易方达科瑞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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	易方达科瑞混合
基金主代码	003293
交易代码	003293
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月3日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	881,124,703.13份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券等资产类别的配置比例。股票投资方面,本基金将根据对各行业的综合分析,确定并调整行业配置比例。在个股选择方面,本基金将精选具有持续竞争优势且估值具有吸引力的公司进行投资。在债券投资方面,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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债新综合财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票基金,高于债券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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	陆志俊
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-85104666	021-62701216

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)
本期已实现收益	70,669,776.65
本期利润	-33,297,610.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0369
本期基金份额净值增长率	-3.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0392
期末基金资产净值	846,600,717.00
期末基金份额净值	0.9608

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人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
过去一个月	-5.31%	1.18%	-6.01%	1.02%	0.70%	0.16%
过去三个月	-3.43%	1.06%	-7.56%	0.91%	4.13%	0.15%
过去六个月	-3.90%	1.07%	-9.54%	0.92%	5.64%	0.15%
过去一年	9.69%	0.89%	-2.55%	0.76%	12.24%	0.13%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.51%	0.81%	5.68%	0.68%	6.83%	0.13%

3.2.2 自基金转型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

易方达科瑞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
(2017年1月3日至2018年6月30日)

注:1.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(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

2.自基金转型至报告期末,基金份额净值增长率为12.51%,同期业绩比较基准收益率为5.68%。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨嘉文	本基金的基金经理	2017-12-27	-	7年	硕士研究生,曾任大成基金管理有限公司研究部研究员,易方达基金管理有限公司行业研究员、易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

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A股市场整体单边向下,且波动率加大。2018年上半年沪深300指数下跌12.90%,上证综指下跌13.90%,上证50指数下跌13.30%,中小板综合指数下跌16.30%,创业板指数相对其他指数来说跌幅较小,下跌8.33%。

分析原因:

(1)宏观经济层面看:全球经济均处于复苏之中,美国经济继续强劲,上半年加息两次,欧元区一季度表现稍差但已经渐渐恢复。主要央行陆续缩减政策宽松程度并转向紧缩。上半年发达国家股市表现良好,但新兴市场上半年受到一定冲击。

(2)国内流动性层面看:上半年美元上涨、人民币贬值,不过资金外流基本稳定。货币政策维持稳健中性,社融增速回落较多。资管新规、理财新规等监管文件陆续出台,反映金融去杠杆整体基调不变,但执行层面略有调整松动。此外,叠加中美贸易摩擦等因素,整体市场的风险偏好下降。

(3)实体经济运行层面看:宏观经济运行稳健,工业生产持续保持较高景气度,房地产库存去化理想,基建增速回落较快,企业盈利情况仍然处于较高水平。

本基金在2018年上半年股票仓位稳定在80%左右。年初对经济预期比较乐观,主要配置了银行、保险、食品饮料等板块。随着资管新规的逐步落地以及中美贸易摩擦的进一步加剧,本基金逐步减持银行、保险、电子板块,加大配置与国内需求更密切相关的板块,比如食品饮料、餐饮旅游、商贸零售以及部分电力设备。同时,从估值角度看,成长板块的吸引力增加,因此也加大了计算机板块的配置。

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0.9608元,本报告期份额净值增长率为-3.90%,同期业绩比较基准收益率为-9.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年下半年,经济数据有一定下行压力,而中美贸易摩擦短期难以消除,而且会从之前的预期层面传导到直接影响出口数据,但整体市场的估值水平已经到了历史上相对较低的位置,从长周期来看,现在是较好的配置时点。

基于以上判断,本基金在2018年下半年将提高股票资产的配置仓位,延续二季度的思路增加业绩稳定和估值有吸引力板块(比如白酒、金融、医药)的配置比例,增加以计算机板块为代表的成长股配置。整体配置思路立足中长期盈利成长性和稳定性的原则构建,维持以竞争优势明显、估值合理的稳定成长公司为核心持仓结构,同时保持组合的流动性和稳定性,并适当增加成长类个股的配置比例。

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

本基金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

报告期内,基金托管人在易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

报告期内,易方达基金管理有限公司在易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

报告期内,由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

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:易方达科瑞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	164,421,911.01	75,627,561.28
结算备付金	3,930,253.95	1,712,146.84
存出保证金	381,804.20	188,567.96
交易性金融资产	683,148,532.53	786,827,249.79
其中:股票投资	683,148,532.53	784,723,284.99
基金投资	-	-
债券投资	-	2,103,964.80
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	-	100,050,350.08
应收证券清算款	5,869,958.83	10,342,893.41
应收利息	32,292.19	281,766.13
应收股利	-	-
应收申购款	218,885.56	166,500.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	858,003,638.27	975,197,035.58
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	-	-
应付证券清算款	5,912,620.21	-
应付赎回款	353,966.41	25,457,987.27
应付管理人报酬	1,078,959.97	1,222,213.09
应付托管费	179,826.66	203,702.17
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,920,789.08	1,228,112.65
应交税费	1,307,938.87	1,307,938.86
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	648,820.07	735,902.37
负债合计	11,402,921.27	30,155,856.41
所有者权益:		
实收基金	881,124,703.13	945,188,031.29
未分配利润	-34,523,986.13	-146,852.12
所有者权益合计	846,600,717.00	945,041,179.17
负债和所有者权益总计	858,003,638.27	975,197,035.58

注:1. 本基金由原科瑞证券投资基金于2017年1月3日转型而来,2017年度实际报告期间为2017年1月3日至2017年12月31日。

2. 报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9608元,基金份额总额881,124,703.13份。

6.2 利润表

会计主体:易方达科瑞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3日(基金合同生效日)至2017年6月30日
一、收入	-18,877,553.56	54,665,940.91
1.利息收入	748,980.04	5,140,518.65
其中:存款利息收入	646,574.29	806,772.79
债券利息收入	1,223.45	1,655,759.16
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	101,182.30	2,677,986.70
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	84,255,050.63	-16,453,393.87
其中:股票投资收益	76,399,220.30	-17,553,289.80
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-85,688.66	-5,102,664.56
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	7,941,518.99	6,202,560.49
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-103,967,386.76	60,604,922.11
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	85,802.53	5,373,894.02
减:二、费用	14,420,056.55	22,653,783.96
1. 管理人报酬	6,770,571.33	11,535,217.63
2. 托管费	1,128,428.55	1,922,536.17
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,300,659.79	8,979,091.31
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	220,396.88	216,938.85
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-33,297,610.11	32,012,156.95
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-33,297,610.11	32,012,156.95

注:本基金由原科瑞证券投资基金于2017年1月3日转型而来,上年度可比期间为2017年1月3日至2017年6月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达科瑞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)	945,188,031.29	-146,852.12	945,041,179.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-33,297,610.11	-33,297,610.11
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)	-64,063,328.16	-1,079,523.90	-65,142,852.06
其中:1.基金申购款	24,366,706.56	42,377.24	24,409,083.80
2.基金赎回款	-88,430,034.72	-1,121,901.14	-89,551,935.86
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)	881,124,703.13	-34,523,986.13	846,600,717.00
项目	上年度可比期间 2017年1月3日(基金合同生效日)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)	3,000,000,000.00	-437,932,349.94	2,562,067,650.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,012,156.95	32,012,156.95
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)	-1,764,719,832.06	252,645,365.36	-1,512,074,466.70
其中:1.基金申购款	6,081,683.04	-850,639.58	5,231,043.46
2.基金赎回款	-1,770,801,515.10	253,496,004.94	-1,517,305,510.16
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)	1,235,280,167.94	-153,274,827.63	1,082,005,340.31

注:本基金由原科瑞证券投资基金于2017年1月3日转型而来,上年度可比期间为2017年1月3日至2017年6月30日。

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

易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")由科瑞证券投资基金转型而来。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[2016]1917号《关于准予科瑞证券投资基金变更注册的批复》和基金管理人于2016年10月12日发布的《易方达基金管理有限公司关于科瑞证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,科瑞证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、更换登记机构、终止上市、更名为"易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金"、修改投资目标、投资范围及投资策略、调整收益分配原则等条款及相应修订基金合同等。自2017年1月3日科瑞证券投资基金终止上市之日起,由《科瑞证券投资基金基金合同》修订而成的《易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,原《科瑞证券投资基金基金合同》将自同一日起失效。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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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企业会计准则、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征增值税试点的通知》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
交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")	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

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	-	-	525,232,128.43	8.93%

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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月3日(基金合同生效日)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
广发证券	420,185.66	8.30%	238,387.45	10.85%

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3日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,770,571.33	11,535,217.63
其中:支付销售机构的客户维护费	463,958.37	136,009.33

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.50%÷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。于次月首日起5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3日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,128,428.55	1,922,536.17

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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。于次月首日起5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、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

份额单位:份

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3日(基金合同生效日)至2017年6月30日
基金合同生效日(2017年1月3日)持有的基金份额	-	148,612,662.00
报告期初持有的基金份额	123,612,662.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	123,612,662.00	148,612,662.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.03%	12.03%

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。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末2018年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末2017年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
粤财信托	7,500,000.00	0.85%	7,500,000.00	0.79%

注:除基金管理人之外的其他关联方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。

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 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	164,421,911.01	616,761.30	116,871,391.28	752,502.95

注:本基金的上述银行存款由基金托管人交通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	基金在承销期内买入 数量(单位:股/张)	总金额
本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
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3日(基金合同生效日)至2017年6月30日					
广发证券	300639	凯普生物	新股网下发行	1,046	19,235.94
广发证券	002867	周大生	新股网下发行	3,444	68,604.48
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	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	300669	沪宁股份	新股网下发行	841	9,251.00

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
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
300713	英可瑞	2017-10-23	2018-11-01	老股转让流通受限	40.29	39.07	12,614	282,352.32	492,828.98	-
000568	泸州老窖	2017-09-13	2018-09-14	非公开发行流通受限	48.00	58.45	31,249	1,499,952.00	1,826,504.05	-
000568	泸州老窖	2017-09-13	2019-09-16	非公开发行流通受限	48.00	55.31	31,250	1,500,000.00	1,728,437.50	-

注:1)深圳市英可瑞科技股份有限公司于2018年6月19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),同时按每10股转增8股进行资本公积金转增股本;

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%。

6.4.9.2 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
300324	旋极信息	2018-05-30	重大事项停牌	8.38	-	-	505,363	5,578,967.85	4,234,941.94	-
600701	*ST工新	2018-03-14	重大事项停牌	9.22	2018-08-17	8.76	398,600	3,750,080.11	3,675,092.00	-

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为0,无抵押债券。

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为0,无抵押债券。

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671,190,728.06元,属于第二层次的余额为11,957,804.47元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次779,333,784.24元,第二层次7,493,465.55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	683,148,532.53	79.62
	其中:股票	683,148,532.53	79.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	168,352,164.96	19.62
8	其他各项资产	6,502,940.78	0.76
9	合计	858,003,638.27	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	8,656,325.08	1.02
B	采矿业	29,041,127.11	3.43
C	制造业	348,396,244.99	41.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,061,135.76	0.24
E	建筑业	25,920,859.45	3.06
F	批发和零售业	52,150,134.51	6.16
G	交通运输、仓储和邮政业	9,352,502.63	1.10
H	住宿和餐饮业	24,212,052.48	2.86
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,717,877.20	4.69
J	金融业	123,248,931.18	14.56
K	房地产业	84,180.00	0.01
L	租赁和商务服务业	18,880,127.00	2.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
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	1,345,809.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	683,148,532.53	80.69

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	600519	贵州茅台	70,971	51,912,447.66	6.13
2	601939	建设银行	6,766,701	44,321,891.55	5.24
3	000858	五粮液	404,603	30,749,828.00	3.63
4	600196	复星医药	723,726	29,955,019.14	3.54
5	600028	中国石化	4,248,285	27,571,369.65	3.26
6	600030	中信证券	1,551,183	25,703,102.31	3.04
7	002202	金风科技	2,000,741	25,289,366.24	2.99
8	600754	锦江股份	655,088	24,212,052.48	2.86
9	600036	招商银行	816,242	21,581,438.48	2.55
10	300059	东方财富	1,401,332	18,469,555.76	2.18

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	601939	建设银行	82,061,543.08	8.68
2	600028	中国石化	51,491,344.47	5.45
3	601088	中国神华	48,865,811.52	5.17
4	600887	伊利股份	45,656,452.22	4.83
5	000858	五粮液	42,136,154.08	4.46
6	600754	锦江股份	36,603,030.67	3.87
7	601111	中国国航	36,085,692.90	3.82
8	002126	银轮股份	35,390,064.32	3.74
9	600030	中信证券	35,104,558.52	3.71
10	000998	隆平高科	34,579,627.53	3.66
11	603708	家家悦	32,152,055.52	3.40
12	002202	金风科技	31,909,666.27	3.38
13	600809	山西汾酒	29,498,179.12	3.12
14	600036	招商银行	29,182,859.01	3.09
15	601117	中国化学	28,088,721.84	2.97
16	601009	南京银行	27,677,536.18	2.93
17	000002	万科A	25,158,356.86	2.66
18	600967	内蒙一机	24,548,451.91	2.60
19	600153	建发股份	24,444,865.54	2.59
20	002191	劲嘉股份	24,264,169.64	2.57
21	000895	双汇发展	23,659,652.57	2.50
22	300059	东方财富	23,638,620.20	2.50
23	600258	首旅酒店	23,576,941.83	2.49
24	600845	宝信软件	22,417,099.50	2.37
25	600104	上汽集团	22,069,176.63	2.34
26	300398	飞凯材料	21,255,331.90	2.25
27	002311	海大集团	21,001,424.24	2.22
28	002697	红旗连锁	20,825,337.53	2.20
29	600690	青岛海尔	20,674,100.58	2.19
30	600655	豫园股份	20,554,024.24	2.17
31	600643	爱建集团	20,048,061.86	2.12
32	000333	美的集团	20,031,497.97	2.12
33	002127	南极电商	19,784,639.95	2.09
34	002262	恩华药业	19,210,560.81	2.03

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	002142	宁波银行	61,508,334.54	6.51
2	601088	中国神华	49,386,021.72	5.23
3	600887	伊利股份	49,209,655.93	5.21
4	603708	家家悦	49,116,561.95	5.20
5	600258	首旅酒店	45,060,648.38	4.77
6	600036	招商银行	41,092,900.64	4.35
7	601939	建设银行	40,384,515.57	4.27
8	601318	中国平安	39,973,508.56	4.23
9	000858	五粮液	36,008,355.82	3.81
10	002496	辉丰股份	35,432,543.41	3.75
11	600809	山西汾酒	33,006,109.53	3.49
12	601111	中国国航	32,475,195.53	3.44
13	600038	中直股份	32,263,579.09	3.41
14	300398	飞凯材料	32,226,317.42	3.41
15	002126	银轮股份	30,498,734.15	3.23
16	000998	隆平高科	30,143,553.37	3.19
17	603833	欧派家居	29,069,676.20	3.08
18	601009	南京银行	28,799,116.96	3.05
19	600028	中国石化	27,283,731.02	2.89
20	000002	万科A	27,206,616.26	2.88
21	600030	中信证券	24,628,250.75	2.61
22	000651	格力电器	23,492,973.31	2.49
23	600690	青岛海尔	22,810,615.93	2.41
24	000333	美的集团	22,438,854.16	2.37
25	601601	中国太保	22,182,457.42	2.35
26	600104	上汽集团	21,936,569.80	2.32
27	600643	爱建集团	21,853,297.04	2.31
28	002013	中航机电	21,666,981.62	2.29
29	000895	双汇发展	21,113,529.60	2.23
30	000661	长春高新	20,928,598.67	2.21
31	600153	建发股份	20,794,209.67	2.20
32	600655	豫园股份	20,626,305.30	2.18
33	002139	拓邦股份	20,208,260.33	2.14
34	002458	益生股份	19,849,610.50	2.10

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	2,087,882,680.20
卖出股票收入(成交)总额	2,161,803,943.00

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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招商银行(代码:600036)为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。2018年2月12日,中国银监会针对招商银行股份有限公司的如下事由罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。

本基金投资招商银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除招商银行外,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。

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	381,804.20
2	应收证券清算款	5,869,958.83
3	应收股利	-
4	应收利息	32,292.19
5	应收申购款	218,885.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,502,940.78

7.12.4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。

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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	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
15,791	55,799.17	144,566,269.44	16.41%	736,558,433.69	83.59%

注:持有人户数含未确权的原持有人户数。

8.2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	30,791.87	0.0035%

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	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	0~10

9开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2017年1月3日)基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	945,188,031.29
本报告期基金总申购份额	24,366,706.56
减:本报告期基金总赎回份额	88,430,034.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	881,124,703.13

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
财达证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	675,471,914.57	15.92%	629,067.98	16.72%	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	14,225,784.23	0.34%	11,380.56	0.30%	-
光大证券	1	267,645,462.41	6.31%	249,257.39	6.63%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	221,538,907.81	5.22%	206,316.88	5.48%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	318,358,915.64	7.51%	296,487.70	7.88%	-
国元证券	1	17,684,520.37	0.42%	16,469.49	0.44%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	0	44,941,967.31	1.06%	35,953.46	0.96%	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	872,772,035.43	20.58%	812,807.35	21.61%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	115,292,746.01	2.72%	92,233.12	2.45%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	499,941,078.84	11.79%	399,951.45	10.63%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	137,955,333.36	3.25%	128,475.36	3.42%	-
招商证券	1	93,389,326.47	2.20%	86,969.95	2.31%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	962,635,321.28	22.69%	796,606.51	21.18%	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注:a) 本报告期内本基金减少华创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
财达证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	2,102,707.20	97.05%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	63,983.36	2.95%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司
二〇一八年八月二十八日