

3.报告期末按资产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	000061	格力电器	1,505,000	67,756,000.00	8.18
2	000028	深圳机场	1,100,000	47,384,000.00	5.77
3	002038	大华股份	1,319,410	35,711,002.10	4.38
4	601012	隆基股份	2,539,438	43,471,286.00	5.30
5	000858	五粮液	500,000	41,748,000.00	5.13
6	000068	泸州老窖	750,000	29,842,200.00	3.66
7	600036	招商银行	1,000,000	23,430,000.00	2.87
8	002138	顺络电子	1,100,000	20,438,000.00	2.51
9	002262	意华股份	2,212,462	10,344,516.00	1.27
10	300346	联得装备	1,241,420	17,470,210.00	2.13

4.报告期末按债券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	100964	10国债04	200,000	19,978,000.00	2.46

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	100964	10国债04	200,000	19,978,000.00	2.46

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。

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。

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。

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。

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。

11.投资组合报告附注

(1) 报告期内(代码:000008)为易方达行业领先企业混合型证券投资基金投资的前十大重仓证券之一。2017年12月,中国证监会对招商银行股份有限公司罚款,处以人民币60万元的行政处罚。

(2) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未发生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、处罚的情况。

(3) 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券名单。

(4) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	122,601.47
2	应收利息/股利	29,008,000.00
3	应收申购款	0.00
4	应收利息	382,816.14
5	应收申购款	2,011,978.61
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
8	其他	0.00
9	合计	22,562,586.31

(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) 报告期末持有的在资产负债表日有重要变动情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十三、业绩比较基准

基金管理人依据恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来(截至2017年6月30日)的投资业绩,也不能作为预期收益的参考依据。

本基金自发行之日起为90天的封闭期,基金合同生效后从2017年6月30日(即投资运作起始日)起同时基准的对比如下表所示:

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
基金合同生效至2016年12月31日	30.30%	1.50%	38.67%	1.57%	-2.37%	-0.07%
2016年1月1日至2016年12月31日	31.60%	1.48%	-10.18%	1.27%	21.78%	0.21%
2011年1月1日至2011年12月31日	-28.05%	1.26%	-19.51%	1.04%	-10.08%	0.21%
2012年1月1日至2012年12月31日	4.66%	1.22%	5.91%	1.02%	-1.26%	0.20%
2013年1月1日至2013年12月31日	28.11%	1.32%	-7.17%	1.12%	35.28%	0.20%
2014年1月1日至2014年12月31日	1.06%	1.17%	42.92%	0.97%	-41.76%	0.20%
2015年1月1日至2015年12月31日	68.26%	2.90%	5.37%	1.99%	62.89%	0.91%
2016年1月1日至2016年12月31日	-19.77%	1.92%	-8.30%	1.12%	-10.38%	0.80%
2017年1月1日至2017年6月30日	19.30%	0.73%	8.13%	0.46%	11.17%	0.27%
基金合同生效至2017年6月30日	13.56%	1.65%	42.26%	1.26%	83.20%	0.39%

十三、费用概览

(一)与基金运作相关的费用

1.基金管理人的费用

(1) 基金管理人的管理费;

(2) 基金托管人的托管费;

(3) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

(4) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;

(5) 基金份额持有人大会费用;

(6) 基金的证券交易费用;

(7) 基金的银行汇划费用;

(8) 按照国家有关规定从基金合同中约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金在清算时发生费用,按实际支出从基金财产总额中扣除。

2.基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日基金资产净值

管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理人划款指令,基金托管人复核无误于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

本基金基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的托管费

E为前一日基金资产净值

托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理人划款指令,基金托管人复核无误于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

上述1、基金费用的种类中(中)第(一)至(七)项费用,根据有关法规及相应协议规定,使用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3.不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

(1) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

(2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

(3) 基金合同生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等;

(4) 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4.基金费用的调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调低基金管理费、基金托管费等相关基金费用。

调整费率须经基金份额持有人大会审议通过,基金管理人应召开基金份额持有人大会,除非基金合同、相关法律法规或监管机构另有规定,调低基金管理费和基金托管费,无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须按照《信息披露办法》或其他相关法规在新的费率实施前至少提前30日指定媒体刊登和基金管理人网站公告。

(二)与基金销售有关费用

1.申购费

本基金对通过公司直销中心申购的特定投资群体(除此之外的其他投资者适用标准费率)实行申购费优惠。

特定投资群体指全体社会公众保险基金、依法设立的基本养老金保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及投资运作收益形成的企业补充养老保险基金(包括企业年金单一计划以及集合计划),以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可投资基金的住房公积金、商业养老保险的账户余额、养老等基金监管法规认可的养老基金品种,基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

通过基金管理人直销中心申购本基金的特定投资群体申购费率:

申购金额M(元)(含申购费)	申购费率
M<100元	0.15%
100元≤M<1000元	0.12%
1000元≤M<10000元	0.10%
M≥10000元	1000元/笔

其他投资者申购本基金的申购费率:

申购金额M(元)(含申购费)	申购费率
M<100元	1.5%
100元≤M<1000元	1.2%
1000元≤M<10000元	0.8%
M≥10000元	1000元/笔

在申购份额计算的情况下,如投资者存在多次申购,申购费用适用单笔申购金额所