易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:二〇一七年四月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2017年4月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达新丝路混合
基金主代码	001373
交易代码	001373
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月27日
报告期末基金份额总额	17,258,970,196.04份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为灵活配置混合型主动基金,将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。在股票投资方面,将通过对各行业内的公司受益于新丝路主题的程度以及持续性的深入分析,综合评估相关公司的增长前景、经营效率、竞争优势、盈利能力等方面的因素,判断受益公司的投资价值;在债券投资方面,将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	中证800指数收益率×65%+一年期人民币定期存款利率(税后)×35%
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2017年1月1日-2017年3月31日) 上期金额
1.本期已实现收益 -394,840,101.81 -
2.本期利润 864,996,388.91 -
3.加权平均基金份额本期利润 0.0489 -
4.期末基金资产净值 12,385,825,176.79 -
5.期末基金份额净值 0.718 -

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本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	7.32%	0.61%	2.58%	0.36%	4.74%	0.25%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年5月27日至2017年3月31日)

注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为-28.20%,同期业绩比较基准收益率为-21.95%。

§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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
樊正伟	本基金的基金经理、易方达新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2015-05-27	-	7年	硕士研究生,曾任中国银行深圳分行职员,易方达基金管理有限公司渠道经理、研究员、易方达积极成长证券投资基金基金经理助理。
郭杰	本基金的基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达改革红利混合型证券投资基金的基金经理	2015-11-07	-	9年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、易方达资源行业股票型证券投资基金基金经理。
张坤	本基金的基金经理、易方达中小盘混合型证券投资基金的基金经理、易方达亚洲精选股票型证券投资基金的基金经理、研究部总经理助理	2015-11-07	-	9年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金投资部基金经理助理。

注:1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期,樊正伟的“任职日期”为基金合同生效之日,郭杰、张坤的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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 公平交易专项说明

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11次,皆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。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度,上证综指上涨3.83%,深证综指上涨0.88%,沪深300指数上涨4.41%,创业板指下跌2.79%。板块方面,申万一级行业指数中家用电器、食品饮料、国防军工、建筑装饰等行业涨幅居前;传媒、农林牧渔、纺织服装等行业跌幅居前。

在2017年一季度的投资过程中,本基金继续保持对符合经济转型方向的细分行业中的优秀个股以及家用电器、食品饮料、交通运输、耐用消费品等行业中的龙头标的进行重点配置,与此同时精选个股,对一批估值较高、战略兑现较慢、经营管理水平较低的公司的股票进行了减持。

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0.718元,本报告期份额净值增长率为7.32%,同期业绩比较基准收益率为2.58%。

§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	10,423,513,801.08	83.74
	其中:股票	10,423,513,801.08	83.74
2	固定收益投资	777,949,000.00	6.25
	其中:债券	777,949,000.00	6.25
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	395,000,992.50	3.17
	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	806,662,931.21	6.48
7	其他资产	44,927,339.97	0.36
8	合计	12,448,054,064.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	204,251,912.81	1.65
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,144,699,125.16	65.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	291,138,379.54	2.35
E	建筑业	39,354,809.03	0.32
F	批发和零售业	88,036,224.16	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	604,882,687.23	4.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	524,152,396.40	4.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	227,373,229.80	1.84
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	263,883,798.87	2.13
R	文化、体育和娱乐业	35,677,584.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	10,423,513,801.08	84.16

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	000568	泸州老窖	16,908,582	713,373,074.58	5.76
2	000858	五粮液	11,811,190	507,881,170.00	4.10
3	600519	贵州茅台	1,133,699	438,015,945.64	3.54
4	002572	索菲亚	5,450,644	369,129,014.44	2.98
5	300068	南都电源	15,638,267	344,823,787.35	2.78
6	000333	美的集团	10,000,000	333,000,000.00	2.69
7	601012	隆基股份	21,008,367	332,362,365.94	2.68
8	000651	格力电器	10,046,716	318,480,897.20	2.57
9	000089	深圳机场	34,200,000	301,644,000.00	2.44
10	002434	万里扬	16,959,091	290,509,228.83	2.35

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	599,280,000.00	4.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	169,317,000.00	1.37
	其中:政策性金融债	169,317,000.00	1.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	9,352,000.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	777,949,000.00	6.28

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五名债券投资明细

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	019546	16国债18	6,000,000	599,280,000.00	4.84
2	150212	15国开12	1,500,000	149,595,000.00	1.21
3	150223	15国开23	200,000	19,722,000.00	0.16
4	113011	光大转债	93,520	9,352,000.00	0.08

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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,405,355.78
2	应收证券清算款	29,399,289.96
3	应收股利	-
4	应收利息	13,168,277.46
5	应收申购款	954,406.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,927,339.97

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300068	南都电源	344,823,787.35	2.78	重大事项停牌
2	002572	索菲亚	77,999,987.94	0.63	非公开发行流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	17,981,706,047.72
报告期基金总申购份额	49,239,403.38
减:报告期基金总赎回份额	771,975,255.06
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	17,258,970,196.04

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一七年四月二十一日

易方达新享灵活配置混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达新享混合	
基金主代码	001342	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年5月29日	
报告期末基金份额总额	531,959,876.79份	
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	本基金通过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、货币市场工具等资产类别的配置比例,严格遵守低估值的股票投资逻辑,以绝对收益为目标,力争获得稳健、持续的投资收益。	
业绩比较基准	一年期人民币定期存款利率(税后)+2%	
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。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达新享混合A	易方达新享混合C
下属分级基金的交易代码	001342	001343
报告期末下属分级基金的份额总额	173,155,070.89份	358,804,805.90份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2017年1月1日-2017年3月31日)	
	易方达新享混合A	易方达新享混合C
1.本期已实现收益	4,562,167.70	3,344,118.40
2.本期利润	10,506,637.04	7,275,372.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0395	0.0266
4.期末基金资产净值	251,716,496.25	381,113,898.73
5.期末基金份额净值	1.454	1.062

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本报告期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

易方达新享混合A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	2.76%	0.14%	0.88%	0.01%	1.88%	0.13%

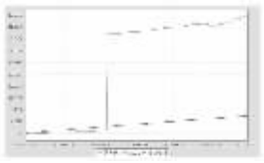
易方达新享混合C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	2.71%	0.14%	0.88%	0.01%	1.83%	0.13%

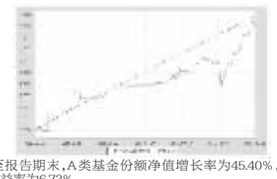
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达新享灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年5月29日至2017年3月31日)

易方达新享混合A



易方达新享混合C



注:自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为45.40%,C类基金份额净值增长率为6.20%,同期业绩比较基准收益率为6.73%。

§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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张清华	本基金的基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞丽灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞丽灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理、易方达安益回报混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回报混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、固定收益基金投资部总经理	2016-03-29	-	10年	硕士研究生,曾任晨星资讯(深圳)有限公司数量分析师,中信证券股份有限公司研究员,易方达基金管理有限公司投资经理。
李一硕	本基金的基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞丽灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达惠鼎纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理(自2016年09月09日至2017年03月06日)、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕丽灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金LOF的基金经理助理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理(自2016年09月09日至2017年03月06日)	2017-03-07	-	9年	硕士研究生,曾任瑞银证券有限公司研究员,中国国际金融有限公司研究员,易方达基金管理有限公司研究员。

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 公平交易专项说明

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11次,皆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。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

从经济基本面的角度看,一季度我国经济走势平稳。其中1-2月工业增加值同比增长6.3%,基本符合市场预期;发电量、钢铁、水泥产量相比于去年12月均有不同幅度的回升。不过消费需求方面,1-2月零售同比由10.9%降至9.5%,明显低于市场预期。此外,2月CPI同比0.8%,也大幅低于市场预期。月度环比由0.9%降至-7.3%。由于今年一季度房地产销售及投资的表现良好,导致全国范围内一二线城市陆续公布了更为严厉的调控措施。

一季度央行货币政策的态度进一步收紧,一方面是为了应对美联储加息带来的汇率贬值压力;另一方面也是为了抑制金融资产泡沫进一步膨胀。尤其是央行连续两次上调公开市场操作利率,使得市场机构对全年后续货币政策继续紧缩的担忧不断提升。

二级市场方面,进入2017年以来,债券收益率自去年四季度的高点持续回落,中短端信用债表现的更为明显。1月中旬收益率达到阶段性低点后开始震荡上行。出于对3月资金面紧张的预期,收益率一度突破新高;但进入中下旬后虽然中短端收益率继续上行或高位企稳,但长端收益率反而出现一定回落迹象。

权益方面表现相对分化。一季度企业补库存动力较为强劲,大宗商品价格依然维持高位,部分盈利改善较多的行业出现明显上涨。但一季度整体而言权益市场维持震荡格局。

操作上,一季度组合整体保持偏低的杠杆及久期水平。在3月份短端收益率抬升后,组合的杠杆及久期水平阶段性有所提升。此外,组合积极参与新股申购。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.454元,本报告期份额净值增长率为2.76%;C类基金份额净值为1.062元,本报告期份额净值增长率为2.71%;同期业绩比较基准收益率为0.88%。

§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	133,175,392.97	18.08
	其中:股票	133,175,392.97	18.08
2	固定收益投资	542,296,931.67	73.62
	其中:债券	542,296,931.67	73.62
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	45,800,163.20	6.22
	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	4,803,023.75	0.65
7	其他资产	10,575,608.31	1.44
8	合计	736,641,119.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1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	6,282,870.00	0.99
C	制造业	73,675,992.63	11.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,990,500.00	0.31
E	建筑业	25,001.46	0.00
F	批发和零售业	2,352,354.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	15,947,006.01	2.52
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	30,937,590.71	4.89
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,947,148.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
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	133,175,392.97	21.04

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	000858	五粮液	390,285	16,781,395.00	2.65
2	000001	平安银行	1,099,963	10,086,660.71	1.59
3	601818	光大银行	2,400,000	9,864,000.00	1.56
4	601318	中国平安	193,000	7,142,930.00	1.13
5	000651	格力电器	219,945	6,972,256.50	1.10
6	600519	贵州茅台	16,000	6,181,760.00	0.98
7	600029	南方航空	686,252	5,531,191.12	0.87
8	600660	福耀玻璃	240,200	5,430,922.00	0.86
9	002008	大族激光	168,600	4,429,122.00	0.70
10	000089	深圳机场	495,000	4,365,900.00	0.69

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,880,000.00	6.30
	其中:政策性金融债	39,880,000.00	6.30
4	企业债券	97,673,000.00	15.43
5	企业短期融资券	339,565,000.00	53.66
6	中期票据	60,294,000.00	9.53
7	可转债(可交换债)	4,894,931.67	0.77
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	542,296,931.67	85.69

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五名债券投资明细

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	041682014	16南方水泥CP001	600,000	60,420,000.00	9.55
2	101563029	15河钢MTN001	500,000	50,150,000.00	7.92
3	041758005	17中原高速CP001	500,000	49,800,000.00	7.87
4	1480151	14永州城建债	400,000	42,708,000.00	6.75
5	170401	17农发01	400,000	39,880,000.00	6.30

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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9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。

5.10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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	91,339.30
2	应收证券清算款	269,296.87
3	应收股利	-
4	应收利息	9,994,642.14
5	应收申购款	220,330.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,575,608.31

5.11.4报告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。

5.11.5报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达新享混合A	易方达新享混合C
报告期期初基金份额总额	196,808,696.56	197,213,084.00
报告期基金总申购份额	169,023,961.43	161,910,857.44
减:报告期基金总赎回份额	192,677,586.10	319,135.54
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	173,155,070.89	358,804,805.90

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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						报告期末持有基金情况	
	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	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日至2017年3月6日	120,946,958.98	-	120,946,958.98	-	-
	2	2017年1月1日至2017年3月31日	196,270,853.78	-	-	196,270,853.78	36.90%
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及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;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。							

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会准予易方达新享灵活配置混合型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达新享灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

9.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇一七年四月二十一日

易方达证券公司指数分级证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:二〇一七年四月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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2017年4月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达证券公司分级		
基金主代码	502010		
交易代码	502010		
基金运作方式	契约型开放式、分级基金		
基金合同生效日	2015年7月8日		
报告期末基金份额总额	310,500,892.46份		
投资目标	紧密追踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。		
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资,固完全按照标的指数的成份股组成及权重构建基金投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内,日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。		
业绩