易方达国防军工混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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	易方达国防军工混合
基金主代码	001475
交易代码	001475
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月19日
报告期末基金份额总额	4,904,223,798.49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、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资方面,本基金将根据对国防军工行业各细分子行业(主要包括航空、航天、兵器、船舶、信息安全等)的综合分析,确定各细分子行业的资产配置比例。在各细分子行业中,本基金将选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的上市公司进行投资。当各细分子行业与上市公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时,本基金将对股票组合适时进行调整。在债券投资方面,本基金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	申万国防军工指数收益率×70%+一年期人民币定期存款利率(税后)×30%
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。
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7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	80,449,009.88
2.本期利润	305,658,601.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0603
4.期末基金资产净值	4,507,211,183.94
5.期末基金份额净值	0.919

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。

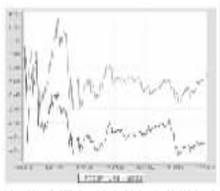
3.2 基金净值表现

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	7.11%	0.94%	3.04%	0.93%	4.07%	0.01%

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

易方达国防军工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6月19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-8.10%,同期业绩比较基准收益率为-35.26%。

§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		
陈皓	本基金的基金经理、易方达新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达平稳增长证券投资基金的基金经理、易方达科翔混合型证券投资基金的基金经理、易方达供给改革灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、投资一部总经理	2015-06-19	-	10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、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理、投资一部总经理助理、投资一部副总经理、易方达价值精选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年前三季度上证综指上涨约7.90%,同期申万国防军工行业指数下跌了7.06%。三季度单季度上证综指上涨约4.90%,申万国防军工行业指数涨幅约为4.02%,市场风险偏好有所上升,军工板块也触底反弹。三季度伴随朝鲜核试验引发的半岛危机以及俄美在叙利亚等中东地区的长期对峙,错综复杂的世界局势为我们国家的和平发展战略带来了严峻挑战,在不久的将来这必将体现在我国军队建设和国防装备的持续改善之中。

本基金一季度总体上保持了较为稳健的仓位,细分行业选择中重点配置了一批军工龙头公司,以及优质的民参军企业;二季度开始通过仓位和核心持仓的调整,尽可能规避回撤风险,重点布局了未来受益于装备放量服役的子行业与个股;三季度抓住了行业的总体反弹机会,积极参与了以军工电子为首的行业龙头的投资机会。

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0.919元,本报告期份额净值增长率为7.11%,同期业绩比较基准收益率为3.04%。

4.4.3管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年四季度,预计在党的"十九大"胜利召开之后,包括军改在内的各项深层次改革将逐步落地,叠加军队新装备陆续量产的背景,军工产品的出货量可能稳步提升。2018年,在军民融合、资产证券化以及"一带一路"大战略的刺激下,军工产业可能迎来新的发展契机,结合军工相关公司的估值与成长性,可能出现较好的投资机会。

综上所述,本基金希望通过管理人积极、勤勉的努力,为投资者奉献更加持续、稳定由于行业指数的回报。

§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	4,153,354,200.18	91.70
	其中:股票	4,153,354,200.18	91.70
2	固定收益投资	200,153,120.00	4.42
	其中:债券	200,153,120.00	4.42
	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	170,244,661.23	3.76
7	其他资产	5,700,232.24	0.13
8	合计	4,529,452,213.65	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	31,884,175.73	0.71
C	制造业	3,842,426,897.13	85.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	63,177,030.00	1.40
F	批发和零售业	23,873,293.45	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	77,285,095.59	1.71
J	金融业	-	-
K	房地产业	114,491,752.44	2.54
L	租赁和商务服务业	-	-
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	0.00
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,153,354,200.18	92.15

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	002384	东山精密	15,300,000	439,416,000.00	9.75
2	002179	中航光电	8,612,581	320,388,013.20	7.11
3	600038	中直股份	6,000,043	262,261,879.53	5.82
4	600703	三安光电	11,000,000	254,540,000.00	5.65
5	600893	航发动力	7,739,154	242,003,345.58	5.37
6	000768	中航飞机	10,900,000	209,607,000.00	4.65
7	002260	德奥通航	7,450,000	187,963,500.00	4.17
8	600990	四创电子	2,718,878	156,797,694.26	3.48
9	002025	航天电器	6,004,865	129,224,694.80	2.87
10	002077	大港股份	9,572,889	114,491,752.44	2.54

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	199,380,000.00	4.42
	其中:政策性金融债	199,380,000.00	4.42
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)	773,120.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,153,120.00	4.44

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	170207	17国开07	2,000,000	199,380,000.00	4.42
2	132003	15清控EB	7,550	773,120.00	0.02

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	644,906.89
2	应收证券清算款	136,384.23
3	应收股利	-
4	应收利息	1,618,632.75
5	应收申购款	3,300,308.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,700,232.24

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	132003	15清控EB	773,120.00	0.02

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	002260	德奥通航	187,963,500.00	4.17	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,184,192,846.65
报告期基金总申购份额	212,136,677.54
减:报告期基金总赎回份额	492,105,725.70
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	4,904,223,798.49

§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国防军工混合型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达国防军工混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达国防军工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

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	易方达瑞享混合	
基金主代码	001437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年6月26日	
报告期末基金份额总额	159,715,257.04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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
下属分级基金的交易代码	001437	001438
报告期末下属分级基金的份额总额	88,728,520.94份	70,986,736.10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)	
	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
1.本期已实现收益	7,159,016.97	4,537,648.93
2.本期利润	7,683,679.56	4,953,344.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0843	0.0693
4.期末基金资产净值	125,757,399.21	82,730,853.69
5.期末基金份额净值	1.417	1.165

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

易方达瑞享混合I

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	6.38%	1.33%	0.89%	0.01%	5.49%	1.32%

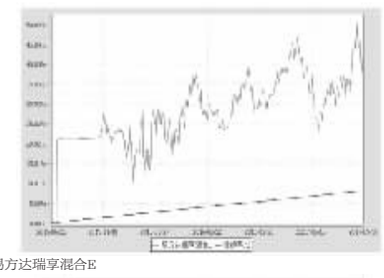
易方达瑞享混合E

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	6.30%	1.34%	0.89%	0.01%	5.41%	1.33%

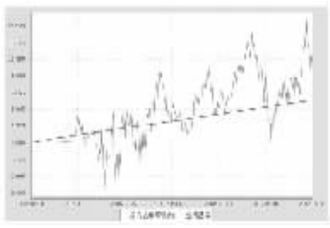
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达瑞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6月26日至2017年9月30日)

易方达瑞享混合I



易方达瑞享混合E



注:自基金合同生效至报告期末,I类基金份额净值增长率为41.70%,E类基金份额净值增长率为16.50%,同期业绩比较基准收益率为8.18%。

§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		
梁裕宁	本基金的基金经理、易方达策略成长证券投资基金的基金经理、易方达策略成长二号混合型证券投资基金的基金经理	2016-01-23	-	7年	硕士研究生,曾任普华永道会计师事务所高级审计师,中山华通五金制品有限公司总裁助理,OO Distinction Pty Ltd董事、财务负责人,易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、投资经理兼行业研究员。

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,受国内经济韧性超预期及金融去杠杆压力逐步缓解的影响,市场流动性和活跃度有所改善,市场风险偏好从防守转向均衡。供给侧改革和环保执法持续发挥影响,导致国内相关大宗商品价格大幅走高,周期行业盈利迅速改善。同时,新能源汽车产业利好消息频繁,资本市场对相关主题认可度较高。在周期股和新能源主题上涨的带领下,A股市场人气逐步提升。截至9月29日,上证指数收于3348.94点,单季度上涨4.9%,区间振幅7.9%;创业板指数收于1866.98点,单季度上涨2.69%,区间振幅15.21%。整个三季度A股市场稳健上行,成交量环比温和放大。市场结构性分化程度有所下降,创业板和主板均取得正收益。

从结构上看,由于下半年金融去杠杆压力减弱,货币政策从偏紧转向中性,市场流动性改善,市场整体风险偏好有所提升,周期股及新能源汽车有效点燃市场热情。三季度,中信有色金属指数单季度涨幅超过25%,其他周期行业如钢铁、煤炭单季度涨幅均取得超过15%的涨幅,指数涨幅超过10%的行业还有建材、电子元器件、通讯及食品饮料。仅有传媒、医药、电力及公用事业和纺织服装四个行业取得轻微负收益。

三季度在资产配置上,考虑供给侧改革的持续性和大宗商品需求端的稳定性,本基金在维持偏高仓位的情况下,配置了较大比例周期股和部分新能源汽车产业标的,整体效果尚可。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金I类基金份额净值为1.417元,本报告期份额净值增长率为6.38%;E类基金份额净值为1.165元,本报告期份额净值增长率为6.30%;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	191,790,720.45	91.23
	其中:股票	191,790,720.45	91.23
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	17,365,836.08	8.26
7	其他资产	1,067,871.62	0.51
8	合计	210,224,428.15	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	7,879,793.60	3.78
C	制造业	158,893,007.53	76.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.01
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	0.01
J	金融业	10,979,800.00	5.27
K	房地产业	2,504,250.00	1.20
L	租赁和商务服务业	9,747,050.00	4.68
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	0.06
R	文化、体育和娱乐业	1,571,000.50	0.75
S	综合	-	-
	合计	191,790,720.45	91.99

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	601988	中国银行	2,665,000	10,979,800.00	5.27
2	000932	*ST华菱	1,200,000	10,740,000.00	5.15
3	002236	大华股份	400,800	9,647,256.00	4.63
4	600519	贵州茅台	17,400	9,006,936.00	4.32
5	600782	新钢股份	1,400,000	8,820,000.00	4.23
6	000807	云铝股份	600,000	8,322,000.00	3.99
7	002668	奥马电器	400,000	8,008,000.00	3.84
8	603993	洛阳钼业	1,000,000	7,840,000.00	3.76
9	000933	神火股份	600,066	6,822,750.42	3.27
10	000568	泸州老窖	134,166	6,726,717.72	3.23

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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国花顺(代码:300033)为易方达信息产业混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。浙江核新同花顺网络信息股份有限公司2016年11月26日收到了中国证监会下发的《行政处罚决定书》,公司违反证券期货法律法规,被中国证监会予以行政处罚。

中兴通讯(代码:000063)为易方达信息产业混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。根据中兴通讯股份有限公司董事会2017年3月7日《关于重大事项进展公告》,公司违反了美国进出口法律管制,并在调查过程中因提供信息及其他行为违反了相关美国法律法规,被美国相关机构处以罚款。

本基金投资同花顺、中兴通讯的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除同花顺、中兴通讯外,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。

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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	261,765.98
2	应收证券清算款	317,966.71
3	应收股利	-
4	应收利息	4,004.09
5	应收申购款	484,134.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,067,871.62

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	000568	泸州老窖	5,043,717.72	2.42	非公开发行流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
报告期期初基金份额总额	92,532,786.13	73,951,361.16
报告期基金总申购份额	2,211,991.61	3,220,467.62
减:报告期基金总赎回份额	6,016,256.80	6,185,092.68
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	88,728,520.94	70,986,736.10

§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

项目	易方达瑞享混合I	易方达瑞享混合E
报告期期初管理人持有的本基金份额	78,645,384.75	61,148,860.70
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	78,645,384.75	61,148,860.70
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	88.64	86.14

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07月24日	48,827,149.74	-	48,827,149.74	-	-
	2	2017年07月01日-2017年09月30日	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	64.06%
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瑞享灵活配置混合型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达瑞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

易方达信息产业混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

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	易方达信息产业混合
基金主代码	001513
交易代码	001513
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月27日
报告期末基金份额总额	156,101,173.32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、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资方面,本基金综合考虑行业景气度及可持续性、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势、国家政策等因素,进行股票资产在各细分子行业之间的配置。在个股选择方面,本基金对信息产业上市公司的投资价值进行综合评价,精选具备较强竞争优势的上市公司,在债券投资方面,本基金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TMT产业主题指数收益率×70%+一年期人民币定期存款利率(税后)×30%
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。
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7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	15,058,391.28
2.本期利润	13,919,146.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0777
4.期末基金资产净值	183,674,929.09
5.期末基金份额净值	1.177

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