

# 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

(原科瑞证券投资基金转型)

2017 年半年度报告摘要

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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十九日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

自 2017 年 1 月 3 日科瑞证券投资基金终止上市日起，原科瑞证券投资基金转型为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金。原科瑞证券投资基金本报告期自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 2 日止，易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金本报告期自 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

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
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
报告期末基金份额总额	1,235,280,167.94 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.2 科瑞证券投资基金

基金简称	易方达科瑞封闭
基金主代码	500056
交易代码	500056
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002 年 3 月 12 日
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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份
基金合同存续期	2002 年 3 月 12 日至 2017 年 1 月 2 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2002 年 3 月 20 日

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

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。

### 2.2.2 科瑞证券投资基金

投资目标	主要投资于价值被市场绝对或相对低估的股票。本基金的投资目标是在控制股票投资组合的风险的前提下, 追求基金资产的长期稳定的增值。
投资策略	基金管理人在对宏观经济和 market 发展趋势进行深入分析的基础上, 进行资产在股票、债券和现金间的资产配置。当判断股票市场趋势向好时, 基金管理人采取积极进取的投资方式, 加大股票投资比例, 降低债券投资、现金的比例, 力求取得较好的资本增值收益; 当预测股票市场走势趋淡时, 则降低股票投资比例, 加大债券投资和现金比例, 避免股票市场大幅下挫时引起的资产损失。基金管理人主要选择公司价值被市场相对和绝对低估的股票构建投资组合。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	陆志俊
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-85104666	021-62701216

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互 联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
--------------------------	---

基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼
-------------	--------------------------------

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 6 月 30 日	报告期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 2 日
本期已实现收益	-28,592,765.16	-14,444.32
本期利润	32,012,156.95	-14,444.32
加权平均基金份额本期利润	0.0177	0.0000
本期基金份额净值增长率	2.56%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	报告期末(2017 年 1 月 2 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1431	-0.1460
期末基金资产净值	1,082,005,340.31	2,562,067,650.06
期末基金份额净值	0.8759	0.8540

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人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.自 2017 年 1 月 3 日科瑞证券投资基金终止上市之日起，原科瑞证券投资基金转型为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

##### 3.2.1.1 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	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④
----	--------------	----------------	----------------	----------------	-----	-----

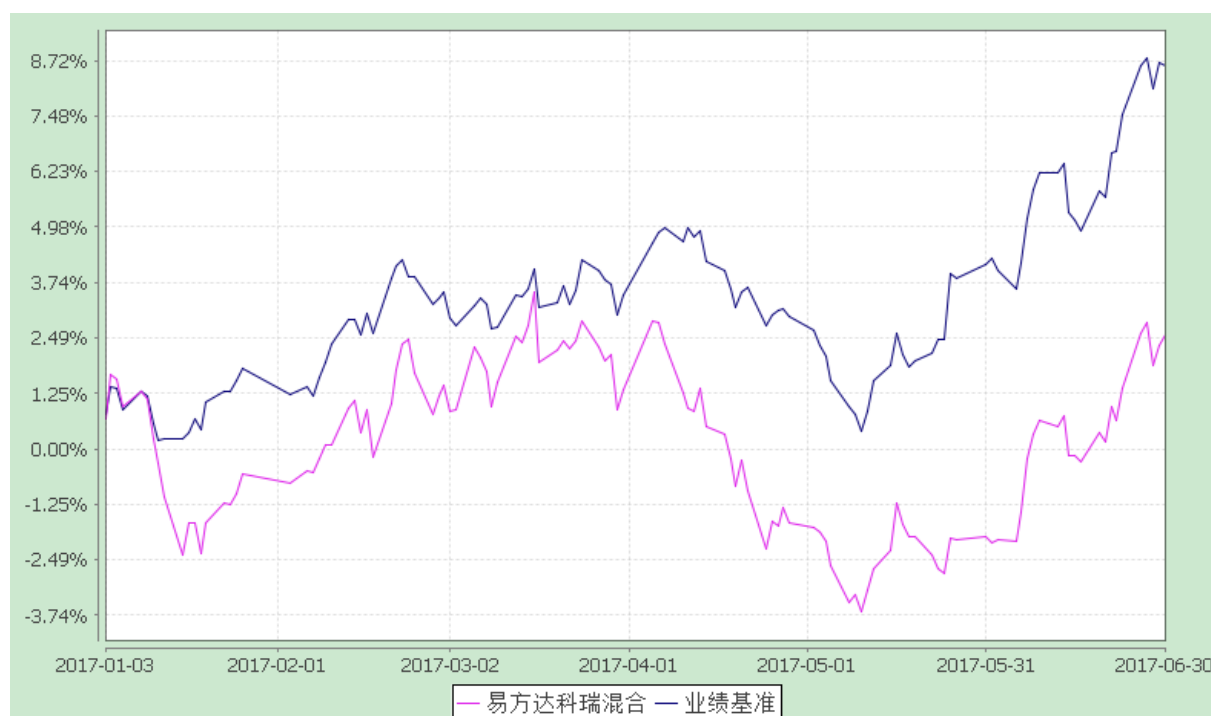
		②		准差④		
过去一个月	4.64%	0.56%	4.23%	0.54%	0.41%	0.02%
过去三个月	1.23%	0.59%	4.92%	0.50%	-3.69%	0.09%
过去六个月	2.56%	0.61%	8.60%	0.46%	-6.04%	0.15%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.56%	0.61%	8.60%	0.46%	-6.04%	0.15%

### 3.2.1.2 自基金转型以来基金份额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

份额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

(至 2017 年 6 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，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（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。本报告期末本基金处于建仓期内。

3.自基金转型至报告期末，基金份额净值增长率为 2.56%，同期业绩比较基准收益率为 8.60%。

## 3.2.2 科瑞证券投资基金

### 3.2.2.1 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

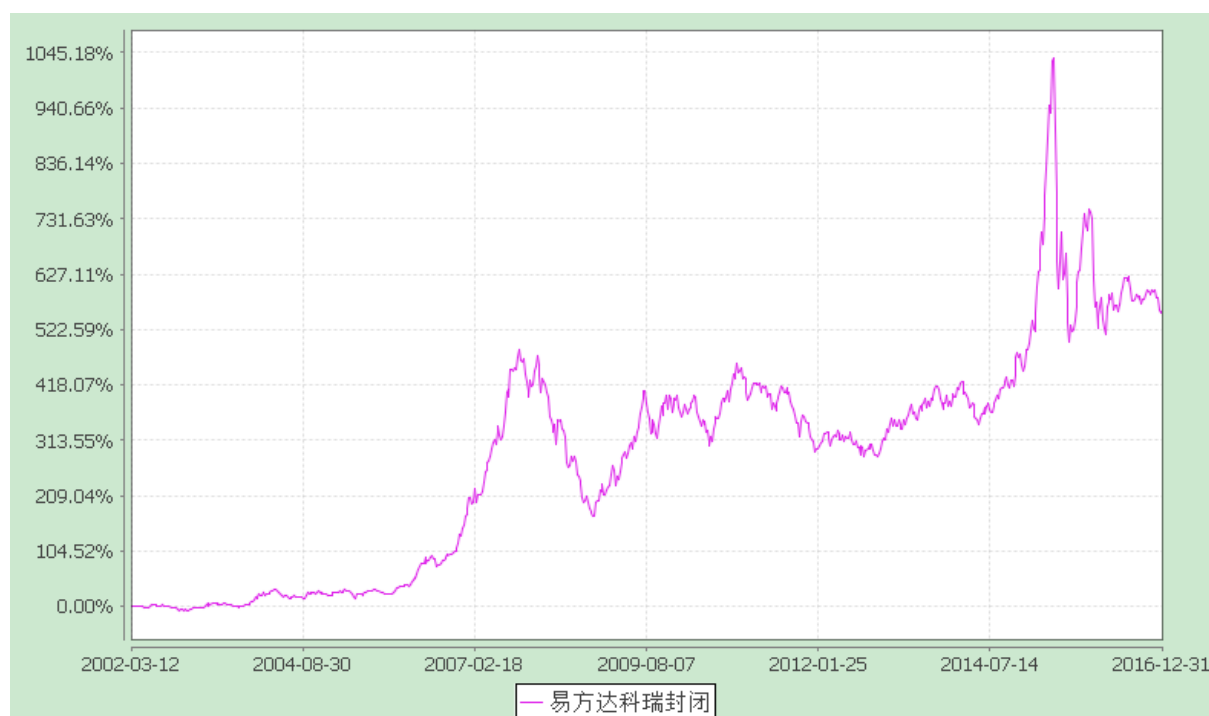
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.90%	1.43%	-	-	-	-
过去三个月	-3.49%	1.39%	-	-	-	-
过去六个月	-8.80%	1.39%	-	-	-	-
过去一年	-21.22%	3.30%	-	-	-	-
过去三年	32.59%	3.90%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	556.23%	3.03%	-	-	-	-

### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

#### 科瑞证券投资基金

#### 份额累计净值增长率历史走势图

(2002 年 3 月 12 日至 2017 年 1 月 2 日)



注：1.本基金基金合同未规定业绩比较基准。

2.自基金合同生效至 2017 年 1 月 2 日，基金份额净值增长率为 556.23%。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于2001年4月17日，旗下设有北京、广州、上海、成都、大连等分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持在“诚信规范”的前提下，通过“专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004年10月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005年8月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007年12月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008年2月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。2012年10月，易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016年12月，易方达获得基本养老保险基金证券投资管理机构资格。截至2017年6月30日，易方达的总资产管理规模达到11000亿元，其中公募基金管理规模4842亿元。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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、科瑞证券投资基金的基金经理（自2016年01月23日至2017年01月02日）、易方达国防军工混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新丝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。
郑希	本基金的基金	2017-01-0	-	11年	硕士研究生，曾任易方达基金管



	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、科瑞证券投资基金的基金经理（自 2012 年 09 月 28 日至 2017 年 01 月 02 日）、投资一部副总经理	3			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。
杨嘉文	本基金的基金经理助理	2017-05-11	-	6 年	硕士研究生，曾任大成基金管理有限公司研究部研究员，易方达基金管理有限公司研究部研究员。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，郑希、常远的“任职日期”为基金合同生效之日，杨嘉文的“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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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。本基金管理人规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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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%的交易共有 16 次,其中 14 次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;2 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年 A 股市场整体呈现震荡上行且分化较大的行情,沪深 300 指数上涨 10.78%,上证指数上涨 2.86%,上证 50 上涨 11.50%,中小盘指数下跌 3.04%,创业板指数下跌 7.34%。

分析其中原因,从宏观经济层面看,上半年全球股市表现较好,全球经济均处于复苏之中,美国上半年加息两次,此前全球流动性持续宽松的进程逐步缩减;国内流动性层面看,由于上半年美元指数下降较多,人民币的贬值压力不明显,资金外流基本稳定,宏观经济向好情况下,货币政策维持稳健中性,二季度后,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、销售投资表现出色,整体看上半年周期品和消费品盈利情况出色。

本基金在 2017 年上半年保持仓位稳定,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,也配置了电力设备、汽车等估值有一定吸引力的制造类板块,同时适当配置了消费电子、新能源汽车等新兴成长类的板块。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年 6 月 30 日,易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 0.8759 元,本报告期(2017 年 1 月 3 日—2017 年 6 月 30 日)份额净值增长率为 2.56%,同期业绩比较基准收益率为 8.60%。

2017 年 1 月 2 日,原科瑞证券投资基金份额净值为 0.8540 元,本报告期(2017 年 1 月 1 日—2017 年 1 月 2 日)份额净值增长率为 0.00%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年下半年,资本市场增量资金不明显,同时大小非减持也得到一定抑制的情况下,预计整体市场还是存量博弈,但是目前创业板估值仍偏高,主板性价比也降低,下半年投资仍需关注业绩优良的公司。

基于以上判断,本基金在 2017 年三季度将保持现有仓位,并延续二季度的思路,增加业绩稳定和估值有吸引力板块(比如白酒、金融、医药)的配置比例,整体立足中长期盈利下成长性和稳定

性的原则构建组合，维持以竞争优势明显、估值合理的稳定成长公司为核心持仓结构，保持组合的流动性和稳定性，并适当增加成长类个股的配置比例。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司常务副总裁担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金：本基金本报告期内未实施利润分配。

原科瑞证券投资基金：本基金本报告期内未实施利润分配。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，基金托管人在科瑞证券投资基金和易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，易方达基金管理有限公司在科瑞证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，在易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内科瑞证券投资基金和易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金均未进行收益分配，

符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关科瑞证券投资基金和易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

#### 6.1.1 资产负债表

会计主体：易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年6月30日
资产：	-
银行存款	116,871,391.28
结算备付金	2,853,071.46
存出保证金	707,876.47
交易性金融资产	847,647,159.45
其中：股票投资	845,497,501.85
基金投资	-
债券投资	2,149,657.60
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	134,600,601.90
应收证券清算款	271,745.19
应收利息	151,871.16
应收股利	-

应收申购款	2,047.00
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>1,103,105,763.91</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>
负 债:	-
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	4,191,460.21
应付赎回款	11,335,891.32
应付管理人报酬	1,357,459.12
应付托管费	226,243.18
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,204,610.86
应交税费	1,307,938.86
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	476,820.05
<b>负债合计</b>	<b>21,100,423.60</b>
<b>所有者权益:</b>	<b>-</b>
实收基金	1,235,280,167.94
未分配利润	-153,274,827.63
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,082,005,340.31</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,103,105,763.91</b>

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，2017 年半年度实际报告期间为 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财

务报表及报表附注均无同期对比数据。

2. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日, 基金份额净值 0.8759 元, 基金份额总额 1,235,280,167.94 份。

### 6.1.2 利润表

会计主体: 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 3 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>54,665,940.91</b>
1.利息收入	5,140,518.65
其中: 存款利息收入	806,772.79
债券利息收入	1,655,759.16
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	2,677,986.70
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-16,453,393.87
其中: 股票投资收益	-17,553,289.80
基金投资收益	-
债券投资收益	-5,102,664.56
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	6,202,560.49
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	60,604,922.11
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	5,373,894.02
<b>减: 二、费用</b>	<b>22,653,783.96</b>
1. 管理人报酬	11,535,217.63
2. 托管费	1,922,536.17

3. 销售服务费	-
4. 交易费用	8,979,091.31
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	216,938.85
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>32,012,156.95</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>32,012,156.95</b>

注：本基金由原科瑞证券投资基金于2017年1月3日转型而来，2017年半年度实际报告期间为2017年1月3日至2017年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月3日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017年1月3日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-437,932,349.94	2,562,067,650.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,012,156.95	32,012,156.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,764,719,832.06	252,645,365.36	-1,512,074,466.70
其中：1.基金申购款	6,081,683.04	-850,639.58	5,231,043.46
2.基金赎回款	-1,770,801,515.10	253,496,004.94	-1,517,305,510.16

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,235,280,167.94	-153,274,827.63	1,082,005,340.31

注：本基金由原科瑞证券投资基金于 2017 年 1 月 3 日转型而来，2017 年半年度实际报告期间为 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

#### 6.1.4 报表附注

##### 6.1.4.1 基金基本情况

易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由科瑞证券投资基金转型而来。根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1917 号《关于准予科瑞证券投资基金变更注册的批复》和基金管理人于 2016 年 10 月 12 日发布的《易方达基金管理有限公司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》，科瑞证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、更换登记机构、终止上市、更名为“易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金”、修改投资目标、投资范围及投资策略、调整收益分配原则等条款及相应修订基金合同等。自 2017 年 1 月 3 日科瑞证券投资基金终止上市之日起，由《科瑞证券投资基金基金合同》修订而成的《易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《科瑞证券投资基金基金合同》将自同日起失效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

##### 6.1.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管



理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.1.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

##### **6.1.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2017 年 1 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

##### **6.1.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

###### **(1) 金融资产分类**

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

###### **(2) 金融负债分类**

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### **6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### **6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.1.4.4.10 费用的确认和计量**

针对基金合同约定费率和计算方法的费用,本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### **6.1.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) 同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

(5) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会审议。

(6) 原基金科瑞终止上市后,基金登记机构由中国证券登记结算有限责任公司更换为易方达基金管理有限公司,基金份额持有人需要对原持有的基金份额进行确认和重新登记,方可通过其办理确权业务的相关销售机构办理赎回等业务。在投资者办理确权登记之前,如本基金进行收益分配,则未办理确权手续的基金份额产生相应的基金权益将以红利再投资方式进行处理,分红后基金份额继续托管在易方达基金管理有限公司登记注册中心,直至投资者办理确权登记。

(7) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### **6.1.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### **6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### 6.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.1.4.6 税项

##### (1)印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花

税。

##### (2)营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

##### (3)个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所

得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 6.1.4.7 关联方关系

##### 6.1.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.1.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.1.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月3日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	525,232,128.43	8.93%

##### 6.1.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.1.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月3日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	420,185.66	8.30%	238,387.45	10.85%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.1.4.8.2 关联方报酬

##### 6.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月3日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,535,217.63
其中：支付销售机构的客户维护费	136,009.33

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。于次月首日起 5 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。

##### 6.1.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月3日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,922,536.17

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。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。于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.1.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

**6.1.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.1.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2017年1月3日至2017年6月30日	
	基金合同生效日(2017年1月3日)持有的基金份额	148,612,662.00
报告期初持有的基金份额	-	
报告期间申购/买入总份额	-	
报告期间因拆分变动份额	-	
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	
报告期末持有的基金份额	148,612,662.00	
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.03%	

注：本基金合同生效日为2017年1月3日。基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

**6.1.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
粤财信托	7,500,000.00	0.61%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

**6.1.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月3日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	116,871,391.28	752,502.95

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定



利率计息。

#### 6.1.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017年1月3日至2017年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
广发证券	300639	凯普生物	新股网下 发行	1,046	19,235.94
广发证券	002867	周大生	新股网下 发行	3,444	68,604.48
广发证券	300647	超频三	新股网下 发行	1,244	11,146.24
广发证券	300658	延江股份	新股网下 发行	1,110	21,545.10
广发证券	603042	华脉科技	新股网下 发行	1,232	13,872.32
广发证券	603043	广州酒家	新股网下 发行	1,810	23,855.80
广发证券	300669	沪宁股份	新股网下 发行	841	9,251.00

#### 6.1.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.1.4.9 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.1.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.1.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股 流通 受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
00288	金龙	2017-0	2017-0	新股	6.20	6.20	2,966	18,389	18,389	-

2	羽	6-15	7-17	流通受限				.20	.20	
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

## 6.1.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项停牌	12.08	2017-07-06	12.61	689,988	8,119,642.52	8,335,055.04	-
002260	德奥通航	2016-12-05	重大事项停牌	24.25	-	-	900,000	31,283,712.83	21,825,000.00	-
002567	唐人神	2017-06-05	重大事项停牌	9.70	2017-08-14	9.54	299,914	3,008,022.71	2,909,165.80	-
002600	江粉磁材	2017-02-27	重大事项停牌	11.46	2017-08-09	6.25	1,600,000	16,844,262.82	18,336,000.00	-
300065	海兰信	2016-12-08	重大事项停牌	25.63	2017-07-06	23.07	435,300	11,136,153.18	11,156,739.00	-
300089	文化长城	2017-04-19	重大事项停牌	14.93	-	-	233,245	4,041,530.36	3,482,347.85	-

300145	中金环境	2017-06-28	重大事项停牌	16.92	-	-	41,324	700,719.75	699,202.08	-
600701	工大高新	2017-06-12	重大事项停牌	11.14	-	-	86,700	939,073.00	965,838.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项停牌	23.49	-	-	20,000	399,200.00	469,800.00	-
601717	郑煤机	2017-04-24	重大事项停牌	7.55	-	-	2,300,000	18,405,171.60	17,365,000.00	-

### 6.1.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.1.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0, 无抵押债券。

#### 6.1.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0, 无抵押债券。

### 6.1.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 759,953,354.08 元, 属于第二层次的余额为 87,693,805.37 元, 无属于第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 6.2 科瑞证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：科瑞证券投资基金

报告截止日：2017年1月2日

单位：人民币元

资产	本期末 2017年1月2日	上年度末 2016年12月31日
资产：	-	-
银行存款	87,111,232.62	87,111,232.62
结算备付金	9,110,351.91	9,110,351.91
存出保证金	1,093,888.75	1,093,888.75
交易性金融资产	2,257,906,504.20	2,257,906,504.20
其中：股票投资	1,712,131,464.20	1,712,131,464.20
基金投资	-	-
债券投资	545,775,040.00	545,775,040.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	199,975,499.96	199,975,499.96
应收证券清算款	-	-
应收利息	19,574,077.72	19,340,651.50
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>2,574,771,555.16</b>	<b>2,574,538,128.94</b>
负债和所有者权益	本期末 2017年1月2日	上年度末 2016年12月31日
负债：	-	-

短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,958,029.82	2,958,029.82
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,520,205.47	3,309,623.68
应付托管费	586,700.91	551,603.94
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,669,138.26	3,669,138.26
应交税费	1,307,938.86	1,307,938.86
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	661,891.78	659,700.00
<b>负债合计</b>	<b>12,703,905.10</b>	<b>12,456,034.56</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	-437,932,349.94	-437,917,905.62
<b>所有者权益合计</b>	<b>2,562,067,650.06</b>	<b>2,562,082,094.38</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>2,574,771,555.16</b>	<b>2,574,538,128.94</b>

注：1.原科瑞证券投资基金于2017年1月3日转型为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金，2017年半年度实际报告期间为2017年1月1日至2017年1月2日。

2.报告截止日2017年1月2日，基金份额净值0.8540元，基金份额总额3,000,000,000.00份。

### 6.2.2 利润表

会计主体：科瑞证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年1月2日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 2 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>233,426.22</b>	<b>-821,662,106.36</b>
1.利息收入	233,426.22	18,013,868.22
其中：存款利息收入	4,402.82	733,301.21
债券利息收入	141,563.10	16,982,473.11
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	87,460.30	298,093.90
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-	-448,793,072.66
其中：股票投资收益	-	-454,065,999.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	2,080,529.06
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	3,192,397.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-390,882,901.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	<b>247,870.54</b>	<b>65,588,048.50</b>
1. 管理人报酬	210,581.79	24,145,460.88
2. 托管费	35,096.97	4,024,243.40
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	-	32,612,544.92
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	2,191.78	4,805,799.30

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-14,444.32	-887,250,154.86
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-14,444.32	-887,250,154.86

注：原科瑞证券投资基金于2017年1月3日转型为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金，2017年半年度实际报告期间为2017年1月1日至2017年1月2日。

### 6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：科瑞证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年1月2日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年1月2日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	-437,917,905.62	2,562,082,094.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,444.32	-14,444.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	3,000,000,000.00	-437,932,349.94	2,562,067,650.06

项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	2,211,580,688.68	5,211,580,688.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-887,250,154.86	-887,250,154.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-1,515,000,002.19	-1,515,000,002.19
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	-190,669,468.37	2,809,330,531.63

注：原科瑞证券投资基金于2017年1月3日转型为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金，2017年半年度实际报告期间为2017年1月1日至2017年1月2日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.2.1至6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

科瑞证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监基金字[2001]59号文件“关



于同意科瑞证券投资基金设立的批复”批准，由广东粤财信托有限公司及易方达基金管理有限公司二家发起人共同发起并向社会募集设立。本基金共募集基金份额 30 亿份，2002 年 3 月 12 日基金合同生效，2002 年 3 月 20 日正式在上海证券交易所上市。本基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行。

#### 6.2.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.2.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.2.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.2.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### (2) 营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

### (3)个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.2.4.7 关联方关系

### 6.2.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.2.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人
广东粤财信托有限公司(以下简称“粤财信托”)	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.2.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年1月2日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	-	-	1,253,455,898.48	5.71%

**6.2.4.8.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.2.4.8.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年1月2日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	1,136,191.43	5.91%	189,797.41	2.62%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**6.2.4.8.2 关联方报酬****6.2.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年1月2日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	210,581.79	24,145,460.88
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.2.4.8.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年1月2日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,096.97	4,024,243.40

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.2.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年1月2日	2016年1月1日至2016年6月30日
报告期初持有的基金份额	148,612,662.00	219,110,562.00
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	70,497,900.00
报告期末持有的基金份额	148,612,662.00	148,612,662.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.95%	4.95%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 6.2.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 1 月 2 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
粤财信托	7,500,000.00	0.25%	7,500,000.00	0.25%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 6.2.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年1月2日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	87,111,232.62	3,484.44	132,145,014.13	563,135.71

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 2 日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量(单位: 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
广发证券	002790	瑞尔特	新股网下 发行	3,022	50,104.76
广发证券	300518	盛讯达	新股网下 发行	1,306	29,019.32
广发证券	603028	赛福天	新股网下 发行	3,309	14,096.34
广发证券	603131	上海沪工	新股网下 发行	1,263	12,743.67
广发证券	603339	四方冷链	新股网下 发行	2,793	28,460.67

**6.2.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.2.4.9 期末(2017年1月2日)本基金持有的流通受限证券****6.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位:人民币元

6.2.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位:股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
60137 5	中原 证券	2016-1 2-21	2017-0 1-03	新股流 通受 限	4.00	4.00	1,000	4,000. 00	4,000. 00	-

**6.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位:人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末估	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	-----	----	----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	值单价	日期	开 盘 单 价	(股)	成本总额	估值总额	
002260	德奥通航	2016-12-05	重大事项停牌	23.10	-	-	900,000	31,283,712.83	20,790,000.00	-
002659	中泰桥梁	2016-11-03	重大事项停牌	23.08	2017-01-06	19.60	380,000	7,390,938.50	8,770,400.00	-
300065	海兰信	2016-12-08	重大事项停牌	38.52	2017-07-06	23.07	290,200	11,136,153.18	11,178,504.00	-
300223	北京君正	2016-12-19	重大事项停牌	48.40	2017-04-06	43.56	832,859	30,179,214.59	40,310,375.60	-
300537	广信材料	2016-10-12	重大事项停牌	48.79	2017-01-13	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项停牌	177.97	2017-03-13	195.77	89,133	15,700,064.37	15,863,000.01	-

#### 6.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.2.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 1 月 2 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0, 无抵押债券。

##### 6.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 1 月 2 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0, 无抵押债券。

#### 6.2.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 1 月 2 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,615,169,223.63 元, 属于第二层次的余额为 642,737,280.57 元, 无属于第三层次的

余额(2016 年 12 月 31 日: 第一层次 1,615,169,223.63 元, 第二层次 642,737,280.57 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 1 月 2 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日: 同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

#### 7.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	845,497,501.85	76.65
	其中: 股票	845,497,501.85	76.65
2	固定收益投资	2,149,657.60	0.19
	其中: 债券	2,149,657.60	0.19
	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	134,600,601.90	12.20
	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	119,724,462.74	10.85
7	其他各项资产	1,133,539.82	0.10
8	合计	1,103,105,763.91	100.00

### 7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.1.2.1 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	7,914,344.00	0.73
B	采矿业	7,423,269.00	0.69
C	制造业	524,920,680.61	48.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,682,010.37	2.47
E	建筑业	14,291,782.00	1.32
F	批发和零售业	15,934,706.75	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	37,210,776.05	3.44
H	住宿和餐饮业	1,868,800.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,931,110.42	0.83
J	金融业	163,440,755.61	15.11
K	房地产业	19,775,808.00	1.83
L	租赁和商务服务业	8,335,055.04	0.77
M	科学研究和技术服务业	5,128,608.00	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	1,114,396.00	0.10
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	2,525,400.00	0.23

S	综合	-	-
	合计	845,497,501.85	78.14

### 7.1.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601818	光大银行	9,945,500	40,279,275.00	3.72
2	601997	贵阳银行	2,050,000	32,410,500.00	3.00
3	600196	复星医药	1,000,000	30,990,000.00	2.86
4	600036	招商银行	1,260,600	30,140,946.00	2.79
5	002262	恩华药业	1,813,068	27,431,718.84	2.54
6	002019	亿帆医药	1,610,000	26,854,800.00	2.48
7	601318	中国平安	519,901	25,792,288.61	2.38
8	600519	贵州茅台	48,000	22,648,800.00	2.09
9	002260	德奥通航	900,000	21,825,000.00	2.02
10	600062	华润双鹤	759,217	20,825,322.31	1.92

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.efunds.com.cn](http://www.efunds.com.cn) 网站的半年度报告正文。

### 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601699	潞安环能	57,896,394.15	5.35
2	600123	兰花科创	57,435,629.34	5.31
3	603993	洛阳钼业	56,811,728.00	5.25
4	601818	光大银行	52,295,322.59	4.83
5	600028	中国石化	51,607,830.60	4.77
6	601899	紫金矿业	48,280,030.89	4.46
7	601628	中国人寿	46,318,128.60	4.28
8	000898	鞍钢股份	42,930,005.92	3.97
9	000059	华锦股份	40,576,454.80	3.75
10	601997	贵阳银行	40,011,787.85	3.70
11	000089	深圳机场	36,070,929.12	3.33
12	601225	陕西煤业	35,110,839.73	3.24
13	600362	江西铜业	33,587,000.76	3.10

14	002019	亿帆医药	31,547,055.25	2.92
15	600196	复星医药	30,937,474.06	2.86
16	600036	招商银行	30,451,126.95	2.81
17	000970	中科三环	29,501,043.90	2.73
18	601717	郑煤机	27,044,609.04	2.50
19	000049	德赛电池	26,697,889.15	2.47
20	000858	五 粮 液	25,269,818.34	2.34
21	601318	中国平安	24,995,965.54	2.31
22	002262	恩华药业	24,902,737.47	2.30
23	601311	骆驼股份	23,249,556.22	2.15
24	000825	太钢不锈	22,375,850.00	2.07
25	600169	太原重工	22,366,385.00	2.07
26	601369	陕鼓动力	21,770,413.99	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002035	华帝股份	89,790,064.40	8.30
2	300365	恒华科技	80,965,429.53	7.48
3	600123	兰花科创	71,269,354.70	6.59
4	600519	贵州茅台	67,288,800.27	6.22
5	002384	东山精密	65,549,572.70	6.06
6	002077	大港股份	63,860,741.76	5.90
7	601699	潞安环能	56,900,924.57	5.26
8	000333	美的集团	55,687,046.69	5.15
9	603993	洛阳钼业	52,706,939.40	4.87
10	601225	陕西煤业	50,883,111.15	4.70
11	600028	中国石化	50,217,214.60	4.64
12	601628	中国人寿	49,134,220.21	4.54
13	601899	紫金矿业	44,423,976.43	4.11
14	600426	华鲁恒升	44,289,681.25	4.09
15	300062	中能电气	42,042,307.46	3.89
16	300231	银信科技	42,031,240.01	3.88
17	000898	鞍钢股份	40,251,042.86	3.72
18	000059	华锦股份	40,103,798.59	3.71
19	600997	开滦股份	37,519,832.32	3.47
20	300458	全志科技	33,530,302.11	3.10
21	000049	德赛电池	33,288,643.80	3.08
22	300097	智云股份	33,081,121.44	3.06

23	600362	江西铜业	31,566,997.10	2.92
24	600497	驰宏锌锗	31,257,355.17	2.89
25	300236	上海新阳	30,986,218.10	2.86
26	000089	深圳机场	30,974,725.18	2.86
27	601818	光大银行	30,614,335.39	2.83
28	600409	三友化工	30,548,084.09	2.82
29	600458	时代新材	29,092,982.57	2.69
30	601009	南京银行	28,120,126.16	2.60
31	000970	中科三环	27,771,285.08	2.57
32	600782	新钢股份	27,240,948.90	2.52
33	300223	北京君正	26,703,067.40	2.47
34	000661	长春高新	26,079,566.60	2.41
35	600759	洲际油气	25,278,414.96	2.34
36	600183	生益科技	25,185,028.26	2.33
37	000417	合肥百货	24,746,087.87	2.29
38	000630	铜陵有色	24,186,320.98	2.24
39	002376	新北洋	22,779,701.35	2.11
40	000825	太钢不锈	22,494,342.43	2.08
41	601998	中信银行	22,459,537.01	2.08
42	601311	骆驼股份	22,115,244.19	2.04
43	000568	泸州老窖	22,092,933.94	2.04
44	601369	陕鼓动力	21,828,271.70	2.02
45	601166	兴业银行	21,722,640.00	2.01

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,488,311,856.96
卖出股票收入（成交）总额	3,393,760,928.19

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,149,657.60	0.20
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	2,149,657.60	0.20

#### 7.1.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	010107	21 国债(7)	20,960	2,149,657.60	0.20

#### 7.1.7 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。

#### 7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.1.9 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。

#### 7.1.10 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。

#### 7.1.11 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。

#### 7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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。

本基金投资招商银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除招商银行外，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。

7.1.12.2 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。

### 7.1.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	707,876.47
2	应收证券清算款	271,745.19
3	应收股利	-
4	应收利息	151,871.16
5	应收申购款	2,047.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,133,539.82

### 7.1.12.4 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。

### 7.1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002260	德奥通航	21,825,000.00	2.02	重大事项停牌

## 7.2 科瑞证券投资基金

### 7.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,712,131,464.20	66.50

	其中：股票	1,712,131,464.20	66.50
2	固定收益投资	545,775,040.00	21.20
	其中：债券	545,775,040.00	21.20
	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	199,975,499.96	7.77
	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	96,221,584.53	3.74
7	其他各项资产	20,667,966.47	0.80
8	合计	2,574,771,555.16	100.00

## 7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.2.1 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	35,066,179.78	1.37
B	采矿业	85,132,888.73	3.32
C	制造业	1,134,343,494.72	44.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,872,000.00	0.27
E	建筑业	16,468,400.00	0.64
F	批发和零售业	82,175,423.94	3.21
G	交通运输、仓储和邮政业	11,200,000.00	0.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	172,326,167.00	6.73
J	金融业	78,375,000.00	3.06
K	房地产业	73,683,800.00	2.88
L	租赁和商务服务业	10,340,000.00	0.40
M	科学研究和技术服务业	59,895.03	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,088,215.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	1,712,131,464.20	66.83

### 7.2.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300365	恒华科技	2,140,000	88,810,000.00	3.47
2	002077	大港股份	4,100,000	73,308,000.00	2.86
3	002035	华帝股份	2,750,000	71,362,500.00	2.79
4	600519	贵州茅台	212,000	70,839,800.00	2.76
5	002384	东山精密	3,249,887	63,730,284.07	2.49
6	000333	美的集团	1,800,000	50,706,000.00	1.98
7	300231	银信科技	2,489,500	46,080,645.00	1.80
8	300223	北京君正	832,859	40,310,375.60	1.57
9	600426	华鲁恒升	2,949,913	39,086,347.25	1.53
10	300062	中能电气	1,140,000	37,414,800.00	1.46

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.efunds.com.cn](http://www.efunds.com.cn) 网站的半年度报告正文。

### 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.2.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

#### 7.2.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

#### 7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

### 7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元



序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,206,040.00	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	543,569,000.00	21.22
	其中：政策性金融债	543,569,000.00	21.22
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	545,775,040.00	21.30

#### 7.2.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150207	15 国开 07	1,800,000	181,638,000.00	7.09
2	140208	14 国开 08	1,300,000	130,780,000.00	5.10
3	140201	14 国开 01	1,100,000	110,121,000.00	4.30
4	130425	13 农发 25	500,000	51,060,000.00	1.99
5	160206	16 国开 06	400,000	38,976,000.00	1.52

#### 7.2.7 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。

#### 7.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.2.9 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。

#### 7.2.10 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。

**7.2.11 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。

**7.2.12 投资组合报告附注**

7.2.12.1 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。

7.2.12.2 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。

**7.2.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,093,888.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,574,077.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,667,966.47

**7.2.12.4 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。

**7.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300223	北京君正	40,310,375.60	1.57	重大事项停牌

**§8 基金份额持有人信息**

## 8.1 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
18,388	67,178.60	313,745,838.44	25.40%	921,534,329.50	74.60%

注：持有人户数含未确权的原持有人户数。

### 8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

### 8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 8.2 科瑞证券投资基金

### 8.2.1 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L—FH002 沪	276,951,089.00	9.23%
2	易方达基金管理有限公司	148,612,662.00	4.95%
3	农银人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	90,420,741.00	3.01%
4	中国人寿保险股份有限公司	79,262,259.00	2.64%
5	泰康人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品—019L—CT001 沪	77,822,157.00	2.59%
6	阳光人寿保险股份有限公司—万能保险产品	56,862,653.00	1.90%
7	建信人寿保险有限公司—普	56,294,025.00	1.88%

	通		
8	泰康人寿保险股份有限公司 —万能一个险万能	53,281,428.00	1.78%
9	阳光财产保险股份有限公司 —自有资金	50,108,070.00	1.67%
10	阳光人寿保险股份有限公司 —传统保险产品	48,717,381.00	1.62%

### 8.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

### 8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年1月3日）基金份额总额	3,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,081,683.04
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,770,801,515.10
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,235,280,167.94

注：自2017年1月3日科瑞证券投资基金终止上市之日起，原科瑞证券投资基金转型为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金。本报告期自2017年1月3日至2017年6月30日止。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2017年3月10日发布公告，自2017年3月10日起聘任关秀霞女士担任公司首席国际业务官（副总经理级）；于2017年4月19日发布公告，自2017年4月19日起聘任高松凡

先生担任公司首席养老金业务官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内因本基金转型调整了本基金投资策略，详见本年度报告第二部分基金简介。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

##### 10.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财达证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	129,113,436.39	2.20%	103,290.52	2.04%	-
华鑫证券	1	137,857,075.29	2.34%	110,285.09	2.18%	-
财富证券	1	95,699,892.31	1.63%	89,125.51	1.76%	-
大通证券	1	15,508,865.47	0.26%	12,407.07	0.25%	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	2,371,537,626.07	40.33%	2,061,897.98	40.74%	-
瑞银证券	1	585,211,981.35	9.95%	468,169.47	9.25%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	50,771,864.80	0.86%	47,284.09	0.93%	-
国联证券	1	125,022,865.56	2.13%	116,434.00	2.30%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	381,198,108.24	6.48%	355,007.45	7.01%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	172,305,575.52	2.93%	160,467.97	3.17%	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	647,214,224.41	11.01%	602,751.59	11.91%	-
广发证券	1	525,232,128.43	8.93%	420,185.66	8.30%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	643,003,322.34	10.94%	514,402.44	10.16%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

#### 10.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	1,200,000,000.00	100.00%	-	-

广发证券	4,053,206.10	100.00%	-	-	-	-
------	--------------	---------	---	---	---	---

## 10.7.2 科瑞证券投资基金

### 10.7.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财达证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单

元的选择标准如下:

- 1) 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

易方达基金管理有限公司

二〇一七年八月二十九日