%，各项指标均在合同规定的目标控制范围内。

5. 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 156,856,356.45 80.01

2 固定收益投资 159,658,356.45 80.01

3 贵金属及特殊资产 - 0.00

4 银行存款和结算备付金合计 122,324,338.25 29,377,023.60

5 其他资产 0.00 0.00

6 合计 337,802,050.00 100.00

注：本基金主要通过量化分析进行投资管理，追求货币资产长期稳健增值。

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 280,440.00 0.19

2 制造业 2,194,033.00 1.46

3 制造业 84,391,468.74 56.00

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 3,104,096.95 2.06

5 建筑业 1,036,226.00 0.69

6 批发零售业 3,406,560.00 2.26

7 交通运输、仓储和邮政业 1,296,224.00 0.85

8 住宿和餐饮业 - -

9 信息传输、软件和信息技术服务业 11,114,530.93 7.28

10 金融业 11,170,500.00 7.41

11 房地产业 4,374,504.70 3.23

12 租赁和商务服务业 6,010,316.70 3.99

13 其他行业 - -

14 公用事业 - -

15 交通运输、仓储和邮政业 - -

16 住宿和餐饮业 - -

17 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

18 金融业 - -

19 房地产业 - -

20 公用事业 - -

21 租赁和商务服务业 - -

22 交通运输、仓储和邮政业 - -

23 住宿和餐饮业 - -

24 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

25 金融业 - -

26 房地产业 - -

27 公用事业 - -

28 租赁和商务服务业 - -

29 交通运输、仓储和邮政业 - -

30 住宿和餐饮业 - -

31 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

32 金融业 - -

33 房地产业 - -

34 公用事业 - -

35 租赁和商务服务业 - -

36 交通运输、仓储和邮政业 - -

37 住宿和餐饮业 - -

38 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

39 金融业 - -

40 房地产业 - -

41 公用事业 - -

42 租赁和商务服务业 - -

43 交通运输、仓储和邮政业 - -

44 住宿和餐饮业 - -

45 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

46 金融业 - -

47 房地产业 - -

48 公用事业 - -

49 租赁和商务服务业 - -

50 交通运输、仓储和邮政业 - -

51 住宿和餐饮业 - -

52 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

53 金融业 - -

54 房地产业 - -

55 公用事业 - -

56 租赁和商务服务业 - -

57 交通运输、仓储和邮政业 - -

58 住宿和餐饮业 - -

59 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

60 金融业 - -

61 房地产业 - -

62 公用事业 - -

63 租赁和商务服务业 - -

64 交通运输、仓储和邮政业 - -

65 住宿和餐饮业 - -

66 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

67 金融业 - -

68 房地产业 - -

69 公用事业 - -

70 租赁和商务服务业 - -

71 交通运输、仓储和邮政业 - -

72 住宿和餐饮业 - -

73 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

74 金融业 - -

75 房地产业 - -

76 公用事业 - -

77 租赁和商务服务业 - -

78 交通运输、仓储和邮政业 - -

79 住宿和餐饮业 - -

80 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

81 金融业 - -

82 房地产业 - -

<div data-bbox="204 1130 39