

## 易方达新利灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

力,外贸市场,此前较稳定仓位下增仓8月份也有回落,北市市场相比多数的纯权益近期则开始明显企稳,但持仓上仍然高者有,其中信托及委托类资产减持下持仓,前期持仓的呈现企稳较为明显。通胀数据在三季度以来小幅度,结构上食品及非食品部分均有所下。

三季度央行仍然维持了相对宽松的货币环境,债券市场流动性较为宽松,7月份市场收益率整体下行,6月9-9月份有所回升,反映出市场投资者对于宏观经济走势仍存信心,在三季度收益率变动的过程中,中短债利率整体表现良好,收益率曲线由前此较为平坦的状态趋向于正常,由于信用事件的发生频率整体偏低,信用利差并未收窄,信用评级利差整体保持相对偏高的水平上。

权益市场在经济内外不确定性关注程度相对更高,波动性持续较高,且结构分化明显,虽然上述指标三季度整体来看表现尚好,但主要由于以上述5为代表的权重股表现较好,中小市值个股表现则明显较弱。

操作上,三季度组合持仓处于中性水平,权益部分持仓在以上述基本面较好的价值型方向为主,权益市场的波动对组合整体表现产生了一定不利影响。

截至报告期末,本基金份额净值为1.170元,本报告期份额净值增长率为-0.43%,同期业绩比较基准收益率为0.89%。

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84
6	601318	中国平安	3,703	253,665.50	0.65
7	601288	工商银行	37,246	216,423.36	0.55
8	601012	招商银行	14,705	203,887.89	0.52
9	600029	南方航空	23,100	196,716.00	0.50
10	601111	中国国航	20,000	163,000.00	0.42

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	6,984,029.32	17.67
	其中:股票	6,984,029.32	17.67
2	固定收益投资	28,429,391.50	71.90
	其中:债券	28,429,391.50	71.90
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,700,000.00	4.30
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,001,042.27	5.06
7	其他资产	422,633.28	1.07
8	合计	39,537,994.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	煤炭、石油、天然气	121,752.00	0.21
C	制造业	4,028,401.66	10.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
K	建筑业	494,914.00	1.27
F	批发和零售业	1,268,560.00	3.22
G	交通运输、仓储和邮政业	496,347.03	1.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	622,546.68	1.59
L	房地产业	-	-
M	租赁和商务服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和医疗器械业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	6,984,029.32	17.67
合计		6,984,029.32	17.67

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84
6	601318	中国平安	3,703	253,665.50	0.65
7	601288	工商银行	37,246	216,423.36	0.55
8	601012	招商银行	14,705	203,887.89	0.52
9	600029	南方航空	23,100	196,716.00	0.50
10	601111	中国国航	20,000	163,000.00	0.42

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180206	18国债06	7,500,000	794,426,000.00	11.32
2	180210	18国债10	6,100,000	602,263,000.00	8.21
3	180404	18国债04	2,500,000	251,226,000.00	3.63
4	101903004	19国债04	1,600,000	164,362,000.00	2.27
5	130214	13国债14	1,573,210	163,141,877.00	2.26

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180206	18国债06	7,500,000	794,426,000.00	11.32
2	180210	18国债10	6,100,000	602,263,000.00	8.21
3	180404	18国债04	2,500,000	251,226,000.00	3.63
4	101903004	19国债04	1,600,000	164,362,000.00	2.27
5	130214	13国债14	1,573,210	163,141,877.00	2.26

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84
6	601318	中国平安	3,703	253,665.50	0.65
7	601288	工商银行	37,246	216,423.36	0.55
8	601012	招商银行	14,705	203,887.89	0.52
9	600029	南方航空	23,100	196,716.00	0.50
10	601111	中国国航	20,000	163,000.00	0.42

5.7 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.8 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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.9 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.10 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.11 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商品期货投资明细

序号	商品期货代码	商品期货名称	数量(手)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.12 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期权投资明细

序号	期权代码	期权名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.13 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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.14 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.15 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.16 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商品期货投资明细

序号	商品期货代码	商品期货名称	数量(手)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.17 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期权投资明细

序号	期权代码	期权名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	3.22
3	000898	五洲药业	13,127	891,976.65	2.28
4	601117	中国中铁	74,200	494,914.00	1.27
5	300713	奥飞娱乐	12,614	326,576.96	0.84

5.18 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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000033	荣盛控股	61,626	2,600,977.76	6.66
2	600326	中航资本	162,600	1,268,560.00	