

易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金

易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

2019 第二季度 报告

2019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：中国工商银行股份有限公司

基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述，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。基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述，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。基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述，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。

1.1 重要提示
 基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述，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。基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述，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。基金管理人及基金托管人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述，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。

1.2 基金概况
 基金名称：易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金
 基金代码：001817
 基金运作方式：契约型开放式
 基金合同生效日：2017年6月21日
 报告期末基金份额总额：304,096,796.621份

1.3 主要财务指标

主要财务指标	本报告期	本报告期末至本报告期初	本报告期初至本报告期末
1.本期基金份额净值增长率	1.96%	1.96%	34.97%
2.本期基金份额净值增长率标准差	0.92%	0.92%	-0.53%
3.加权平均基金份额本期收益率	6.08%	6.08%	-0.05%
4.期末基金份额净值	1.048	1.048	1.048

1.4 基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*70%+中证500指数收益率*30%

1.5 投资组合报告

1.5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	71,192,807.04	18.63
2	固定收益投资	21,792,871.84	5.48
3	货币资金	302,661,185.69	79.21
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	其他	-	-

1.5.2 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)	占基金资产净值的比例(%)
A. 农林牧渔	9,258,461.37	2.34
B. 医药	21,467,845.45	5.40
C. 制造业	4,021,171.60	1.01
D. 电力、热力、燃气及生产和服务业	2,972,254.15	0.76
E. 信息技术	3,824,553.97	1.58
F. 其他	306,122,690.65	79.69

1.5.3 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)	占基金资产净值的比例(%)
1	601985	工商银行	522,180	3,075,240.00	0.96
2	600088	中顺洁柔	955,800	3,074,520.00	0.96
3	600008	中信证券	149,964	3,056,267.32	0.96
4	600066	兴业银行	73,500	3,026,250.00	0.95
5	600051	格力电器	179,000	3,023,000.00	0.95
6	600045	宇通客车	252,500	3,021,150.00	0.95
7	600030	中信证券	253,300	3,021,000.00	0.95
8	600019	建设银行	405,900	3,019,600.00	0.95
9	601288	农业银行	808,700	3,019,100.00	0.95
10	600008	中信证券	256,500	3,017,500.00	0.95

1.5.4 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)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.5 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资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.7 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.8 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.23 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	190004	19国债04	20,000	20,000.00	0.01
4	190003	19国债03	20,000	20,000.00	0.01
5	190002	19国债02	20,000	20,000.00	0.01

1.5.24 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	190007	19国债07	20,000	20,000.00	0.01
2	190005	19国债05	20,000	20,000.00	0.01
3	19				