

# 易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年半年度报告

### 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一七年八月二十九日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国建设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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
5 托管人报告 .....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
5.3 托管人对本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 .....	11
6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	12
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	14
6.4 报表附注 .....	15
7 投资组合报告 .....	32
7.1 期末基金资产组合情况 .....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	38
7.6 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 .....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	39
7.8 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 .....	39
7.9 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 .....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	40

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	40
7.12	投资组合报告附注 .....	40
8	基金份额持有人信息 .....	41
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
8.3	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 .....	41
9	开放式基金份额变动 .....	42
10	重大事件揭示 .....	42
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4	基金投资策略的改变 .....	42
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8	其他重大事件 .....	44
11	备查文件目录 .....	48
11.1	备查文件目录 .....	48
11.2	存放地点 .....	48
11.3	查阅方式 .....	48

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	易方达新丝路混合
基金主代码	001373
交易代码	001373
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,477,999,452.81 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为灵活配置混合型主动基金，将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。在股票投资方面，将通过对各行业内的公司受益于新丝路主题的程度以及持续性的深入分析，综合评估相关公司的增长前景、经营效率、竞争优势、盈利能力等方面的因素，判断受益公司的投资价值；在债券投资方面，将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	中证 800 指数收益率×65%+一年期人民币定期存款利率（税后）×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3	北京市西城区金融大街25号

	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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	510620	100033
法定代表人	刘晓艳	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	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

## 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1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-260,222,075.27
本期利润	1,372,972,563.55
加权平均基金份额本期利润	0.0794
本期加权平均净值利润率	11.28%
本期基金份额净值增长率	11.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-6,463,368,929.27
期末可供分配基金份额利润	-0.3922
期末基金资产净值	12,329,519,611.78
期末基金份额净值	0.748
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-25.20%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或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. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	5.65%	0.75%	3.34%	0.41%	2.31%	0.34%
过去三个月	4.18%	0.76%	2.16%	0.42%	2.02%	0.34%
过去六个月	11.81%	0.69%	4.79%	0.39%	7.02%	0.30%
过去一年	4.76%	0.76%	7.97%	0.45%	-3.21%	0.31%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-25.20%	1.84%	-20.26%	1.23%	-4.94%	0.61%

#### 3.2.2 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

易方达新丝路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历史走势对比图

(2015 年 5 月 27 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-25.20%，同期业绩比较基准收益率为-20.26%。

## 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		
樊正伟	本基金的基金经理、易方达新常态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2015-05-27	-	7 年	硕士研究生，曾任中国银行深圳分行职员，易方达基金管理有限公司渠道经理、研究员、易方达积极成长证券投资基金基金经理助理。
郭杰	本基金的基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理（自 2014 年 05 月 10 日至 2017 年 05 月 10 日）、易方达改革红利混合型证券投资基金的基金经理	2015-11-07	-	9 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、易方达资源行业股票型证券投资基金基金经理。
张坤	本基金的基金经理、易方达中小盘混合型证券投资基金的基金经理、易方达亚洲精选股票型证券投资基金的基金经理、研究部总经理助理	2015-11-07	-	9 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金投资部基金经理助理。
常远	本基金的基金经理助理、科瑞证券投资基金的基金经理（自 2016 年	2017-05-11	-	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



	01 月 23 日至 2017 年 01 月 02 日)、易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、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、易方达国防军工混合型证券投资基金的基金经理助理				经理。
--	--	--	--	--	-----

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，樊正伟的“任职日期”为基金合同生效之日，郭杰、张坤、常远的“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，市场走势明显分化，上证综指上涨 2.86%，沪深 300 指数上涨 10.78%，而深证综指下跌 3.63%，创业板指下跌 7.34%。板块方面，上半年申万一级行业指数涨幅居前的行业包括家用电器、食品饮料、非银金融、银行等；跌幅居前的行业包括农林牧渔、纺织服装、综合、传媒等。

在 2017 年上半年的投资过程中，本基金继续保持对食品饮料、家用电器、交通运输、耐用消费品等行业中的龙头标的的重点配置，并精选了高端制造业中成长空间明确、行业壁垒较高、治理优良、估值合理的上市公司，同时也布局了环保、传媒等行业。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.748 元，本报告期份额净值增长率为 11.81%，同期业绩比较基准收益率为 4.79%。

#### 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，由于一、二线城市的溢出效应和棚改货币化安置支撑了三、四线城市的房地产销售和投资，预计经济的内生增长动力依然较强。在经济去杠杆、金融去杠杆的大背景下，预计货币政策易紧难松，流动性压力会一直存在。目前 A 股市场的整体估值已经处于较高的水平，大幅度提升的空间不大。

结合下半年的政治经济形势，预计短期内 A 股整体还是会处于比较均衡的局面，如果没有大的外部影响，指数的波动空间不大，重点还是在于对细分行业和个股的把握，然而由于市场已经充分挖掘并抱团其中的投资机会，短期内再发现新投资机会的难度在不断加大。

展望中长期，一方面处于经济转型背景下的各种新兴产业中会不断地涌现出新的投资机会，另一方面具有中国制造优势和品牌优势的价值型公司在未来依然会更进一步地树立竞争优势、扩大市场份额。本基金将会精选上述行业中的投资标的来进行配置。

最后，衷心感谢持有人对本基金的信任和支持，我们将努力工作，力争回报大家的信任。

#### 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**

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**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### **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**

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查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。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：易方达新丝路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	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	735,137,164.37	1,623,329,322.71
结算备付金		14,490,896.83	8,613,174.75
存出保证金		1,284,804.96	1,442,226.82
交易性金融资产	6.4.7.2	11,159,893,745.92	10,315,528,425.34
其中：股票投资		10,504,847,674.82	9,717,568,425.34
基金投资		-	-
债券投资		655,046,071.10	597,960,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	496,000,688.00	40,000,180.00
应收证券清算款		-	86,760,512.19
应收利息	6.4.7.5	10,273,409.53	6,309,951.26
应收股利		-	-
应收申购款		1,088,970.14	273,146.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,418,169,679.75	12,082,256,939.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		38,871,693.80	22,829,281.74
应付赎回款		25,954,926.59	11,548,171.40
应付管理人报酬		14,923,308.93	15,644,027.22
应付托管费		2,487,218.17	2,607,337.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	6,196,625.31	5,183,943.95

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	216,295.17	452,065.08
负债合计		88,650,067.97	58,264,827.24
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	16,477,999,452.81	17,981,706,047.72
未分配利润	6.4.7.10	-4,148,479,841.03	-5,957,713,935.70
所有者权益合计		12,329,519,611.78	12,023,992,112.02
负债和所有者权益总计		12,418,169,679.75	12,082,256,939.26

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.748 元，基金份额总额 16,477,999,452.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>1,499,935,113.78</b>	<b>-2,101,183,848.54</b>
1.利息收入		16,628,586.27	12,006,595.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,509,242.84	3,565,052.27
债券利息收入		8,137,740.66	8,118,521.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,981,602.77	323,021.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-150,540,420.08	-3,022,265,032.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-220,585,104.28	-3,068,580,014.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-104,641.73	68,953.27
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	70,149,325.93	46,246,028.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,633,194,638.82	908,015,853.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	652,308.77	1,058,734.92
<b>减：二、费用</b>		<b>126,962,550.23</b>	<b>135,830,887.94</b>

1. 管理人报酬		90,469,710.99	97,946,649.05
2. 托管费		15,078,285.28	16,324,441.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	21,132,611.72	21,285,164.96
5. 利息支出		-	5,000.00
其中：卖出回购金融资产支出		-	5,000.00
6. 其他费用	6.4.7.19	281,942.24	269,632.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,372,972,563.55</b>	<b>-2,237,014,736.48</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,372,972,563.55</b>	<b>-2,237,014,736.48</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 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）	17,981,706,047.72	-5,957,713,935.70	12,023,992,112.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,372,972,563.55	1,372,972,563.55
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）	-1,503,706,594.91	436,261,531.12	-1,067,445,063.79
其中：1.基金申购款	95,649,757.59	-28,301,571.38	67,348,186.21
2.基金赎回款	-1,599,356,352.50	464,563,102.50	-1,134,793,250.00
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）	16,477,999,452.81	-4,148,479,841.03	12,329,519,611.78
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）	20,152,034,381.94	-3,547,501,635.33	16,604,532,746.61

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,237,014,736.48	-2,237,014,736.48
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）	-606,431,790.41	192,509,259.92	-413,922,530.49
其中：1.基金申购款	402,034,391.45	-141,839,572.94	260,194,818.51
2.基金赎回款	-1,008,466,181.86	334,348,832.86	-674,117,349.00
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）	19,545,602,591.53	-5,592,007,111.89	13,953,595,479.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2015]917号《关于准予易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为28,662,751,534.29份基金份额。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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 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。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，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。对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，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元



项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	735,137,164.37
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	735,137,164.37

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,079,691,824.61	10,504,847,674.82	1,425,155,850.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	486,070,439.47	485,764,071.10
	银行间市场	169,485,970.00	169,282,000.00
	合计	655,556,409.47	655,046,071.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,735,248,234.08	11,159,893,745.92	1,424,645,511.84

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	496,000,688.00	-
合计	496,000,688.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	206,793.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,868.81
应收债券利息	10,016,778.98
应收买入返售证券利息	43,448.19
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	520.38
合计	10,273,409.53

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,172,567.10
银行间市场应付交易费用	24,058.21
合计	6,196,625.31

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,062.69
预提费用	213,232.48
合计	216,295.17

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,981,706,047.72	17,981,706,047.72
本期申购	95,649,757.59	95,649,757.59
本期赎回（以“-”号填列）	-1,599,356,352.50	-1,599,356,352.50
本期末	16,477,999,452.81	16,477,999,452.81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,795,038,984.88	837,325,049.18	-5,957,713,935.70
本期利润	-260,222,075.27	1,633,194,638.82	1,372,972,563.55
本期基金份额交易产生的变动数	591,892,130.88	-155,630,599.76	436,261,531.12
其中：基金申购款	-37,561,551.83	9,259,980.45	-28,301,571.38
基金赎回款	629,453,682.71	-164,890,580.21	464,563,102.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,463,368,929.27	2,314,889,088.24	-4,148,479,841.03

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	3,976,030.39
定期存款利息收入	426,250.02
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	95,382.90
其他	11,579.53
合计	4,509,242.84

## 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	7,769,868,779.23
减：卖出股票成本总额	7,990,453,883.51
买卖股票差价收入	-220,585,104.28

## 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	124,863,721.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	122,999,560.53
减：应收利息总额	1,968,802.75
买卖债券差价收入	-104,641.73

## 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	70,149,325.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	70,149,325.93

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	1,633,194,638.82
——股票投资	1,631,946,977.19
——债券投资	1,247,661.63
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	1,633,194,638.82

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	652,308.77
其他	-
合计	652,308.77

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	21,131,561.72
银行间市场交易费用	1,050.00
合计	21,132,611.72

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	64,464.96
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	50,109.76

银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	281,942.24

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 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6月30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	-	-	-	-

注：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股票交易。

##### 6.4.10.1.2 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。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

**6.4.10.2.1 基金管理费**

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6月30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管理费	90,469,710.99	97,946,649.05
其中：支付销售机构的客户维护费	35,696,237.04	44,542,173.53

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账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。

**6.4.10.2.2 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6月30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	15,078,285.28	16,324,441.51

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账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。

**6.4.10.3 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。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 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**

无。

**6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		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

中国建设银行-活期存款	735,137,164. 37	3,976,030.39	657,966,499. 68	3,375,031.96
-------------	--------------------	--------------	--------------------	--------------

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

#### 6.4.10.6 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	002841	视源股份	新股网下发行	1,680	32,020.80
广发证券	002842	翔鹭钨业	新股网下发行	932	10,643.44
广发证券	002867	周大生	新股网下发行	3,444	68,604.48
广发证券	300599	雄塑科技	新股网下发行	3,155	22,211.20
广发证券	300625	三雄极光	新股网下发行	3,934	75,926.20
广发证券	300627	华测导航	新股网下发行	1,498	19,129.46
广发证券	300639	凯普生物	新股网下发行	1,046	19,235.94
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	300669	沪宁股份	新股网下发行	841	9,251.00
广发证券	600089	特变电工	配股发行	1,185,273	8,498,407.41
广发证券	603041	美思德	新股网下发行	1,034	13,359.28
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	603089	正裕工业	新股网下发行	1,087	12,641.81
广发证券	603208	欧派股份	新股网下发行	1,221	30,317.43
广发证券	603630	拉芳家化	新股网下	1,985	36,504.15

			发行		
广发证券	603639	海利尔	新股网下发行	1,206	30,089.70
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	300310	宜通世纪	非公开发行	3,650,000	119,902,500.00
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

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002572	索菲亚	2016-07-28	2017-08-01	非公开发行流通受限	53.05	39.73	2,450,518	64,999,989.95	97,359,080.14	-
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	-
002888	金龙	2017-	2017-	新股	6.20	6.20	2,966	18,389	18,389	-



2	羽	06-15	07-17	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	-
600699	均胜电子	2017-01-06	2018-01-04	非公开发行流通受限	32.01	31.94	2,710,419	86,760,512.19	86,570,782.86	-
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	-
603823	百合花	2016-12-09	2017-12-20	老股转让流通受限	10.60	21.18	36,764	389,698.40	778,661.52	-
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	-

注：1) 索菲亚家居股份有限公司于 2017 年 4 月 24 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 7 元人民币现金（含税），同时按每 10 股转增 10 股进行资本公积金转增股本

2) 宁波均胜电子股份有限公司于 2017 年 6 月 07 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 2 元人民币现金（含税）；

3) 百合花集团股份有限公司于 2017 年 5 月 26 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派 1.25 元人民币现金（含税）；

4) 以上“可流通日”中，部分证券的日期是根据上市公司公告估算的流通日期。

#### 6.4.12.2 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	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

						价				
002638	勤上股份	2017-04-26	重大事项停牌	8.14	-	-	14,112,068	111,895,772.19	114,872,233.52	-
300030	阳普医疗	2017-05-16	重大事项停牌	11.62	2017-08-15	11.62	485,602	6,044,840.17	5,642,695.24	-
300098	高新兴	2017-06-22	重大事项停牌	12.90	2017-07-03	13.18	9,239,124	128,766,831.83	119,184,699.60	-
300322	硕贝德	2017-02-23	重大事项停牌	17.02	2017-08-07	15.32	2,000,000	34,397,278.20	34,040,000.00	-
601717	郑煤机	2017-04-24	重大事项停牌	7.55	-	-	506,800	3,979,882.83	3,826,340.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2016 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	644,940,592.55	603,236,712.30
合计	644,940,592.55	603,236,712.30

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	20,122,257.53	0.00
合计	20,122,257.53	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在证券交易所上市，期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	735,137,164.37	-	-	-	735,137,164.37
结算备付金	14,490,896.83	-	-	-	14,490,896.83
存出保证金	1,284,804.96	-	-	-	1,284,804.96
交易性金融资产	635,314,071.10	19,732,000.00	-	10,504,847,674.82	11,159,893,745.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	496,000,688.00	-	-	-	496,000,688.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	10,273,409.53	10,273,409.53
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,088,970.14	1,088,970.14
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,882,227,625.26	19,732,000.00	-	10,516,210,054.49	12,418,169,679.75
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	-	-	-	38,871,693.80	38,871,693.80
应付赎回款	-	-	-	25,954,926.59	25,954,926.59
应付管理人报酬	-	-	-	14,923,308.93	14,923,308.93
应付托管费	-	-	-	2,487,218.17	2,487,218.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	6,196,625.31	6,196,625.31
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	216,295.17	216,295.17
负债总计	-	-	-	88,650,067.97	88,650,067.97
利率敏感度缺口	1,882,227,625.26	19,732,000.00	-	10,427,559,986.52	12,329,519,611.78
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,623,329,322.71	-	-	-	1,623,329,322.71
结算备付金	8,613,174.75	-	-	-	8,613,174.75
存出保证金	1,442,226.82	-	-	-	1,442,226.82
交易性金融资产	597,960,000.00	-	-	9,717,568,425.34	10,315,528,425.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	40,000,180.00	-	-	-	40,000,180.00
应收证券清算款	-	-	-	86,760,512.19	86,760,512.19
应收利息	-	-	-	6,309,951.26	6,309,951.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	273,146.19	273,146.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,271,344,904.28	-	-	9,810,912,034.98	12,082,256,939.26
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	-	-	-	22,829,281.74	22,829,281.74
应付赎回款	-	-	-	11,548,171.40	11,548,171.40
应付管理人报酬	-	-	-	15,644,027.22	15,644,027.22
应付托管费	-	-	-	2,607,337.85	2,607,337.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,183,943.95	5,183,943.95
应交税费	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	452,065.08	452,065.08
负债总计	-	-	-	58,264,827.24	58,264,827.24
利率敏感度缺口	2,271,344,904.28	-	-	9,752,647,207.74	12,023,992,112.02

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	528,299.63	873,274.72
	2.市场利率上升25个基点	-526,267.05	-870,731.44

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	10,504,847,674.82	85.20	9,717,568,425.34	80.82
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,504,847,674.82	85.20	9,717,568,425.34	80.82

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	820,941,652.30	789,211,075.98
	2.业绩比较基准下降5%	-820,941,652.30	-789,211,075.98

#### 6.4.14 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 10,043,351,843.46 元，属于第二层次的余额为 1,116,541,902.46 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 8,729,755,903.15 元，第二层次 1,585,772,522.19 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(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 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	10,504,847,674.82	84.59
	其中：股票	10,504,847,674.82	84.59
2	固定收益投资	655,046,071.10	5.27
	其中：债券	655,046,071.10	5.27
	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	496,000,688.00	3.99
	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	749,628,061.20	6.04
7	其他各项资产	12,647,184.63	0.10
8	合计	12,418,169,679.75	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	243,959,632.86	1.98
B	采矿业	112,923,853.14	0.92



C	制造业	8,041,754,781.25	65.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	104,625,083.70	0.85
E	建筑业	77,224,125.18	0.63
F	批发和零售业	101,736,934.09	0.83
G	交通运输、仓储和邮政业	769,170,595.02	6.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	465,872,519.18	3.78
J	金融业	109,504,964.89	0.89
K	房地产业	325,986,673.36	2.64
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	21,204,538.67	0.17
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	130,883,973.48	1.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,504,847,674.82	85.20

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000568	泸州老窖	14,719,008	744,487,424.64	6.04
2	000858	五粮液	10,514,652	585,245,530.32	4.75
3	600519	贵州茅台	1,202,553	567,424,633.05	4.60
4	600009	上海机场	11,100,093	414,144,469.83	3.36
5	601012	隆基股份	22,113,587	378,142,337.70	3.07
6	002572	索菲亚	8,837,909	359,242,111.14	2.91
7	002434	万里扬	18,756,267	298,599,770.64	2.42
8	300222	科大智能	13,000,686	294,985,565.34	2.39
9	000089	深圳机场	30,000,000	280,500,000.00	2.28
10	000711	京蓝科技	15,711,131	236,609,632.86	1.92
11	600007	中国国贸	11,352,228	236,239,864.68	1.92
12	300182	捷成股份	24,615,612	235,325,250.72	1.91

13	002032	苏泊尔	5,500,000	225,775,000.00	1.83
14	300393	中来股份	3,815,443	209,887,519.43	1.70
15	600074	保千里	15,771,044	202,027,073.64	1.64
16	000651	格力电器	4,838,429	199,198,121.93	1.62
17	000333	美的集团	4,200,000	180,768,000.00	1.47
18	300068	南都电源	10,699,706	180,183,049.04	1.46
19	603989	艾华集团	3,709,133	145,546,378.92	1.18
20	300258	精锻科技	8,792,948	145,171,571.48	1.18
21	002262	恩华药业	9,100,030	137,683,453.90	1.12
22	300015	爱尔眼科	5,626,998	130,883,973.48	1.06
23	002583	海能达	8,069,788	129,842,888.92	1.05
24	300054	鼎龙股份	11,987,991	121,917,868.47	0.99
25	600196	复星医药	3,925,100	121,638,849.00	0.99
26	300098	高新兴	9,239,124	119,184,699.60	0.97
27	002638	勤上股份	14,112,068	114,872,233.52	0.93
28	002138	顺络电子	5,873,143	109,122,996.94	0.89
29	600779	水井坊	4,379,686	107,652,681.88	0.87
30	600690	青岛海尔	7,000,000	105,350,000.00	0.85
31	002043	兔宝宝	7,576,110	104,853,362.40	0.85
32	002008	大族激光	2,920,125	101,153,130.00	0.82
33	000596	古井贡酒	1,785,476	90,970,002.20	0.74
34	300616	尚品宅配	670,839	90,938,934.84	0.74
35	600699	均胜电子	2,710,419	86,570,782.86	0.70
36	002019	亿帆医药	5,125,984	85,501,413.12	0.69
37	600276	恒瑞医药	1,680,000	84,991,200.00	0.69
38	002479	富春环保	6,999,923	83,299,083.70	0.68
39	000002	万科 A	3,269,500	81,639,415.00	0.66
40	000513	丽珠集团	1,150,482	78,347,824.20	0.64
41	002304	洋河股份	877,700	76,193,137.00	0.62
42	002355	兴民智通	7,365,891	75,353,064.93	0.61
43	300409	道氏技术	1,967,620	73,234,816.40	0.59
44	300571	平治信息	526,444	72,996,725.04	0.59
45	002670	国盛金控	4,372,294	69,519,474.60	0.56
46	002614	奥佳华	3,755,700	68,278,626.00	0.55
47	603833	欧派家居	612,702	67,311,441.72	0.55
48	603555	贵人鸟	2,999,927	67,078,367.72	0.54
49	300021	大禹节水	7,000,000	57,470,000.00	0.47
50	000661	长春高新	420,001	54,226,329.11	0.44
51	300316	晶盛机电	4,256,895	53,168,618.55	0.43
52	002051	中工国际	2,501,078	51,847,346.94	0.42
53	002466	天齐锂业	950,000	51,632,500.00	0.42
54	000418	小天鹅 A	1,000,000	46,790,000.00	0.38
55	300350	华鹏飞	4,514,433	46,543,804.23	0.38
56	300338	开元股份	2,139,880	46,007,420.00	0.37

57	300238	冠昊生物	1,742,225	44,165,403.75	0.36
58	601225	陕西煤业	5,748,255	40,640,162.85	0.33
59	601318	中国平安	800,000	39,688,000.00	0.32
60	002599	盛通股份	2,600,000	38,194,000.00	0.31
61	002761	多喜爱	1,000,000	38,090,000.00	0.31
62	600885	宏发股份	950,000	37,895,500.00	0.31
63	600089	特变电工	3,414,678	35,273,623.74	0.29
64	600546	山煤国际	7,300,071	34,967,340.09	0.28
65	600976	健民集团	1,279,400	34,556,594.00	0.28
66	300322	硕贝德	2,000,000	34,040,000.00	0.28
67	300113	顺网科技	1,200,000	32,280,000.00	0.26
68	000625	长安汽车	2,235,506	32,235,996.52	0.26
69	000049	德赛电池	590,000	30,567,900.00	0.25
70	002139	拓邦股份	2,700,150	29,080,615.50	0.24
71	000823	超声电子	2,000,000	28,840,000.00	0.23
72	600179	安通控股	1,599,904	27,982,320.96	0.23
73	600110	诺德股份	1,935,018	27,264,403.62	0.22
74	002271	东方雨虹	700,000	25,970,000.00	0.21
75	002643	万润股份	1,700,000	25,092,000.00	0.20
76	603993	洛阳钼业	4,892,400	24,755,544.00	0.20
77	002180	纳思达	1,000,000	24,160,000.00	0.20
78	601677	明泰铝业	1,749,908	23,868,745.12	0.19
79	601168	西部矿业	3,085,501	23,727,502.69	0.19
80	601689	拓普集团	692,742	23,199,929.58	0.19
81	002007	华兰生物	600,072	21,902,628.00	0.18
82	600366	宁波韵升	1,200,000	21,168,000.00	0.17
83	300332	天壕环境	2,000,000	20,200,000.00	0.16
84	603799	华友钴业	326,700	19,856,826.00	0.16
85	600703	三安光电	1,000,000	19,700,000.00	0.16
86	600062	华润双鹤	705,524	19,352,523.32	0.16
87	600739	辽宁成大	1,000,000	18,030,000.00	0.15
88	002716	金贵银业	930,000	17,846,700.00	0.14
89	300284	苏交科	899,853	17,709,107.04	0.14
90	002636	金安国纪	1,000,000	17,270,000.00	0.14
91	601699	潞安环能	2,199,980	17,203,843.60	0.14
92	300476	胜宏科技	699,906	16,538,778.78	0.13
93	600884	杉杉股份	1,000,000	16,470,000.00	0.13
94	600282	南钢股份	4,147,100	15,385,741.00	0.12
95	300197	铁汉生态	1,100,000	14,608,000.00	0.12
96	002221	东华能源	1,300,000	14,183,000.00	0.12
97	000553	沙隆达 A	1,000,000	13,840,000.00	0.11
98	603806	福斯特	429,898	13,761,034.98	0.11
99	600392	盛和资源	1,000,000	13,190,000.00	0.11
100	603228	景旺电子	270,000	13,027,500.00	0.11

101	300323	华灿光电	900,000	12,492,000.00	0.10
102	002250	联化科技	800,000	11,440,000.00	0.09
103	603816	顾家家居	194,246	11,417,779.88	0.09
104	600581	八一钢铁	1,100,000	11,077,000.00	0.09
105	000933	神火股份	1,500,000	10,935,000.00	0.09
106	600491	龙元建设	1,000,000	10,730,000.00	0.09
107	000822	山东海化	1,300,000	10,556,000.00	0.09
108	000925	众合科技	500,000	10,385,000.00	0.08
109	600409	三友化工	1,000,000	10,070,000.00	0.08
110	300327	中颖电子	290,000	9,193,000.00	0.07
111	601155	新城控股	437,292	8,107,393.68	0.07
112	002564	天沃科技	820,000	7,486,600.00	0.06
113	300094	国联水产	1,000,000	7,350,000.00	0.06
114	000423	东阿阿胶	100,000	7,189,000.00	0.06
115	002615	哈尔斯	613,000	6,926,900.00	0.06
116	600507	方大特钢	699,949	5,970,564.97	0.05
117	002496	辉丰股份	1,200,000	5,952,000.00	0.05
118	300030	阳普医疗	485,602	5,642,695.24	0.05
119	002518	科士达	299,952	4,385,298.24	0.04
120	603186	华正新材	100,000	4,277,000.00	0.03
121	300537	广信材料	199,957	4,123,113.34	0.03
122	600549	厦门钨业	181,800	3,906,882.00	0.03
123	601717	郑煤机	506,800	3,826,340.00	0.03
124	000768	中航飞机	200,000	3,688,000.00	0.03
125	000426	兴业矿业	400,000	3,608,000.00	0.03
126	603018	中设集团	107,917	3,495,431.63	0.03
127	300567	精测电子	39,954	3,193,523.22	0.03
128	300588	熙菱信息	89,980	3,130,404.20	0.03
129	600745	中茵股份	150,000	2,806,500.00	0.02
130	300566	激智科技	75,000	2,393,250.00	0.02
131	300603	立昂技术	60,000	1,966,800.00	0.02
132	603040	新坐标	30,000	1,929,600.00	0.02
133	000688	建新矿业	226,100	1,808,800.00	0.01
134	002851	麦格米特	40,000	1,594,800.00	0.01
135	603078	江化微	20,000	1,594,800.00	0.01
136	600516	方大炭素	100,000	1,422,000.00	0.01
137	002074	国轩高科	40,000	1,262,000.00	0.01
138	002554	惠博普	200,000	1,180,000.00	0.01
139	600856	中天能源	100,000	1,126,000.00	0.01
140	300036	超图软件	60,000	981,000.00	0.01
141	300306	远方光电	55,000	953,150.00	0.01
142	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.01
143	300545	联得装备	3,700	267,510.00	0.00
144	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.00

145	002142	宁波银行	5,676	109,546.80	0.00
146	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.00
147	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
148	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
149	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
150	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
151	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
152	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
153	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
154	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
155	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
156	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
157	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
158	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
159	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
160	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
161	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
162	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
163	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
164	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
165	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
166	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
167	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
168	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
169	601965	中国汽研	80	751.20	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600009	上海机场	339,090,325.52	2.82
2	002434	万里扬	179,223,069.55	1.49
3	002043	兔宝宝	164,189,031.89	1.37
4	300616	尚品宅配	143,915,108.37	1.20
5	300054	鼎龙股份	142,869,522.52	1.19
6	300222	科大智能	124,912,066.72	1.04
7	600196	复星医药	122,459,826.01	1.02
8	002583	海能达	115,633,381.49	0.96
9	002138	顺络电子	113,750,647.63	0.95

10	600779	水井坊	112,356,164.28	0.93
11	300393	中来股份	105,867,266.04	0.88
12	600690	青岛海尔	105,349,218.34	0.88
13	300015	爱尔眼科	102,184,168.86	0.85
14	600089	特变电工	101,678,224.77	0.85
15	002008	大族激光	101,192,366.73	0.84
16	000596	古井贡酒	101,060,556.29	0.84
17	002479	富春环保	96,827,558.98	0.81
18	600699	均胜电子	86,760,512.19	0.72
19	300182	捷成股份	82,839,349.87	0.69
20	603989	艾华集团	81,000,850.54	0.67

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	298,583,241.98	2.48
2	002044	美年健康	224,707,354.30	1.87
3	300222	科大智能	219,866,674.30	1.83
4	000858	五粮液	216,563,507.56	1.80
5	002551	尚荣医疗	199,679,852.78	1.66
6	300310	宜通世纪	190,902,678.43	1.59
7	000651	格力电器	187,896,043.84	1.56
8	000568	泸州老窖	181,417,818.97	1.51
9	300100	双林股份	176,356,276.11	1.47
10	300332	天壕环境	159,641,079.22	1.33
11	300113	顺网科技	146,340,439.02	1.22
12	300160	秀强股份	128,433,447.68	1.07
13	002761	多喜爱	115,774,874.73	0.96
14	300166	东方国信	112,493,376.67	0.94
15	002572	索菲亚	102,856,961.60	0.86
16	002138	顺络电子	98,975,665.40	0.82
17	300068	南都电源	97,557,021.27	0.81
18	601689	拓普集团	94,010,359.45	0.78
19	600728	佳都科技	90,813,488.93	0.76
20	600518	康美药业	90,303,214.83	0.75

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。

#### 7.4.3 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	7,145,786,155.80
卖出股票收入（成交）总额	7,769,868,779.23

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。

### 7.5 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	485,764,071.10	3.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	169,282,000.00	1.37
	其中：政策性金融债	169,282,000.00	1.37
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	655,046,071.10	5.31

### 7.6 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	019546	16 国债 18	4,862,990	485,764,071.10	3.94
2	150212	15 国开 12	1,500,000	149,550,000.00	1.21
3	150223	15 国开 23	200,000	19,732,000.00	0.16

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**7.8 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。

**7.9 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。

**7.10 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。

**7.11 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。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 上海机场（代码：600009）为易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。根据上海国际机场股份有限公司 2016 年 7 月 14 日发布的《关于民航局相关监管措施的进展公告》，因空防问题，民航局对上海机场实施了行政约见，依法对上海机场进行行政处罚。

本基金投资上海机场的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上海机场外，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。

**7.12.2** 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。

**7.12.3 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	1,284,804.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,273,409.53
5	应收申购款	1,088,970.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-



9	合计	12,647,184.63
---	----	---------------

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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	002572	索菲亚	97,359,080.14	0.79	非公开发行 流通受限

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 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
265,802	61,993.51	14,061,683.71	0.09%	16,463,937,769.10	99.91%

#### 8.2 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	102,448.72	0.0006%

## 8.3 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（2015 年 5 月 27 日）基金份额总额	28,662,751,534.29
本报告期期初基金份额总额	17,981,706,047.72
本报告期基金总申购份额	95,649,757.59
减：本报告期基金总赎回份额	1,599,356,352.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	16,477,999,452.81

## 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

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

## 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 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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	294,806,585.95	1.99%	235,845.25	1.96%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	181,538,671.49	1.23%	169,067.15	1.40%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	1,729,167,986.84	11.67%	1,383,334.35	11.48%	-
天风证券	1	860,418,420.56	5.81%	688,334.71	5.71%	-
东吴证券	1	798,475,522.95	5.39%	638,780.51	5.30%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	862,212,983.26	5.82%	802,973.52	6.67%	-
长江证券	1	1,359,095,062.51	9.17%	1,087,273.77	9.03%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	989,079,352.28	6.68%	791,263.28	6.57%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	1,450,375,605.44	9.79%	1,160,300.57	9.63%	-
方正证券	2	3,535,820,933.06	23.87%	2,828,655.50	23.48%	-

广州证券	1	1,471,886,052.81	9.93%	1,177,508.83	9.77%	-
华创证券	1	844,773,887.94	5.70%	675,820.20	5.61%	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	438,180,328.59	2.96%	408,076.83	3.39%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增长江证券股份有限公司一个交易单元。

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。

#### 10.7.2 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
中信建投	89,802,000.00	79.53%	-	-	-	-
国信证券	13,676,598.00	12.11%	-	-	-	-
天风证券	9,437,870.50	8.36%	-	-	-	-
长城证券	-	-	600,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购海利尔药业集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-06
2	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东翔鹭钨业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-10
3	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州视源电子科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-13
4	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东雄塑科技集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-14
5	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-17
6	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购浙江正裕工业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-01-20
7	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江山欧派门业股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-03
8	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-09
9	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-14
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-02-23
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加肯特瑞为销售机构、参加肯特瑞费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-02
12	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购拉芳家化股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-04
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加龙江银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-10

14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加龙江银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-10
15	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-10
16	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广东三雄极光照明股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-11
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加广东南粤银行为销售机构、参加广东南粤银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-15
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加朝阳永续为销售机构、参加朝阳永续申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-15
19	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购上海华测导航技术股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-16
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信期货费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-20
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中信证券（山东）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-20
22	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加宜信普泽费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-22
23	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏美思德化学股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-24
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加济安财富费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-27
25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-29
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-30
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加泛华普益费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-05
28	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购	中国证券报、上海证券	2017-04-07

	广东凯普生物科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
29	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-10
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞安农商银行为销售机构、参加瑞安农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-13
31	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-19
32	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购周大生珠宝股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-22
33	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-22
34	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购深圳市超频三科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-26
35	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加深圳新兰德费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-02
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中证金牛费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-05
37	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-09
38	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-11
39	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加财通证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-15
40	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加川财证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-15
41	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购厦门延江新材料股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-20
42	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2017-05-24

		理人网站	
43	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购南京华脉科技股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-25
44	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加江苏银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-12
45	易方达基金管理有限公司关于旗下基金投资基金管理人非控股股东承销证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-12
46	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购广州酒家集团股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-21
47	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购杭州沪宁电梯部件股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
48	关于易方达基金管理有限公司上海直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23
49	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加佛山农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 存放地点

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。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。



易方达基金管理有限公司

二〇一七年八月二十九日