（上接A22版）

联系人：牛亚楠
电话：010-65951887
客户服务电话：400-618-0707
网址：www.hxmgtianfund.com
(164) 弘业期货
注册地址：江苏省南京市秦淮区中华路50号弘业大厦9楼
办公地址：江苏省南京市秦淮区中华路50号弘业大厦9楼
法人代表：周剑秋
联系人：孙卿玨
电话：025-52278870
客户服务电话：400-828-1288
网址：www.ftol.com.cn
(165) 徽商期货
注册地址：合肥市芜湖路258号
办公地址：合肥市芜湖路258号
法人代表：吴国华
联系人：蔡芳、徐祥龙
电话：0551-62262801
客户服务电话：400-887-8707
网址：www.hsqh.net
(166) 汇成基金
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
联系人：熊小满
电话：01056251471
客户服务电话：4006199059
网址：www.hcjjin.com
(167) 汇付金融
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址：上海市徐汇区宜山路700号普天信息产业园2期C5栋 汇付天下总部大楼
法定代表人：金佶
联系人：张伟
电话：8621-54677088
传真：021-33323837
客户服务电话：400-820-2819
网址：www.chinapnr.com
(168) 济安财富
注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号 财富中心A座46层 济安财富
法定代表人：杨健
联系人：李海燕
电话：010-65309516
传真：010-65330699
客户服务电话：400-673-7010（济安财富官网） 400-071-6766（腾讯财经）
网址：www.jianfortune.com
(169) 金百临
注册地址：无锡市滨湖区锦溪路99号
办公地址：无锡市滨湖区锦溪路99号
法人代表：费晓燕
联系人：邹云
电话：0510-81188088
客户服务电话：0510-96889888
网址：www.jsjb.com
(170) 金观诚
注册地址：杭州拱墅区登云路45号金诚集团（锦昌大厦）1幢10楼1001室
办公地址：杭州拱墅区登云路45号金诚集团（锦昌大厦）
法定代表人：徐黎云
联系人：梁舒岚
电话：0571-88337888
传真：0571-88337666
客户服务电话：4006080068
网址：http://www.jincheng-fund.com/
(171) 久富财富
注册地址：上海市浦东新区梅园路2819号1幢109室
办公地址：上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
法定代表人：赵惠春
联系人：赵惠春
电话：021-68682279
传真：021-68682297
客户服务电话：400-102-1813
网址：www.jfcta.com
(172) 凯石财富
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：黄玮
电话：021-63333389
传真：021-63333390
客户服务电话：4006-433-389
网址：www.vstonewealth.com
(173) 肯特瑞
注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部A座
法定代表人：江卉
联系人：徐衍宇
电话：010 89189291
客户服务电话：95118
网址：http://fundjd.com/
(174) 利得基金
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区陆家嘴环路1217号1217号楼12楼
法定代表人：李兴春
联系人：陈孜明
电话：86-021-50583533
传真：86-021-60195218
客户服务电话：400-921-7755
网址：www.leadfund.com.cn
(175) 联泰资产
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法定代表人：燕斌
联系人：陈东
电话：021-52822063
传真：021-52975270
客户服务电话：400-166-6788
网址：www.66zichan.com
(176) 陆金所资管
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：胡学勤
联系人：叶博宇
电话：021-20685052
传真：021-22066653
客户服务电话：4008219031
网址：www.lufunds.com
(177) 恒越基金
注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区黄龙时代广场B座6楼
法定代表人：陈柏青
联系人：韩媛彬
联系电话：0571-28888888
客户服务电话：4000-766-123
网址：http://www.fund123.cn/
(178) 诺亚正行
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人：汪静波
联系人：张娟
电话：021-80359127
传真：021-33509777
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
(179) 钱景基金
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号丹棱SOHO大厦1幢9层1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号丹棱SOHO大厦1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
联系人：李超
电话：010-57418829
传真：010-57569671
客户服务电话：400-893-6885
网址：www.qianjingjj.com www.niujj.net
(180) 深圳新兰德
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：马勇
联系人：张燕
电话：010-83363099
传真：010-83363010
客户服务电话：400-166-1188
网址：http://rzrj.com.cn
(181) 晟视天下
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人：蒋尧
联系人：徐长征、周超
电话：010-58170943、010-58170953
传真：010-58170800
客户服务电话：4008188866
网址：www.shengshiview.com
(182) 苏宁基金
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法人代表：钱燕飞
联系人：王锋
电话：025-66996699-887226
客户服务电话：95177
网址：www.snjijin.com
(183) 天天基金
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人：其实
联系人：黄妙娟
联系电话：021-54509998
客户服务电话：95021
传真：021-54509953
网址：www.1234567.com.cn
(184) 同花顺
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼四层
法定代表人：凌顺平
联系人：吴强
联系电话：0571-88911818
客户服务电话：4008-773-772
传真：0571-86800423
网址：www.5ifund.com
(185) 途牛金服
注册地址：江苏省南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址：江苏省南京市玄武区玄武大道699-32号
法人代表：宋时琳
联系人：贺杰
电话：025-86853960-66727
客户服务电话：4007-999-999转3
网址：http://jr.tuniu.com
(186) 挖财基金
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：胡燕亮
联系人：樊晴晴
电话：021-50810687
客户服务电话：021-50810673
网址：www.wacai.jijin.com
(187) 万得基金
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区福山路33号9楼
法人代表：王廷富
联系人：徐亚丹
电话：021-50712782
客户服务电话：400-821-0203 网址：www.520fund.com.cn
(188) 万家财富
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海新商大厦2层2-2413室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人：李修辞
联系人：王芳芳
电话：010-59013828
客户服务电话：010-59013842
网址：http://www.wanjiawealth.com/
(189) 鑫鼎盛
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504
法定代表人：陈洪生
联系人：梁云波
电话：0592-3122757
传真：0592-3122701
客户服务电话：400-918-0808
网址：www.xdcz.com.cn
基金销售网站：www.dkhs.com
(190) 新浪仓石
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人：李明远
联系人：吴琴
客户服务电话：010-62675369
邮箱：fund@staff.sina.com.cn
网址：http://www.xincai.com/
(191) 阳光人寿保险
注册地址：海南省三亚市河东区三亚河东路海康商务12、13层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙12号1号楼昆泰国际大厦12层
法定代表人：李科
联系人：龙尧
电话：010-59054007
传真：010-59053700
客户服务电话：95510
网址：http://fundsinosig.com
(192) 一路财富
注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
法定代表人：吴雪秀
联系人：刘栋栋
电话：010-88312877
传真：010-88312099
客户服务电话：400-001-1566
网址：www.yilucaifu.com
(193) 宜投基金销售
注册地址：深圳市前海深港合作区前海一路鲤鱼门街1号前海深港合作区管理局综合办公楼A栋201室
办公地址：深圳市福田区嘉里建设广场3座3350室
法定代表人：郭海燕
联系人：刘娜
电话：0755-82724143
传真：0755-88601598
客户服务电话：4008-955-811
网址：www.yitifund.com
(194) 宜信普泽
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：戎辰
联系人：魏巍
电话：010-52413385
传真：010-85894285
客户服务电话：400-6099-200
网址：www.yixinfund.com
(195) 奕丰金融
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系人：叶建
电话：0755-89460507
传真：0755-21674453
客户服务电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
(196) 盈米财富
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
电话：020-89629019
传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn
(197) 耀财基金
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人：罗恒安
联系人：闫丽敏
电话：010-67000988
传真：010-67000988-6000
客户服务电话：400-001-8811
网址：www.zcvcc.com.cn
(198) 展恒基金
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安居街6号
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人：闫振杰
联系人：王琳
联系电话：010-62020088
客户服务电话：400-888-6661
传真：010-62020305
网址：www.myfund.com
(199) 朝阳永续
注册地址：浦东新区上丰路977号1幢B座812室
办公地址：上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼
法人代表：廖冰
联系人：陆纪青
电话：021-80234388-6813
客户服务电话：400-699-1888
网址：www.998fund.com
(200) 中国国际期货
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
法定代表人：王兵
联系人：孟夏
电话：021-80234388-6813
客户服务电话：400-699-1888
网址：www.998fund.com
(200) 中国国际期货
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢4层
法定代表人：姜新
联系人：尹庆
电话：010-65807865
传真：010-65807864
客户服务电话：95162
网址：www.ciccfund.com
(201) 中信建投期货
注册地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B、名义层11-A、8-B4、9-B、C
办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人：张文德
联系人：刘芸
电话：023-86769637
传真：023-86769629
客户服务电话：400-8877-780
网址：www.ctfutures.com
(202) 中信期货
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：刘宏莹
电话：010-6083 3754
传真：010-5776 2999
客户服务电话：400-990-8826
网址：http://www.citicsf.com/
(203) 中证达广
注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人：黄欣
联系人：戴晓微
电话：021-33768132
传真：021-33768132-802
客户服务电话：400-6767-523
网址：www.zzwealth.cn
(204) 中证金牛
注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人：钱昊旻
联系人：陈珍珍
电话：010-59336529
客户服务电话：4006-909-998
网址：www.jnlc.com
(207) 众禄金融
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客户服务电话：4006-788-887
网址：www.zhtuwang.com www.jjmmw.com
(208) 众升财富
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：李招弟
联系人：李艳
电话：010-59497361
传真：010-64788016
客服电话：400-876-9988
网址：www.zscffund.com
（二）基金注册登记机构
名称：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004—8室
办公地址：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
法定代表人：刘晓艳
电话：4008818088
传真：（020）38799249
联系人：余贤高
（三）律师事务所和经办律师
律师事务所：上海源泰律师事务所
地址：上海浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人：廖海
电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
经办律师：梁丽金、刘佳
联系人：廖海
（四）会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
主要经营场所：北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17 层01-12 室
执行事务合伙人：Tony Mao 毛毅宁
电话：(010) 58153000
传真：(010) 85188298
经办注册会计师：赵雅、李明明
联系人：赵雅
四、基金的名称
易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
本基金为指数增强型股票基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
七、基金的投资内容
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类品种，股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。
本基金根据相关法律法规或中国证监会要求履行相关手续后，还可以投资于法律法规或中国证监会未来允许基金投资的其它金融工具。
本基金的投资组合比例为：
股票投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产的5%。
若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。
八、基金的投资策略
本基金以指数化投资为主、增强型投资为辅，在复制标的指数基础上在一定范围调整个股权重，力求在控制与标的指数偏离风险前提下超越指数。
1.资产配置策略
本基金追求基金资产在股票市场上的充分投资，股票投资比例不低于基金资产净值的90%。
2.股票投资策略
本基金属指数增强型基金，策略上以指数化投资为主、增强型投资为辅。
本基金主要策略为复制标的指数，投资组合将以标的指数的构成为基础，主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。
基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果，结合基金管理人的长期研究与实践应用，利用多维子量化模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。
（1）多因子量化模型——权益超额回报预测
多因子量化模型以对中国股票市场的长期研究为基础，一定程度上结合前瞻性市场判断，运用经长期检验有效的多个因子捕捉市场机会，预测个股的超额收益。概括来讲，本基金的多因子量化模型的因子可归为如下几类：估值（valuation）、成长（growth）、技术（technical）、情绪（sentiment）、质量（quality）等。
多因子量化模型利用基金管理人内部及外部数据库，综合了来自市场投资者、公司财务报表、证券分析师、政经政策等各方面的大量信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出分析判断，通过调整各因子类别的具体组成及权重。
（2）风险估测模型——有效控制风险预算
指数化投资方式要跟踪误差最小，增强型投资则需要受风险预算的约束。风险预算即最大容忍跟踪误差。本基金将结合市场通用及自主研发的风险估测模型，将投资组合风险控制在预算范围内。本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估，以控制投资组合相对于标的指数的偏离风险。
本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过 7%。
（3）交易成本模型——控制成本并保护业绩
本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，以控制交易成本，减少交易对业绩带来的负面影响。
（4）投资组合优化模型
本基金将综合考虑预期回报、风险及交易成本进行投资组合优化。选股范围以成分股为主，也包括非成分股中与成分股相关性强、流动性好、基本面信息充足的股票。
9、其它投资策略
本基金将审慎投资于法律法规允许及中国证监会批准的其它金融工具，以降低基金资产的风险并提高基金的收益。
九、基金的业绩比较基准
沪深300指数收益率*95%+活期存款利率（税后）*5%
十、基金的风险收益特征
本基金属股票型基金中的指数增强型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
十一、基金的投资组合报告（未经审计）
本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。
本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的规定，复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载，误导性陈述或者重大遗漏。
本报告组合报告有关数据的期间为2017年7月1日至2017年9月30日。
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	1,004,368,900.91	92.88
	其中：股票	1,004,368,900.91	92.88
2	固定收益投资	4,449,000.60	0.41
	其中：债券	4,449,000.60	0.41
	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	69,727,727.85	6.45
7	其他资产	2,829,239.67	0.26
8	合计	1,081,374,869.03	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合
（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合
1）积极投资按行业分类的股票投资组合

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	64,741,185.66	6.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,573,772.44	0.33
E	建筑业	9,013,468.00	0.84
F	批发和零售业	27,702,162.05	2.57
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	23,791,814.03	2.21
J	金融业	17,693,984.00	1.64
K	房地产业	21,087,127.62	1.96
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.01
M	科学研究和技术服务业	43,651.27	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	115,298.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	167,951,815.79	15.58

2）指数投资按行业分类的股票投资组合

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	44,162,482.00	4.10
C	制造业	324,223,640.92	30.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,412,728.72	2.36
E	建筑业	61,986,561.00	5.75
F	批发和零售业	7,192,539.00	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	33,108,913.50	3.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,154,600.60	1.59
J	金融业	282,771,211.38	26.23
K	房地产业	15,254,064.00	1.42
L	租赁和商务服务业	25,200,354.00	2.34
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	836,417,085.12	77.59

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
（1）期末指数投资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	1,460,922	79,123,525.52	7.34
2	600519	贵州茅台	97,020	50,221,432.80	4.66
3	000725	京东方A	8,650,700	38,063,080.00	3.53
4	601169	北京银行	4,650,800	34,694,968.00	3.22
5	601988	中国银行	8,075,400	33,270,648.00	3.09
6	601390	中国中铁	3,501,800	30,290,570.00	2.81
7	600690	青岛海尔	1,997,000	30,134,730.00	2.80
8	601006	大秦铁路	3,363,074	29,426,897.50	2.73
9	000338	潍柴动力	3,721,100	27,871,039.00	2.59
10	601088	中国神华	1,298,300	27,186,402.00	2.52

（2）期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600859	王府井	1,127,000	20,238,600.00	1.88
2	600291	西水股份	662,200	17,693,984.00	1.64
3	002601	龙蟒佰利	907,400	16,868,566.00	1.56
4	600638	新黄浦	891,166	16,103,369.62	1.49
5	002254	天神娱乐	705,600	14,168,448.00	1.31

4、报告期末投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	-	-
	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）	4,449,000.60	0.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,449,000.60	0.41

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	113011	光大转债	39,930	4,449,000.60	0.41

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）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。
（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。
（3）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	92,760.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,522,556.62
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,625,816.99

（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	4,466,685.80	0.68

（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	601717	郑煤机	5,425,000.00	0.83	重大事项停牌

十二、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，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。
基金合同生效日为2012年7月5日，基金合同生效以来（截至2017年6月30日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

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)
基金合同生效至2012年12月31日	11.30%	0.69%	2.07%	1.00%	9.23%	-0.31%
2013年1月1日至2013年12月31日	-3.71%	1.31%	-7.07%	1.24%	3.36%	0.07%
2014年1月1日至2014年12月31日	56.94%	1.12%	48.69%	1.15%	7.25%	-0.03%
2015年1月1日至2015年12月31日	12.67%	2.45%	5.70%	2.36%	6.97%	0.09%
2016年1月1日至2016年12月31日	-1.82%	1.38%	-10.63%	1.33%	8.81%	0.05%
2017年1月1日至2017年6月30日	13.55%	0.57%	10.23%	0.54%	3.32%	0.03%
基金合同生效至2017年6月30日	109.92%	1.50%	46.87%	1.47%	63.05%	0.03%

注：1.根据中国证监会2013年4月7日下发的《关于规准易方达量化行情股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监许可[2013]742号），易方达量化行情股票型证券投资基金自2013年6月7日起变更为易方达沪深300量化增强证券投资基金，修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。修订后的《易方达沪深300量化增强证券投资基金基金合同》于2013年6月7日生效。
2.根据《易方达沪深300 量化增强证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自2013年6月7日起，由“沪深300指数收益率×80%+活期存款利率（税后）×20%”变更为“沪深300指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%”；基金业绩比较基准收益率在变更前后分别根据相应的指标计算。
十三、费用概览
（一）与基金运作相关的费用
1、基金费用的种类
（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）基金合同生效后的标的指数许可使用费；
（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
（5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
（6）基金的维持有人大会费用；
（7）基金的证券交易费用；
（8）基金的银行汇划费用；
（9）证券账户开户费用、银行账户维护费用；
（10）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
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0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×0.8%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。
（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.15%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。
（3）标的指数许可使用费
基金合同生效后的标的指数许可使用费按照基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中向中证指数有限公司支付。标的指数使用费按前一日基金资产净值的0.016%的年费率计提。标的指数许可使用费每日计算，逐日累计。
计算方法如下：
H＝E × 0.016 % / 当年天数
H为每日应付的标的指数许可使用费，E为前一日的基金资产净值。
标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币伍万元（50,000），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。
中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计算方法的，本基金按照变更后的费率计提标的指数许可使用费，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计算方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
如果中证指数有限公司根据相应指数使用许可协议的约定要求变更标的指数许可使用费费率和计算方法，应按照变更后的标的指数许可使用费从基金财产中支付给指数许可方。此项变更无需召开基金份额持有人大会。
上述“1、基金费用的种类中第（4）-（9）项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费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
（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；
（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。
（二）与基金销售有关的费用
1、申购费
（1）申购费率：
本基金对通过本公司直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。
特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划等集团的资金及其投资运营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，如按规出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。
通过基金管理人的直销中心申购本基金的特定投资群体申购费率为：

申购金额M（元）（含申购费）	申购费率
M＜100万	0.15%
100万≤M＜500万	0.12%
500万≤M＜1000万	0.03%
M≥1000万	1000元/笔

其他投资者申购本基金的申购费率为：

申购金额M（元）（含申购费）	申购费率
M＜100万	1.5%
100万≤M＜500万	1.2%
500万≤M＜1000万	0.3%
M≥1000万	1000元/笔

（2）申购费的收取方式和用途
在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。
本基金的申购费按投入项目，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不计入基金财产
（3）申购份额的计算
本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：
净申购金额=申购金额/（1+申购费率）
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T日A类基金份额净值
2）若投资人选择C类基金份额，则申购份额的计算公式如下：
申购份额=申购金额/T日C类基金份额净值
申购净及金额、份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
2、赎回费
（1）赎回费率：
1）本基金A类份额赎回费率见下表：

持有时间（天）	A类份额赎回费率
0-6	1.5%
7-29	0.75%
30-89	0.5%
90-179	0.5%
180及以上	0

2）本基金C类基金份额赎回费率见下表：

持有时间(天)	C类份额赎回费率
0-29	0.5%
30及以上	0%

（2）赎回费的收取和用途
赎回费用由赎回基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持有期少于30天（不含）的A类基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产；对持有期在30天以上（含）且少于90天（不含）的A类基金份额持有人所收取赎回费用总额的75%计入基金财产；对持有期在90天以上（含）且少于180天（不含）的A类基金份额持有人所收取赎回费用总额的50%计入基金财产；对持有期在180天以上（含）且少于180天（不含）的A类基金份额持有人所收取赎回费用全额计入基金财产。
（3）基金赎回金额的计算方式
赎回金额的计算方法如下：
赎回费用=