易方达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日

基金管理人:易方达基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月23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7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	易方达新兴成长混合
基金主代码	000404
交易代码	000404
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月28日
报告期末基金份额总额	1,275,905,077.24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和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的资产配置主要是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、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资策略方面,本基金将从新兴产业中优选预期成长性较好的公司的股票进行投资。本基金所指的预期成长性较好的公司是指预期净利润复合增长率高于同期GDP增长率2倍并满足公司所在行业景气度较高且具有可持续性、公司所在行业竞争格局良好以及公司管理层素质较高等标准的公司。在债券投资策略方面,本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。同时,本基金将根据对现货和期货市场的分析,采取多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×50%+中债总财富指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其风险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	中国工商银行股份有限公司

§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7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	-40,246,617.36
2.本期利润	365,984,357.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.4610
4.期末基金资产净值	3,124,256,319.37
5.期末基金份额净值	2.449

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

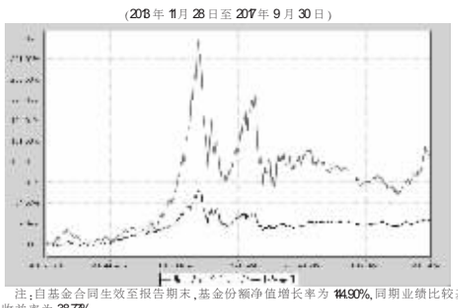
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	26.37%	1.67%	3.53%	0.42%	22.84%	1.25%

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

易方达新兴成长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

(2018年11月28日至2017年9月30日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为144.90%,同期业绩比较基准收益率为38.77%。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋昆	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、易方达科讯混合型证券投资基金的基金经理、投资二部总经理	2013-11-28	-	11年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、公募基金投资部总经理助理、公募基金投资部副总经理、公募基金投资部副总经理、易方达创新驱动灵活配置混合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。本基金管理人制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7次,均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年三季度,上证综指上涨4.90%,深证成指上涨5.30%,沪深300指数上涨4.63%、中小板指上涨8.86%、创业板指上涨2.69%。有色金属、食品饮料、通信、电子元器件等行业涨幅居前,下跌的或涨幅较少的行业包括机械、建筑、电力及公用事业、传媒和纺织服装等。

本基金延续了一贯的投资思路,保持了对战略新兴产业的重点配置。考虑到新能源、新能源汽车等行业不仅符合未来社会和科技的发展趋势,而且有利于拉动国内经济增长、促进经济转型,本季度继续对这两个产业链中的优质公司进行了布局。与此同时,本基金对创新医药和高端制造领域也进行了深入研究。

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2.449元,本报告期份额净值增长率为26.37%,同期业绩比较基准收益率为3.53%。

§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	2,693,877,689.24	85.59
	其中:股票	2,693,877,689.24	85.59
2	固定收益投资	99,670,000.00	3.17
	其中:债券	99,670,000.00	3.17
	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	197,056,735.58	6.26
	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	112,325,662.68	3.57
7	其他资产	44,487,163.94	1.41
8	合计	3,147,417,251.44	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	39,793.60	0.00
C	制造业	2,515,431,776.60	80.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	89,446.56	0.00
E	建筑业	103,432.72	0.00
F	批发和零售业	1,624,547.12	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	196,035.81	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,055,862.31	4.61
J	金融业	235,343.70	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,916,591.97	0.09
M	科学研究和技术服务业	608,714.50	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	51,243.66	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	24,545,345.85	0.79
R	文化、体育和娱乐业	3,979,554.84	0.13
S	综合	-	-
	合计	2,693,877,689.24	86.22

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	601012	隆基股份	9,082,582	267,663,691.54	8.57
2	603799	华友钴业	2,578,829	235,885,488.63	7.55
3	002466	天齐锂业	2,980,034	209,466,589.86	6.70
4	002497	雅化集团	11,234,148	207,494,713.56	6.64
5	002460	赣锋锂业	1,879,112	164,046,477.60	5.25
6	300142	沃森生物	8,989,479	151,472,721.15	4.85
7	300450	先导智能	2,012,302	150,117,729.20	4.80
8	300346	南大光电	4,032,741	121,708,123.38	3.90
9	300457	赢合科技	3,304,050	116,798,167.50	3.74
10	600196	复星医药	3,410,804	116,615,388.76	3.73

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	99,670,000.00	3.19
	其中:政策性金融债	99,670,000.00	3.19
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	99,670,000.00	3.19

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	170410	17农发10	1,000,000	99,670,000.00	3.19

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	306,001.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	875,514.01
5	应收申购款	43,305,648.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,487,163.94

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

报告期期初基金份额总额	515,294,394.52
报告期基金总申购份额	1,010,434,555.31
减:报告期基金总赎回份额	249,823,872.59
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,275,905,077.24

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	61,530,929.03
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	61,530,929.03
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.82

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)中国证监会核准易方达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2)《易方达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3)《易方达新兴成长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

二〇一七年十月二十六日

易方达新享灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日

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:二〇一七年十月二十六日

§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10月23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7月1日起至9月30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	518,146,276.34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	208,188,563.32份	309,957,713.02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7月1日-2017年9月30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	5,128,247.64	6,684,848.03
2.本期利润	7,845,796.30	10,013,125.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0386	0.0268
4.期末基金资产净值	312,285,211.84	334,726,926.61
5.期末基金份额净值	1.500	1.080

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	2.58%	0.16%	0.89%	0.01%	1.69%	0.15%

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	2.54%	0.17%	0.89%	0.01%	1.65%	0.16%

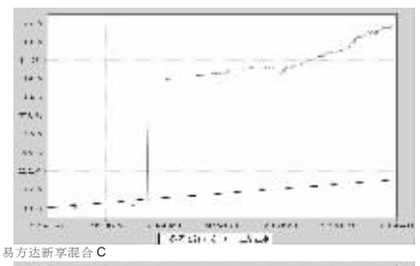
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达新享灵活配置混合型证券投资基金

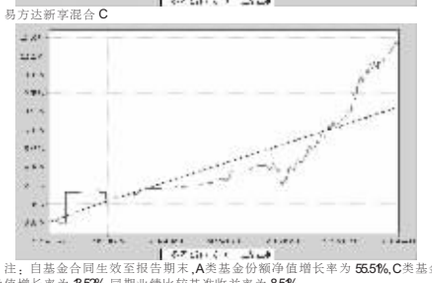
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年5月29日至2017年9月30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55.51%,C类基金份额净值增长率为13.52%,同期业绩比较基准收益率为8.51%。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、易方达新趋势灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新优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、易方达瑞选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、易方达瑞丰灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞享灵活配置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、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,曾任景顺资产(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。
李一菡	本基金的基金经理、易方达永福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、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达富君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、易方达稳胜混合型证券投资基金的基金经理、易方达如意如加纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达如加灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、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。	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、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

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。本基金管理人制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7次,均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

三季度宏观经济呈现出偏弱走势。虽然6月工业增加值同比增长7.6%,大幅高于市场预期,但此后持续下行。其中7月回落至6.4%,尤其是月度环比大幅下滑,8月份6.0%的同比增速水平依然明显低于市场预期。投资方面,7月投资单月同比由8.6%降至6.8%,同样大幅低于市场预期,其中基建投资在6月创出新高后在7月份转而下跌;8月投资数据单月同比增速则进一步降至4.9%。7月房地产销售面积和销售金额在6月小幅回升后大幅下滑,同时土地购置和新开工数据也有所回落。8月份房地产相关数据出现小幅回升,但整体而言仍然偏弱。三季度通胀数据则基本保持平稳,8月份略有上行。

不过由于三季度市场资金面维持紧平衡的态势,债券收益率并未随着宏观经济的下滑而回落,反而在8月份一度出现震荡上行的态势。由于流动性是市场变动的主导因素,短端品种上行幅度相对较大,收益率曲线形态小幅扁平化。三季度信用利差整体处于低位,变动不大。

股票市场三季度小幅上行,随着供给侧改革的深入,大宗商品价格普遍上涨,导致周期板块上涨幅度相对较多。大盘蓝筹风格股票则整体表现稳健。

操作上,三季度组合整体保持平稳的配置结构,杠杆及久期处于偏低水平。权益部分持仓以盈利较好的蓝筹风格股票为主。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1.500元,本报告期份额净值增长率为2.58%,C类基金份额净值为1.080元,本报告期份额净值增长率为2.54%;同期业绩比较基准收益率为0.89%。

§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	147,036,300.21	20.51
	其中:股票	147,036,300.21	20.51
2	固定收益投资	556,680,310.90	77.65
	其中:债券	556,680,310.90	77.65
	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	-	-
	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	2,098,170.11	0.29
7	其他资产	11,080,573.52	1.55
8	合计	716,895,354.74	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	6,553,593.60	1.01
C	制造业	90,458,194.55	13.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,291,593.44	0.35
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,498,471.45	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	13,472,294.95	2.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	30,309,641.70	4.68
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,275,742.00	0.20
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	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	147,036,300.21	22.73

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	336,431	19,270,767.68	2.98
2	601318	中国平安	243,000	13,160,880.00	2.03
3	000001	平安银行	814,470	9,048,761.70	1.40
4	000651	格力电器	219,945	8,335,915.50	1.29
5	600519	贵州茅台	16,000	8,282,240.00	1.28
6	601818	光大银行	2,000,000	8,100,000.00	1.25
7	002008	大族激光	168,600	7,350,960.00	1.14
8	600660	福耀玻璃	200,000	5,098,000.00	0.79
9	002019	亿帆医药	236,700	4,819,212.00	0.74
10	600029	南方航空	535,952	4,432,323.04	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	39,980,000.00	6.18
	其中:政策性金融债	39,980,000.00	6.18
4	企业债券	119,570,500.00	18.48
5	企业短期融资券	220,904,000.00	34.14
6	中期票据	157,153,000.00	24.29
7	可转债(可交换债)	19,072,810.90	2.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	556,680,310.90	86.04

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	011754060	17首钢SCP004	400,000	40,168,000.00	6.21
2	1480151	14永州城建债	400,000	33,692,000.00	5.21
3	101553001	15曦铁投MTN001	300,000	30,249,000.00	4.68
4	011772010	17舟山交投SCP002	300,000	30,129,000.00	4.66
5	041758005	17中原高速CP001	300,000	30,090,000.00	4.65

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	35,965.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,036,550.64
5	应收申购款	8,056.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,080,573.52

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	5,354,845.20	0.83

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	203,316,881.34	378,849,975.35
报告期基金总申购份额	6,039,211.85	78,540,512.22
减:报告期基金总赎回份额	1,167,529.87	147,432,774.55
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期末基金份额总额	208,188,563.32	309,957,713.02

§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07月01日~2017年09月30日	196,270,853.78	-	-		196,270,853.78	37.88%
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。

§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

二〇一七年十月二十六日

易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30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

报告送出日期:二〇一七年十月二十六日

§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10月23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7月1日起至9月30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	15,450,333,073.70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