易方达裕鑫债券型证券投资基金

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:招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。

基金托管人招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	易方达裕鑫债券	
基金主代码	003133	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月5日	
报告期末基金份额总额	403,523,221.15份	
投资目标	本基金主要投资于债券资产,严格管理权益类品种的投资比例,在控制基金资产净值波动的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势,深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等,综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素,在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+中债新综合指数收益率(全价)×80%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达裕鑫债券A	易方达裕鑫债券C
下属分级基金的交易代码	003133	003134
报告期末下属分级基金的份额总额	402,514,876.90份	1,008,344.25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)	
	易方达裕鑫债券A	易方达裕鑫债券C
1.本期已实现收益	3,999,463.56	9,947.24
2.本期利润	2,271,750.34	5,504.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0056	0.0053
4.期末基金资产净值	412,482,287.52	1,031,090.94
5.期末基金份额净值	1.0248	1.0226

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

易方达裕鑫债券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	0.58%	0.18%	0.58%	0.09%	0.00%	0.09%

易方达裕鑫债券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	0.53%	0.18%	0.58%	0.09%	-0.05%	0.09%

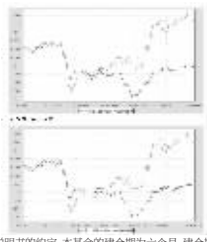
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达裕鑫债券型证券投资基金

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

(2016年9月5日至2017年9月30日)

易方达裕鑫债券A



注:1.按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为2.48%,C类基金份额净值增长率为2.26%,同期业绩比较基准收益率为-1.35%。

§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、易方达新享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、易方达瑞逸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、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞弘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、易方达丰利债券型证券投资基金的基金经理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈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	2016-09-05	-	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。
张磊	本基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理、易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒久添利1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达高等级信用债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助理	2016-12-03	-	11年	硕士研究生,曾任泰康人寿保险公司资产管理中心固定收益部研究员、投资经理,新华资产管理公司固定收益部高级投资经理,易方达基金管理有限公司固定收益部投资经理。

注:1.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期,张清华的"任职日期"为基金合同生效之日,张磊的"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年三季度债券市场收益率处于震荡格局中,并没有出现明显的趋势。基本面上七月公布的六月经济数据显示经济韧性仍然较强,市场对于经济的悲观预期有所修正。但是七月数据再次意外大幅下滑,固定资产投资和工业增加值均出现非常明显的下行。八月数据有所反弹,但是反弹力度不及预期;背后有部分政策限产的原因,但是市场对于经济下滑的担心又开始加剧。另一方面融资数据仍然保持强势,表内贷款持续超预期,尤其是居民部门的贷款量一直处于高位,整体的社会融资总量也相对较好。经济数据和融资数据的背离使得市场短期分歧有所加大,但是市场对于中长期利率下行的看法却比较一致,这使得收益率的上行空间有限。另一方面,央行货币政策维持中性态度,非银行金融机构资金面相对偏紧,此外部分新规约束也造成了流动性的结构性紧张,短端收益率持续处于高位,居高不下的短端收益率也约束了长端收益率的下行空间。

权益市场三季度震荡上行,总体趋势仍然不强。三季度由于供给限制导致大宗商品价格上涨,包括有色金属、钢铁、煤炭在内的周期行业上涨幅度较多。此外创业板在三季度也有所反弹,反映市场的风险偏好有所恢复。

本基金在三季度的债券投资继续维持相对合理的久期和组合杠杆,减持部分资质相对较差的品种,以获取持有期收益为主要目标,维持组合流动性,时刻关注信用风险,积极根据市场情况进行利率债波段操作。权益方面,利用股票和转债的波段操作博取了部分超额收益。

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1.0248元,本报告期份额净值增长率为0.58%;C类基金份额净值为1.0226元,本报告期份额净值增长率为0.53%;同期业绩比较基准收益率为0.58%。

§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	82,323,851.25	15.62
	其中:股票	82,323,851.25	15.62
2	固定收益投资	422,485,209.70	80.17
	其中:债券	422,485,209.70	80.17
	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	4,000,000.00	0.76
	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	11,616,277.52	2.20
7	其他资产	6,566,578.98	1.25
8	合计	526,991,917.45	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	2,600.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	40,876,596.76	9.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,038.00	0.00
F	批发和零售业	3,878.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	11,074,675.93	2.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,698,131.30	2.83
J	金融业	18,624,801.40	4.50
K	房地产业	21,738.60	0.01
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	78.75	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	20,312.51	0.00
S	综合	-	-
	合计	82,323,851.25	19.91

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	002236	大华股份	439,252	10,572,795.64	2.56
2	600660	福耀玻璃	333,500	8,500,915.00	2.06
3	601398	工商银行	1,365,700	8,194,200.00	1.98
4	300365	恒华科技	195,790	7,336,251.30	1.77
5	601318	中国平安	132,500	7,176,200.00	1.74
6	002179	中航光电	190,991	7,104,865.20	1.72
7	603338	浙江鼎力	119,500	6,988,360.00	1.69
8	600033	福建高速	1,463,200	5,647,952.00	1.37
9	002555	三七互娱	195,600	4,361,880.00	1.05
10	600004	白云机场	310,545	4,065,034.05	0.98

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	21,528,002.00	5.21
	其中:政策性金融债	21,528,002.00	5.21
4	企业债券	160,711,501.37	38.86
5	企业短期融资券	120,196,000.00	29.07
6	中期票据	87,877,000.00	21.25
7	可转债(可交换债)	32,172,706.33	7.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	422,485,209.70	102.17

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	101574005	15沪世茂MTN002	300,000	30,153,000.00	7.29
2	011761044	17渝能源SCP001	300,000	30,033,000.00	7.26
3	011752056	17北部湾SCP001	300,000	30,012,000.00	7.26
4	112466	16彩虹01	300,000	29,070,000.00	7.03
5	1480021	14融强债01	300,000	25,092,000.00	6.07

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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	188,087.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,378,491.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,566,578.98

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	易方达裕鑫债券A	易方达裕鑫债券C
报告期期初基金份额总额	404,892,805.47	1,028,187.54
报告期基金总申购份额	17,656,777.23	102,109.06
减:报告期基金总赎回份额	20,034,705.80	121,952.35
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	402,514,876.90	1,008,344.25

§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
	1	2017年07月01日-2017年09月30日	200,008,000.00	-	-	200,008,000.00	49.57%
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裕鑫债券型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达裕鑫债券型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达裕鑫债券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

易方达科瑞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:交通银行股份有限公司
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。

基金托管人交通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	易方达科瑞混合
基金主代码	003293
交易代码	003293
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月3日
报告期末基金份额总额	1,077,856,654.38份
投资目标	本基金在控制风险的前提下,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。股票投资方面,本基金将根据对各行业的综合分析,确定并调整行业配置比例。在个股选择方面,本基金将精选具有持续竞争优势且估值具有吸引力的公司进行投资。在债券投资方面,本基金将主要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	沪深300指数收益率×80%+中债新综合财富指数收益率×20%
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	交通银行股份有限公司

§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	40,137,328.02
2.本期利润	60,903,838.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0523
4.期末基金资产净值	1,001,670,022.14
5.期末基金份额净值	0.9293

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

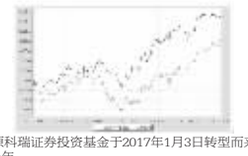
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.10%	0.52%	3.86%	0.47%	2.24%	0.05%

3.2.2自基金转型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

易方达科瑞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

(2017年1月3日至2017年9月30日)



注:1.本基金由原科瑞证券投资基金于2017年1月3日转型而来,截至报告期末,本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

3.自基金转型至报告期末,基金份额净值增长率为8.82%,同期业绩比较基准收益率为12.86%。

§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		
常远	本基金的基金经理、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、易方达国防军工混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新经路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2017-01-03	-	7年	博士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、投资经理、科瑞证券投资基金基金经理。
郑希	本基金的基金经理、易方达信息产业混合型证券投资基金的基金经理、易方达价值精选混合型证券投资基金的基金经理、投资一部副总经理	2017-01-03	-	11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、科瑞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A股市场整体呈现震荡上行且分化较大的行情。2017年前三季度,沪深300指数上涨15.90%,上证指数上涨7.90%,上证50上涨16.85%,中小板综指数上涨2.74%,创业板指数下跌4.85%。

分析原因,从国内流动性层面看,在宏观经济向好情况下,货币政策维持稳健中性,金融去杠杆对金融机构流动性形成一定影响,但对实体经济影响不明确;从实体经济运行层面看,宏观经济运行稳健,工业生产持续保持较高景气度,房地产库存去化理想且销售投资表现出色,因此2017年以来,以家电、白酒为龙头的消费白马股,钢铁和有色带领的周期行业及金融、地产、电子等板块都表现出色。2017年三季度,伴随企业业绩的持续超预期、新能源汽车配套产业的稳步发展以及对于宏观金融稳定性信心的增强,市场表现出强劲的向上动能,同时成交也趋于活跃。

本基金在2017年前三季度保持仓位稳定,一季度主要是以供给侧改革为主线进行配置;二季度以金融、白酒、医药等为核心仓位;三季度延续了二季度的风格,进一步加大了医药、保险的配置,也增加了电力设备、汽车等估值有一定吸引力的制造类板块,同时增加了化工等周期类板块的配置比例。

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0.9293元,本报告期份额净值增长率为6.10%,同期业绩比较基准收益率为3.86%。

§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	799,236,587.65	79.19
	其中:股票	799,236,587.65	79.19
2	固定收益投资	2,137,291.20	0.21
	其中:债券	2,137,291.20	0.21
	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	100,040,470.06	9.91
	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	106,995,011.64	10.60
7	其他资产	796,196.87	0.08
8	合计	1,009,205,557.42	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	3,380,000.00	0.34
B	采矿业	8,222,193.60	0.82
C	制造业	503,549,670.07	50.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,785,201.44	2.08
E	建筑业	9,998,026.50	1.00
F	批发和零售业	8,713,173.90	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	15,350,100.91	1.53
H	住宿和餐饮业	2,378,400.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,911,414.10	2.09
J	金融业	176,932,908.16	17.66
K	房地产业	6,265,000.00	0.63
L	租赁和商务服务业	12,567,811.48	1.25
M	科学研究和技术服务业	10,023,387.00	1.00
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	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	799,236,587.65	79.79

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	601318	中国平安	923,001	49,989,734.16	4.99
2	000661	长春高新	249,960	37,131,558.00	3.71
3	600036	招商银行	1,283,200	32,785,760.00	3.27
4	601601	中国太保	836,400	30,888,252.00	3.08
5	600196	复星医药	860,000	29,403,400.00	2.94
6	601688	华泰证券	1,220,000	27,596,400.00	2.76
7	600519	贵州茅台	45,100	23,345,564.00	2.33
8	000568	泸州老窖	422,499	23,222,201.58	2.32
9	002260	德奥通航	900,000	22,707,000.00	2.27
10	601799	星宇股份	410,000	20,430,300.00	2.04

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	2,137,291.20	0.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	2,137,291.20	0.21

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	010107	21国债(7)	20,960	2,137,291.20	0.21

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招商银行(代码:600036)为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。2017年3月29日,中国银监会针对招商银行批量转让个人贷款,处以人民币50万元的行政处罚。

华泰证券(代码:601688)为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。根据华泰证券股份有限公司董事会2016年11月29日发布的《关于收到中国证监会(行政处罚决定书)的公告》,因公司未按规定审查、了解客户真实身份等违法违规行为,被中国证监会予以行政处罚。

本基金投资招商银行、华泰证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除招商银行、华泰证券外,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本基金本报告期没有投资股票。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	427,231.26
2	应收证券清算款	221,769.85
3	应收股利	-
4	应收利息	128,131.97
5	应收申购款	19,063.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	796,196.87

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	002260	德奥通航	22,707,000.00	2.27	重大事项停牌
2	000568	泸州老窖	3,026,201.58	0.30	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	1,235,280,167.94
报告期基金总申购份额	1,988,045.77
减:报告期基金总赎回份额	159,411,559.33
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,077,856,654.38

§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	148,612,662.00
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	148,612,662.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	13.79

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.中国证监会准予科瑞证券投资基金变更注册的文件;

2.关于科瑞证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告;

3.《易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

4.《易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

6.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

易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金

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,