

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2019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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:二〇一九年八月二十四日

1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对基金的真确性、准确性承担责任,并由基金管理人负责。本半年度报告经三分之一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2019年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合情况、报告期末持有的证券、报告期末持有的债券投资、报告期末持有的资产支持证券、报告期末持有的贵金属、报告期末持有的其他资产、报告期末持有的其他金融工具。

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。

本报告自2019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

基金名称:易方达量化策略精选混合
基金代码:002216
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2017年12月19日
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
报告期末基金资产总额:156,161,767,893元
基金合同的存续期:不定期

基金简称:易方达量化策略精选混合
基金A
基金C
报告期末基金的份额总额:128,276,10354份
26,389,664.32份

2.2 基金产品说明

投资目标:本基金采用量化策略进行投资组合管理,追求基金资产的长期稳健增值。

投资策略:本基金在充分研究量化投资市场的历史表现,借鉴量化投资在金融市场的成功经验,结合量化投资在海外市场的发展经验,通过量化模型对股票市场的分析,在量化模型的基础上,通过量化模型对股票进行选择,并根据多因子模型的限制,结合稳健的量化模型对股票进行投资。与此同时,基金管理人将紧密跟踪市场,根据市场变化对量化投资策略进行优化和调整,勤勉尽职,力争为投资者提供持续稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金业绩评价的说明

本基金管理人对报告期内基金业绩评价的说明,见“企业会

计准则—基本准则”,各项具体会计准则及有关规定的说明。

本基金报告期未采用基金业绩评价的说明,见“企业会

计准则—基本准则”,各项具体会计准则及有关规定的说明。

4.7 管理人对报告期基金净值增长率的说明

易方达量化策略精选混合A,本报告期未实施利润分配。

易方达量化策略精选混合C,本报告期未实施利润分配。

5 投资人报告

5.1 报告期内本基金持有人数及交易账户数情况说明

本报告期内,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格按照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

5.2 投资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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金收益分配等方面进行了认真的复核,对本基金的投

资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 投资人对本基金未实现利润分配的说明

5.3.1 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.2 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.3 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.4 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.5 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.6 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.7 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.8 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.9 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.10 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.11 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.12 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.13 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.14 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.15 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.16 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.17 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.18 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.19 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.20 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.21 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.22 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.23 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.24 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.25 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.26 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.27 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.28 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.29 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.30 托管人对未对半年度报告中财务信息等内容的真、准确和完整发表意见

本报告期,本托管人复核审查了本基金中的财务指标、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,对本基金未实现利润分配的,不再单独计提;对已缴纳增值税的,已按增值税规定,从应付管理人费用中扣除。

5.3.31 托管人对