易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:二〇一八年八月二十八日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	易方达瑞财混合	
基金主代码	001802	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年2月4日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,085,200,938.05份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞财混合I	易方达瑞财混合E
下属分级基金的交易代码	001802	001803
报告期末下属分级基金的份额总额	1,084,447,941.40份	752,996.65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	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场因素、估值及流动性因素、政策因素等分析,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。债券投资方面,本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次,本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。在券种选择上,本基金以长期利率趋势分析为基础,结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,实施积极主动的债券投资管理。股票投资策略方面,本基金通过对行业景气度、竞争格局等因素的分析,对各行业的投资价值进行综合评估,从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置比例确定的基础上,对公司基本面和估值情况进行综合考虑,优选个股进行股票组合的构建,并根据市场和基本面的变化动态调整。
业绩比较基准	中债新综合指数(财富)收益率×75%+沪深300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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	张燕
	联系电话	020-85102688	0755-83199084
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95555
传真		020-85104666	0755-83195201

2.4 信息披露方式

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)	
	易方达瑞财混合I	易方达瑞财混合E
本期已实现收益	23,889,786.11	15,752.29
本期利润	25,519,152.23	16,898.29
加权平均基金份额本期利润	0.0235	0.0224
本期基金份额净值增长率	2.32%	2.14%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	易方达瑞财混合I	易方达瑞财混合E
期末可供分配基金份额利润	0.0577	0.0524
期末基金资产净值	1,147,064,279.99	792,455.79
期末基金份额净值	1.058	1.052

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

易方达瑞财混合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
过去一个月	-0.38%	0.11%	-1.45%	0.31%	1.07%	-0.20%
过去三个月	0.86%	0.12%	-1.02%	0.29%	1.88%	-0.17%
过去六个月	2.32%	0.10%	-0.32%	0.29%	2.64%	-0.19%
过去一年	5.34%	0.09%	2.12%	0.24%	3.22%	-0.15%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	11.03%	0.12%	9.20%	0.24%	1.83%	-0.12%

易方达瑞财混合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
过去一个月	-0.38%	0.09%	-1.45%	0.31%	1.07%	-0.22%
过去三个月	0.67%	0.11%	-1.02%	0.29%	1.69%	-0.18%
过去六个月	2.14%	0.09%	-0.32%	0.29%	2.46%	-0.20%
过去一年	5.06%	0.09%	2.12%	0.24%	2.94%	-0.15%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.42%	0.12%	9.20%	0.24%	1.22%	-0.12%

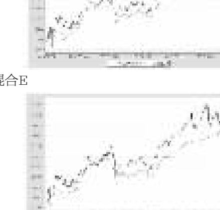
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金

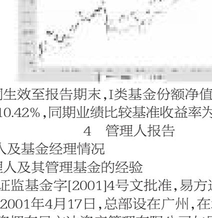
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年2月4日至2018年6月30日)

易方达瑞财混合I



易方达瑞财混合E



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11.03%,E类基金份额净值增长率为10.42%,同期业绩比较基准收益率为9.20%。

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、成都、大连等地设有分公司,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、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,投资业务包括主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、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2018年6月30日,易方达旗下管理的各类资产规模总计1.3万亿元,服务各类客户总数7580万户,公募基金累计分红超过1000亿元。

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		
胡剑	本基金的基金经理、易方达裕景添利6个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理(自2016年04月12日至2018年02月09日)、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达丰惠混合型证券投资基金的基金经理、固定收益研究部总经理	2016-02-04	-	12年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)基金经理、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理。

注:1.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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程,以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等,并重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,通过投资交易系统中的公平交易模块,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共66次,其中64次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易;2次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年经济数据整体平稳,但结构上差异较大。工业增加值、GDP增速、零售和进出口、通胀数据均表现较为平稳。微观层面企业盈利数据、大宗商品价格和产量都还维持在较好的水平。投资数据分化,房地产销售和投资超出市场预期,对经济基本面形成较好的支撑;基建投资出现持续性的大幅的下滑,对固定资产投资造成明显的拖累,但是对经济整体的负面影响有限;制造业投资则在二季度开始略有向上,6月份增长更加显著,显示经济的内生增长动力正在逐步改善。社会融资数据延续了2017年下半年的收缩趋势,非标下行速度进一步加快,这使得市场对经济整体的预期趋于悲观。叠加中美贸易摩擦不断升级,市场悲观预期在二季度逐渐升温。

债券市场方面,受益于央行货币政策的边际宽松,债券市场收益率整体呈现陡峭化下行。截至6月底,1年金融债下行63BP,10年金融债下行41BP。信用债走势分化更加明显,高等级品种下行70-80BP,但是城投等中低等级品种反而上行30BP左右,显示级别利差扩张较为明显,尤其是5-6月份,城投、民企和房地产行业的信用风险溢价大幅上升。

权益市场整体有所下跌,一季度相对缓和,5月下旬以后贸易摩擦升级带动股市下跌幅度增加,沪深300指数、上证50指数、创业板指数分别下跌12.9%、13.3%和8.33%。可转债市场跟随股票市场下跌,中证转债指数下跌2.17%,估值水平下降至历史偏低位置。

操作上,组合在2月底之后逐步增加久期,仓位也有所提升,3月下旬贸易摩擦加剧后进一步提升久期至2.5年左右,在4月初保持了偏长的有效久期,于4月中下旬减持,并在6月中旬重新拉长久期。整体利率债波段操作节奏把握较好,在收益率下行的过程中获得了较好的资本利得收益。权益方面,组合在前期保持了偏低的仓位,在市场大幅下跌时组合净值表现平稳,5月份之后跟随市场下跌逐步提高权益和转债仓位,获得较好的业绩表现。

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1.058元,本报告期份额净值增长率为2.32%;E类基金份额净值为1.052元,本报告期份额净值增长率为2.14%;同期业绩比较基准收益率为-0.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来经济基本面表现出较强的韧性。第一方面,基建投资在上半年出现显著的断崖式的下滑,但是投资下滑对增长数据的负面影响非常有限。第二方面,我们看到房地产销售和投资也表现出非常强的韧性,这对经济整体形成较为有力的支撑。第三方面,微观企业的盈利情况持续较好,在经历供给侧改革之后,企业的产能利用率和资产负债水平都有较为明显的改善,经济自身增长动能在增强。最大的风险点在于今年资管新规带来"非标转标"过程中信用的持续收缩,以及4月份以来中美贸易摩擦升级给经济前景带来不确定性。不过随着近期监管政策态度的变化,货币政策趋于宽松,融资数据有望出现回升。上述风险有望在较大程度上得到缓解。

对应到债券市场,我们认为宽松的货币政策有望延续,但是可能同时伴随宽信用的货币政策。中短端债券品种收益率有望维持或进一步下行,但是宽信用政策可能对中长期限的利率债带来一定的不确定性,收益率曲线有望陡峭化。在宽信用政策的趋势下,信用风险溢价有望大幅改善,城投、房地产及民企个券存在较好的利差压缩机会。

针对中长期限的品种,我们需要观察宽信用政策的实际力度和效用。一个观察点在于政策层面是否对城投平台的融资有实质性的放松,这一点决定了宽信用政策能否产生实质效果。我们认为如果看到基建投资和城投平台融资的再度回升,叠加经济本身的动能回升,中长期限的利率债需要谨慎。如果我们观察地方政府债务控制依然较为严格,则本轮信用扩张力度会相对有限,货币政策的宽松将主导债券市场走牛,且持续性会相对更长。

实际操作中,本组合计划将组合久期调整至中性水平,结构上更多配置中短端债券,适当提高信用债券占比,获取宽货币带来的收益,久期上等待平台融资政策变化的进一步信号。权益资产方面,可转债品种投资性价比凸显,组合后续将继续保持可转债的仓位,在不承担过多波动风险的情况下,保持组合一定的弹性。

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

易方达瑞财混合I:本报告期内未实施利润分配。

易方达瑞财混合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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	47,617,862.07	581,482.78
结算备付金	5,702,760.77	1,106,167.75
存出保证金	19,526.18	37,715.88
交易性金融资产	1,548,903,588.27	1,091,329,282.87
其中:股票投资	83,604,780.44	21,770,618.87
基金投资	-	-
债券投资	1,465,298,807.83	1,069,558,664.00
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	-	9,990,134.99
应收证券清算款	649,601.42	-
应收利息	28,866,867.67	24,537,236.79
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,631,760,206.38	1,127,582,021.06
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	451,684,807.27	4,000,000.00
应付证券清算款	30,577,671.12	9,722.94
应付赎回款	11.01	-
应付管理人报酬	566,217.05	571,451.42
应付托管费	141,554.24	142,862.88
应付销售服务费	130.37	133.08
应付交易费用	78,893.77	131,120.72
应交税费	139,835.26	-
应付利息	315,994.42	-2,430.72
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	398,356.09	400,000.00
负债合计	483,903,470.60	5,252,860.32
所有者权益:		
实收基金	1,085,200,938.05	1,085,209,128.35
未分配利润	62,655,797.73	37,120,032.39
所有者权益合计	1,147,856,735.78	1,122,329,160.74
负债和所有者权益总计	1,631,760,206.38	1,127,582,021.06

注:报告截止日2018年6月30日,I类基金份额净值1.058元,E类基金份额净值1.052元;基金份额总额1,085,200,938.05份,下属分级基金的份额总额分别为:I类基金份额总额1,084,447,941.40份,E类基金份额总额752,996.65份。

6.2 利润表

会计主体:易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	34,637,541.37	31,393,904.85
1.利息收入	35,914,212.53	31,533,728.75
其中:存款利息收入	26,184.22	25,522.80
债券利息收入	35,827,618.80	30,526,373.37
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	60,409.51	981,832.58
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-2,907,183.28	-17,242,527.91
其中:股票投资收益	3,205,255.76	276,738.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-6,475,336.41	-18,312,682.76
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	362,897.37	793,416.59
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,630,512.12	17,102,692.08
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	11.93
减:二、费用	9,101,490.85	7,346,587.06
1. 管理人报酬	3,390,035.79	3,349,940.90
2. 托管费	847,508.93	837,485.26
3. 销售服务费	781.74	776.89
4. 交易费用	100,216.38	140,262.63
5. 利息支出	4,422,081.09	2,790,169.70
其中:卖出回购金融资产支出	4,422,081.09	2,790,169.70
6. 税金及附加	113,774.81	-
7. 其他费用	227,092.11	227,951.68
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	25,536,050.52	24,047,317.79
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	25,536,050.52	24,047,317.79

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,085,209,128.35	37,120,032.39	1,122,329,160.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,536,050.52	25,536,050.52
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)	-8,190.30	-285.18	-8,475.48
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-8,190.30	-285.18	-8,475.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,085,200,938.05	62,655,797.73	1,147,856,735.78
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,085,383,364.35	34,979,887.53	1,120,363,251.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,047,317.79	24,047,317.79
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)	-172,735.05	-6,106.18	-178,841.23
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-172,735.05	-6,106.18	-178,841.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,085,210,629.30	59,021,099.14	1,144,231,728.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:刘晓艳 ,主管会计工作负责人:陈荣,会计机构负责人:邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达瑞财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]1895号《关于准予易方达瑞财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《易方达瑞财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,《易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年2月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为401,758,575.59份基金份额,其中认购资金利息折合8,005.85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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

(1)印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")	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

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	85,751,360.27	100.00%	-	-

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	68,601.16	100.00%	51,066.12	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

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

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

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,390,035.79	3,349,940.90
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.60%÷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,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	847,508.93	837,485.26

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×0.15%÷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,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞财混合I	易方达瑞财混合E	合计
易方达基金管理有限公司	-	781.74	781.74
招商银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	781.74	781.74
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞财混合I	易方达瑞财混合E	合计
易方达基金管理有限公司	-	776.89	776.89
招商银行	-	-	-
广发证券	-	-	-
合计	-	776.89	776.89

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×0.20%÷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

销售服务费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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

易方达瑞财混合I

无。

易方达瑞财混合E

无。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	47,617,862.07	14,133.62	880,706.86	15,882.86

注:本基金的上述银行存款由基金托管人招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。6.4.8.6 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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 基金在承销期内买入 数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 基金在承销期内买入 数量(单位:股/张)	总金额
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

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1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
603693	江苏新能	2018-06-26	2018-07-03	新股流通受限	9.00	9.00	1,000	9,000.00	9,000.00	-

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额368,484,807.27元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
170207	17国开07	2018-07-02	100.00	400,000	40,000,000.00
170215	17国开15	2018-07-02	99.42	231,000	22,966,020.00
170410	17农发10	2018-07-02	100.03	100,000	10,003,000.00
180203	18国开03	2018-07-02	101.51	300,000	30,453,000.00
101453008	14鲁能源MTN001	2018-07-03	101.30	126,000	12,763,800.00
101458025	14陕延油MTN003	2018-07-03	101.83	400,000	40,732,000.00
170209	17国开09	2018-07-03	100.21	1,280,000	128,268,800.00
180205	18国开05	2018-07-04	104.87	930,000	97,529,100.00
合计				3,767,000	382,715,720.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额83,200,000.00元,于2018年7月2日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为127,099,290.47元,属于第二层次的余额为1,421,804,297.80元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次19,331,514.85元,第二层次1,071,997,768.02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6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	83,604,780.44	5.12
	其中:股票	83,604,780.44	5.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,465,298,807.83	89.80
	其中:债券	1,465,298,807.83	89.80
	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	53,320,622.84	3.27
8	其他各项资产	29,535,995.27	1.81
9	合计	1,631,760,206.38	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,397,380.60	4.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,000.00	0.00
E	建筑业	6,909,018.00	0.60
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	27,289,381.84	2.38
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	-	-
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	83,604,780.44	7.28

7.3 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	601318	中国平安	210,798	12,348,546.84	1.08
2	002475	立讯精密	490,100	11,046,854.00	0.96
3	000703	恒逸石化	700,560	10,424,332.80	0.91
4	601398	工商银行	1,820,000	9,682,400.00	0.84
5	600332	白云山	191,458	7,284,976.90	0.63
6	601117	中国化学	1,026,600	6,909,018.00	0.60
7	600585	海螺水泥	180,100	6,029,748.00	0.53
8	002008	大族激光	113,100	6,015,789.00	0.52
9	002236	大华股份	264,600	5,966,730.00	0.52
10	601601	中国太保	165,100	5,258,435.00	0.46

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网站的半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000703	恒逸石化	11,489,585.55	1.02
2	002475	立讯精密	10,997,116.00	0.98
3	601398	工商银行	10,977,961.01	0.98
4	601318	中国平安	8,890,323.00	0.79
5	601117	中国化学	7,494,272.06	0.67
6	002236	大华股份	5,998,482.00	0.53
7	601601	中国太保	5,998,182.00	0.53
8	600585	海螺水泥	5,997,497.00	0.53
9	002008	大族激光	5,978,962.79	0.53
10	601012	隆基股份	1,803,129.78	0.16
11	603806	福斯特	604,506.37	0.05
12	601138	工业富联	27,540.00	0.00
13	300750	宁德时代	12,570.00	0.00
14	603693	江苏新能	9,000.00	0.00

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	6,434,471.69	0.57
2	600332	白云山	3,002,061.97	0.27
3	601138	工业富联	49,780.00	0.00
4	300750	宁德时代	35,029.05	0.00

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	76,279,127.56
卖出股票收入(成交)总额	9,521,342.71

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	365,852,000.00	31.87
	其中:政策性金融债	365,852,000.00	31.87
4	企业债券	482,330,450.50	42.02
5	企业短期融资券	160,704,000.00	14.00
6	中期票据	368,812,000.00	32.13
7	可转债(可交换债)	68,074,357.33	5.93
8	同业存单	-	-
9	其他	19,526,000.00	1.70
10	合计	1,465,298,807.83	127.66

7.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	170209	17国开09	1,300,000	130,273,000.00	11.35
2	180205	18国开05	1,000,000	104,870,000.00	9.14
3	101753006	17金茂控股MTN001	1,000,000	99,750,000.00	8.69
4	112678	18蛇口01	700,000	70,364,000.00	6.13
5	101759015	17远洋集团MTN001A	500,000	49,965,000.00	4.35

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,526.18
2	应收证券清算款	649,601.42
3	应收股利	-
4	应收利息	28,866,867.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,535,995.27

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	5,681,865.20	0.49
2	113015	隆基转债	4,221,084.80	0.37
3	128024	宁行转债	4,055,729.70	0.35
4	123003	蓝思转债	2,861,946.50	0.25
5	110042	航电转债	2,789,629.50	0.24
6	128016	雨虹转债	1,489,817.00	0.13
7	120001	16以岭EB	1,042,762.00	0.09
8	113013	国君转债	458,934.30	0.04
9	110040	生益转债	390,275.20	0.03
10	127004	模塑转债	221,569.50	0.02
11	128020	水晶转债	918.50	0.00
12	128023	亚太转债	870.50	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
易方达瑞财混合I	53	20,461,281.91	1,084,244,303.99	99.98%	203,637.41	0.02%
易方达瑞财混合E	158	4,765.80	0.00	0.00%	752,996.65	100.00%
合计	211	5,143,132.41	1,084,244,303.99	99.91%	956,634.06	0.09%

8.2 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	易方达瑞财混合I	978.53	0.0001%
	易方达瑞财混合E	2,373.02	0.3151%
	合计	3,351.55	0.0003%

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	易方达瑞财混合I	0
	易方达瑞财混合E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达瑞财混合I	0
	易方达瑞财混合E	0
	合计	0

9开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达瑞财混合I	易方达瑞财混合E
基金合同生效日(2016年2月4日)基金份额总额	400,754,322.69	1,004,252.90
本报告期期初基金份额总额	1,084,447,972.77	761,155.58
本报告期基金总申购份额	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	31.37	8,158.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,084,447,941.40	752,996.65

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于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)。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
新时代证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	85,751,360.27	100.00%	68,601.16	100.00%	-

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服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
新时代证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	31,353,800.00	36.07%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	55,572,044.26	63.93%	3,140,600,000.00	100.00%	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年01月01日-2018年06月30日	1,084,244,303.99	-	-	1,084,244,303.99	99.91%
产品特有风险							
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。							

易方达基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日