

易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年七月二十一日

基金管理人及基金托管人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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2017年7月18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。

本报告中所列财务数据未经审计。
本报告日期为2017年6月30日止。

5.1 重要提示

基金名称	易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	001417
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年4月23日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金注册登记机构	易方达基金管理有限公司
基金销售机构	易方达基金管理有限公司、各代销机构
基金管理人地址	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路10号18楼1801-1802室
基金管理人客服电话	4008808808
基金管理人网址	www.efund.com.cn

5.2 基金产品概况

基金名称	易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	001417
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年4月23日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
基金注册登记机构	易方达基金管理有限公司
基金销售机构	易方达基金管理有限公司、各代销机构
基金管理人地址	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路10号18楼1801-1802室
基金管理人客服电话	4008808808
基金管理人网址	www.efund.com.cn

5.3 主要财务指标和净值表现

报告期	2017年1-6月	2017年1-6月	2017年1-6月
1.本报告期基金份额净值增长率	5.32%	1.32%	1.32%
2.本报告期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	1.32%	0.00%	0.00%
3.本报告期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	1.32%	0.00%	0.00%

5.4 管理人报告

截至报告期末,本基金8只基金份额净值为1.332元,本报告期份额净值增长率为-5.73%,E类基金份额净值为1.096元,本报告期份额净值增长率为-5.76%,同期业绩比较基准收益率为-0.88%。

5.5 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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	107,788,453.11	87.32
2	固定收益投资	1,027,263.12	0.83
3	货币资金	14,214,382.77	11.53
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	1,027,263.12	0.83
6	其他资产	-	-
7	其他负债	-	-
8	资产减值准备	-	-
9	公允价值变动损益	1,027,263.12	0.83
10	未实现损益	-	-
11	其他	-	-

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-
B 制造业	107,788,453.11	87.32
C 建筑业	-	-
D 批发和零售业	-	-
E 交通运输、仓储和邮政业	-	-
F 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
G 金融业	-	-
H 房地产业	-	-
I 租赁和商务服务业	-	-
J 科学研究和技术服务业	-	-
K 采矿业	-	-
L 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
M 水利、环境和公共设施管理业	-	-
N 卫生和社会工作	-	-
O 教育	-	-
P 文化、体育和娱乐业	-	-
Q 综合	-	-

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10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	000001	平安银行	899,000	13,482,450.00	10.11
2	000002	万科A	300,000	10,200,000.00	7.74
3	000004	比亚迪	400,000	8,000,000.00	6.11
4	000025	海信电器	100,000	2,000,000.00	1.51
5	000033	荣信股份	200,000	4,000,000.00	3.04
6	000024	招商局A	200,000	4,000,000.00	3.04
7	000003	招商银行	100,000	2,000,000.00	1.51
8	000012	南钢特钢	100,000	2,000,000.00	1.51
9	000010	深赛格	100,000	2,000,000.00	1.51
10	000018	华联控股	100,000	2,000,000.00	1.51

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160000	16国债01	100,000	1,000,000.00	0.76
2	160001	16国债02	100,000	1,000,000.00	0.76
3	160002	16国债03	100,000	1,000,000.00	0.76
4	160003	16国债04	100,000	1,000,000.00	0.76
5	160004	16国债05	100,000	1,000,000.00	0.76
6	160005	16国债06	100,000	1,000,000.00	0.76
7	160006	16国债07	100,000	1,000,000.00	0.76
8	160007	16国债08	100,000	1,000,000.00	0.76
9	160008	16国债09	100,000	1,000,000.00	0.76
10	160009	16国债10	100,000	1,000,000.00	0.76

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5名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	100,000	1,000,000.00	0.76
2	999999	白银	100,000	1,000,000.00	0.76
3	999999	铂金	100,000	1,000,000.00	0.76
4	999999	钯金	100,000	1,000,000.00	0.76
5	999999	铑金	100,000	1,000,000.00	0.76

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5名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	100,000	1,000,000.00	0.76
2	000002	万科A	100,000	1,000,000.00	0.76
3	000003	招商银行	100,000	1,000,000.00	0.76
4	000004	比亚迪	100,000	1,000,000.00	0.76
5	000005	海信电器	100,000	1,000,000.00	0.76

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5名股指期货投资明细

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1706	100,000	1,000,000.00	0.76
2	IF1707	100,000	1,000,000.00	0.76
3	IF1708	100,000	1,000,000.00	0.76
4	IF1709	100,000	1,000,000.00	0.76
5	IF1710	100,000	1,000,000.00	0.76

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5名国债期货投资明细

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1706	100,000	1,000,000.00	0.76
2	TF1707	100,000	1,000,000.00	0.76
3	TF1708	100,000	1,000,000.00	0.76
4	TF1709	100,000	1,000,000.00	0.76
5	TF1710	100,000	1,000,000.00	0.76

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	平安银行	100,000	1,000,000.00	0.76
2	万科A	100,000	1,000,000.00	0.76
3	招商银行	100,000	1,000,000.00	0.76
4	比亚迪	100,000	1,000,000.00	0.76
5	海信电器	100,000	1,000,000.00	0.76

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	100,000	1,000,000.00	0.76
2	000002	万科A	100,000	1,000,000.00	0.76
3	000003	招商银行	100,000	1,000,000.00	0.76
4	000004	比亚迪	100,000	1,000,000.00	0.76
5	000005	海信电器	100,000	1,000,000.00	0.76

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	100,000	1,000,000.00	0.76
2	999999	白银	100,000	1,000,000.00	0.76
3	999999	铂金	100,000	1,000,000.00	0.76
4	999999	钯金	100,000	1,000,000.00	0.76
5	999999	铑金	100,000	1,000,000.00	0.76

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股指期货投资明细

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1706	100,000	1,000,000.00	0.76
2	IF1707	100,000	1,000,000.00	0.76
3	IF1708	100,000	1,000,000.00	0.76
4	IF1709	100,000	1,000,000.00	0.76
5	IF1710	100,000	1,000,000.00	0.76

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名国债期货投资明细

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1706	100,000	1,000,000.00	0.76
2	TF1707	100,000	1,000,000.00	0.76
3	TF1708	100,000	1,000,000.00	0.76
4	TF1709	100,000	1,000,000.00	0.76
5	TF1710	100,000	1,000,000.00	0.76

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	平安银行	100,000	1,000,000.00	0.76
2	万科A	100,000	1,000,000.00	0.76
3	招商银行	100,000	1,000,000.00	0.76
4	比亚迪	100,000	1,000,000.00	0.76
5	海信电器	100,000	1,000,000.00	0.76

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	100,000	1,000,000.00	0.76
2	000002	万科A	100,000	1,000,000.00	0.76
3	000003	招商银行	100,000	1,000,000.00	0.76
4	000004	比亚迪	100,000	1,000,000.00	0.76
5	000005	海信电器	100,000	1,000,000.00	0.76

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	100,000	1,000,000.00	0.76
2	999999	白银	100,000	1,000,000.00	0.76
3	999999	铂金	100,000	1,000,000.00	0.76
4	999999	钯金	100,000	1,000,000.00	0.76
5	999999	铑金	100,000	1,000,000.00	0.76

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股指期货投资明细

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1706	100,000	1,000,000.00	0.76
2	IF1707	100,000	1,000,000.00	0.76
3	IF1708	100,000	1,000,000.00	0.76
4	IF1709	100,000	1,000,000.00	0.76
5	IF1710	100,000	1,000,000.00	0.76

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名国债期货投资明细

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1706	100,000	1,000,000.00	0.76
2	TF1707	100,000	1,000,000.00	0.76
3	TF1708	100,000	1,000,000.00	0.76
4	TF1709	100,000	1,000,000.00	0.76
5	TF1710	100,000	1,000,000.00	0.76

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	平安银行	100,000	1,000,000.00	0.76
2	万科A	100,000	1,000,000.00	0.76
3	招商银行	100,000	1,000,000.00	0.76
4	比亚迪	100,000	1,000,000.00	0.76
5	海信电器	100,000	1,000,000.00	0.76

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	100,000	1,000,000.00	0.76
2	000002	万科A	100,000	1,000,000.00	0.76
3	000003	招商银行	100,000	1,000,000.00	0.76
4	000004	比亚迪	100,000	1,000,000.00	0.76
5	000005	海信电器	100,000	1,000,000.00	0.76

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	100,000	1,000,000.00	0.76
2	999999	白银	100,000	1,000,000.00	0.76
3	999999	铂金	100,000	1,000,000.00	0.76
4	999999	钯金	100,000	1,000,000.00	0.76
5	999999	铑金	100,000	1,000,000.00	0.76

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名股指期货投资明细

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1706	100,000	1,000,000.00	0.76
2	IF1707	100,000	1,000,000.00	0.76
3	IF1708	100,000	1,000,000.00	0.76
4	IF1709	100,000	1,000,000.00	0.76
5	IF1710	100,000	1,000,000.00	0.76

5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名国债期货投资明细

序号	合约名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1706	100,000	1,000,000.00	0.76
2	TF1707	100,000	1,000,000.00	0.76
3	TF1708	100,000	1,000,000.00	0.76
4	TF1709	100,000	1,000,000.00	0.76
5	TF1710	100,000	1,000,000.00	0.76

5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前5名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	平安银行	100,000	1,000,000.00	0.76
2	万科A	100,000	1,000,000.00	0.76
3	招商银行	100,000	1,000,000.00	0.76
4	比亚迪	100,000	1,00	