

# 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

## 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：二〇一九年三月二十八日

## § 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 2019 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	859,285,777.98 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。

### 2.3 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
	联系电话	020-85102688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn
客户服务电话	400 881 8088	95559

传真	020-85104666	021-62701216
----	--------------	--------------

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年 1 月 3 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-32,584,171.67	47,790,294.93
本期利润	-153,625,177.23	167,375,999.97
加权平均基金份额本期利润	-0.1733	0.1164
本期基金份额净值增长率	-17.71%	17.07%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1773	-0.0721
期末基金资产净值	706,895,140.81	945,041,179.17
期末基金份额净值	0.8227	0.9998

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，易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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
过去三个月	-10.29%	1.48%	-9.43%	1.31%	-0.86%	0.17%
过去六个月	-14.37%	1.36%	-10.56%	1.20%	-3.81%	0.16%

过去一年	-17.71%	1.23%	-18.61%	1.07%	0.90%	0.16%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-3.67%	0.98%	-5.54%	0.84%	1.87%	0.14%

### 3.2.2 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历史走势对比图

(2017 年 1 月 3 日至 2018 年 12 月 31 日)



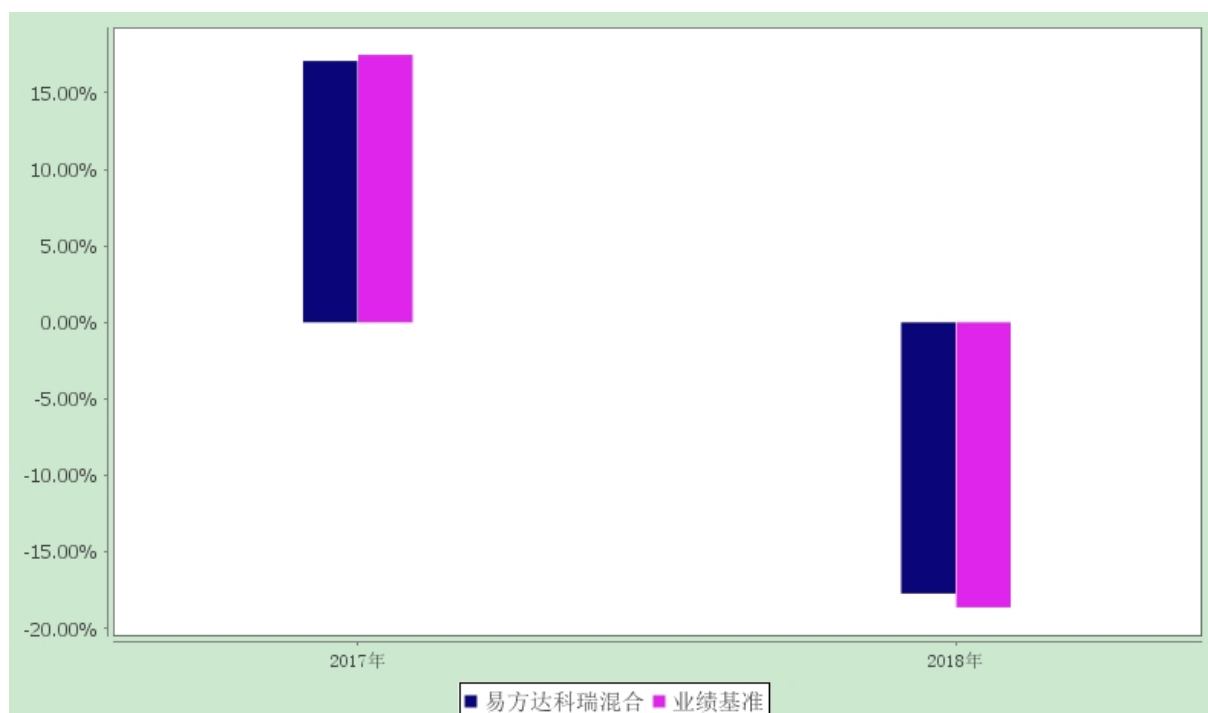
注：1.本基金由原科瑞证券投资基金于 2017 年 1 月 3 日转型而来。

2.自基金转型至报告期末，基金份额净值增长率为-3.67%，同期业绩比较基准收益率为-5.54%。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



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，合同生效当年的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2017 年 1 月 3 日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 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，总部设在广州，在北京、上海、香港、深圳等地设有分公司或子公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、基本养老保险基金投资等业务资格，是国内基金行业为数不多的“全牌照”公司之一，在主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资等领域全面布局。截至 2018 年 12 月 31 日，易方达总资产管理规模超过 1.2 万亿元，服务近 8000 万客户，自成立以来仅公募基金累计分红达 1150 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		
杨嘉文	本基金的基金经理	2017-12-27	-	7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行业研究员、易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则

合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3日内、5日内），对我司旗下所有投资组合 2018 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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 131 次，其中 127 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，4 次为不同基金经理管理的组合间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。

### 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

2018 年，A 股基本处于持续下跌状态，仅在 1 月和 9 月份表现相对较好。综合来看，主要指数下跌幅度超过 20%。上证综指、深证成指、沪深 300 指数、中小板指和创业板指分别下跌 24.59%、34.42%、25.31%、37.75% 和 28.65%。大盘股表现略优于中小盘股票。板块方面，2018 年



申万行业指数走势出现明显分化，银行、休闲服务、食品饮料表现较好，跌幅较大的指数包括传媒、有色金属、电子。

分析原因：宏观经济层面看，美国经济在特朗普基建及减税政策刺激下表现强劲，但美联储四次加息持续提升实体经济融资成本，年末经济基本面回落预期发酵；受强美元强美债影响，土耳其爆发里拉危机，意大利财政预算案、英国脱欧、法国黄马甲等事件性扰动欧洲经济；新兴市场经济承压；中美贸易战扰动全球风险偏好，风险资产价格波动率放大。国内流动性层面看，金融监管加速非标收缩，政策放松暖风驱动宽货币到宽信用效果初现。资管新规正式稿落地，社融数据中非标融资出现加速回落，民企信用违约、股权质押爆仓事件多发；央行三次降准宽货币，甚至一度提出银行一二五政策推进宽信用支持民营企业发展，银行永续债政策及配套措施迭出，政策暖风频吹，年末宽货币至宽信用效果初现，宏观流动性环境缓和。实体经济运行层面，宏观经济基本面回落后续企稳，符合市场预期。地产投资在棚改和因城施策政策下有所回落但维持高位，制造业投资表现强劲，基建投资在地方政府债务举债限制和资管新规约束下持续回落，但随着专项债提速发行而有所改善；在中美贸易战驱使下“抢出口”效应凸显，进出口前三季度均表现亮眼，2018 年四季度有所回落；社零增速持续回落，主因汽车销售数据拖累，年末个税减税效应支撑下有所企稳，2018 年经济表现整体有韧性。2019 年经济有一定的下行压力。

本基金在 2018 年全年保持在 80%-85%的仓位进行操作。一季度以金融和白酒为主进行配置，主要是当时对 2018 年全年的经济增速并不悲观。二季度考虑到未来经济增速放缓以及中美贸易摩擦影响，增加零售、医药等板块的配置。三季度延续二季度的思路，增加了食品饮料、农业、零售等消费板块配置的同时减持了涨幅较大的医药板块。四季度从估值和流动性两个角度考虑，适当增加了成长板块的配置，例如军工、新材料等。

#### 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 0.8227 元，本报告期份额净值增长率为-17.71%，同期业绩比较基准收益率为-18.61%。

#### 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 2019 年，市场整体估值已经到了历史较低的水平，国内整体流动性趋于平稳偏松，A 股在 MSCI 指数权重的增加以及进入罗素指数都会吸引外资资金的流入，而且成长股在 2018 年年报商誉计提的利空落地后投资机会又再次出现。2019 年整体市场的投资吸引力将高于 2018 年，高股息、增长确定性强的股票将获得溢价。

基于以上判断，本基金在 2019 年将增加消费股的配置比例，组合在各个行业上的配置会相对均衡。2019 年年初会将主要仓位将配置在低估值蓝筹股，以及与经济周期相对弱相关的行业上面进

行配置。同时，随着成长股的股价调整，本基金会上陆续买入一些具有竞争力并且估值相对合理的成长股，进行中长期配置。

#### 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、中国证券投资基金业协会相关指引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，公司首席运营官担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、指数量化板块、投资风险管理部、监察与合规管理总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，具备投资、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债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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

2018 年度，基金托管人在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

2018 年度，易方达基金管理有限公司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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2018 年度，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易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金的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 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	132,965,788.95	75,627,561.28
结算备付金	1,819,027.45	1,712,146.84
存出保证金	256,612.12	188,567.96
交易性金融资产	580,634,186.49	786,827,249.79
其中：股票投资	580,634,186.49	784,723,284.99
基金投资	-	-
债券投资	-	2,103,964.80
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	-	100,050,350.08

应收证券清算款	1,086,070.03	10,342,893.41
应收利息	53,982.78	281,766.13
应收股利	-	-
应收申购款	16,560.66	166,500.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>716,832,228.48</b>	<b>975,197,035.58</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		
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	5,634,424.93	-
应付赎回款	198,943.29	25,457,987.27
应付管理人报酬	921,913.56	1,222,213.09
应付托管费	153,652.25	203,702.17
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,194,711.99	1,228,112.65
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	525,502.79	735,902.37
<b>负债合计</b>	<b>9,937,087.67</b>	<b>30,155,856.41</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	859,285,777.98	945,188,031.29
未分配利润	-152,390,637.17	-146,852.12

所有者权益合计	706,895,140.81	945,041,179.17
负债和所有者权益总计	716,832,228.48	975,197,035.58

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 年度实际报告期间为 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 12 月 31 日。

2. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8227 元，基金份额总额 859,285,777.98 份。

## 7.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 3 日（基金合 同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-127,914,960.22</b>	<b>203,434,590.59</b>
1.利息收入	1,431,959.76	7,517,404.29
其中：存款利息收入	1,169,954.78	1,292,389.48
债券利息收入	1,259.67	1,701,213.93
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	260,745.31	4,523,800.88
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-8,422,820.88	70,593,128.67
其中：股票投资收益	-21,864,657.59	64,570,714.47
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-14,554.88	-4,928,881.45
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	13,456,391.59	10,951,295.65

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-121,041,005.56	119,585,705.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	116,906.46	5,738,352.59
<b>减：二、费用</b>	<b>25,710,217.01</b>	<b>36,058,590.62</b>
1. 管理人报酬	12,591,399.81	19,225,974.29
2. 托管费	2,098,566.64	3,204,328.98
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	10,601,391.27	13,193,646.85
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.14	-
7. 其他费用	418,859.15	434,640.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-153,625,177.23</b>	<b>167,375,999.97</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-153,625,177.23</b>	<b>167,375,999.97</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，上年度可比期间为 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 12 月 31 日。

### 7.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	945,188,031.29	-146,852.12	945,041,179.17
二、本期经营活动产生	-	-153,625,177.23	-153,625,177.23

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-85,902,253.31	1,381,392.18	-84,520,861.13
其中：1.基金申购款	37,596,214.73	-1,509,607.73	36,086,607.00
2.基金赎回款	-123,498,468.04	2,890,999.91	-120,607,468.13
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）	859,285,777.98	-152,390,637.17	706,895,140.81
项目	上年度可比期间		
	2017年1月3日（基金合同生效日）至2017年12月31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）	-	167,375,999.97	167,375,999.97
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）	-2,054,811,968.71	270,409,497.85	-1,784,402,470.86
其中：1.基金申购款	16,537,045.85	-1,256,738.16	15,280,307.69
2.基金赎回款	-2,071,349,014.56	271,666,236.01	-1,799,682,778.55
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）	945,188,031.29	-146,852.12	945,041,179.17

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，上年度可比期间为 2017 年 1 月 3 日至 2017 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

### 7.4.2 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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。



本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 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。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 7.4.6 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。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未

分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

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。

### （4）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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

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

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
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月3日（基金合同生效日） 至2017年12月31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	337,126,021.75	4.67%	586,652,617.27	6.74%

##### 7.4.8.1.2 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。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	269,700.84	4.28%	70,797.39	5.95%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月3日（基金合同生效日）至2017年12月31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	469,322.04	6.25%	28,672.17	2.34%

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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月3日（基金合同 生效日）至2017年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,591,399.81	19,225,974.29
其中：支付销售机构的客户维护费	839,598.28	592,878.95

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。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月3日（基金合同 生效日）至2017年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,098,566.64	3,204,328.98

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。

##### 7.4.8.3 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。

## 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.8.4.1 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 2018年1月1日至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年1月3日（基金合同生效 日）至2017年12月31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	123,612,662.00	-
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	-	25,000,000.00
报告期末持有的基金份额	123,612,662.00	123,612,662.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.39%	13.08%

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。

## 7.4.8.4.2 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 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	0.87%	7,500,000.00	0.79%

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。

## 7.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月3日（基金合同生效日）

	至2017年12月31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	82,965,788.95	1,082,401.98	75,627,561.28	1,217,428.42

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。

#### 7.4.8.6 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 2018年1月1日至2018年12月31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	002927	泰永长征	新股网下发行	961	14,203.58
上年度可比期间 2017年1月3日（基金合同生效日）至2017年12月31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	002867	周大生	新股网下发行	3,444	68,604.48
广发证券	002919	名臣健康	新股网下发行	821	10,311.76
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	300697	电工合金	新股网下发行	1,630	12,436.90
广发证券	300723	一品红	新股网下发行	1,561	26,615.05
广发证券	300726	宏达电子	新股网下	1,548	17,275.68

			发行		
广发证券	300735	光弘科技	新股网下发行	3,764	37,602.36
广发证券	600089	特变电工	配股发行	70,009	501,964.53
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	603458	勘设股份	新股网下发行	1,320	38,755.20
广发证券	603507	振江股份	新股网下发行	1,093	28,691.25
广发证券	603535	嘉诚国际	新股网下发行	1,340	20,327.80
广发证券	603557	起步股份	新股网下发行	1,664	12,862.72
广发证券	603683	晶华新材	新股网下发行	1,095	10,227.30
广发证券	603848	好太太	新股网下发行	1,377	10,864.53

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
000568	泸州老窖	2017-09-13	2019-09-16	非公开发行流通受限	48.00	37.35	31,250	1,500,000.00	1,167,187.50	-

注：1) 泸州老窖股份有限公司于 2018 年 7 月 16 日（流通受限期内），向全体股东每 10 股派

12.5 元人民币现金（含税）。

2) 根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东以外的股东减持所持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%。持有上市公司非公开发行股份的股东，通过集中竞价交易减持该部分股份的，除遵守前款规定外，自股份解除限售之日起 12 个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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。

#### 7.4.10 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 2018 年 12 月 31 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 579,466,998.99 元，属于第二层次的余额为 1,167,187.50 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 779,333,784.24 元，第二层次 7,493,465.55 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 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	580,634,186.49	81.00
	其中：股票	580,634,186.49	81.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	134,784,816.40	18.80

8	其他各项资产	1,413,225.59	0.20
9	合计	716,832,228.48	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	21,357,042.34	3.02
B	采矿业	22,761,218.90	3.22
C	制造业	326,360,672.21	46.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,812,127.64	0.82
E	建筑业	6,470,911.00	0.92
F	批发和零售业	81,976,390.45	11.60
G	交通运输、仓储和邮政业	7,870,137.52	1.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,143,534.00	2.00
J	金融业	54,627,961.50	7.73
K	房地产业	17,213,009.50	2.44
L	租赁和商务服务业	9,006,403.20	1.27
M	科学研究和技术服务业	10,568,789.18	1.50
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	2,465,989.05	0.35
S	综合	-	-
	合计	580,634,186.49	82.14

### 8.3 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	600519	贵州茅台	118,483	69,906,154.83	9.89
2	002891	中宠股份	1,442,523	47,733,086.07	6.75
3	002697	红旗连锁	7,053,366	36,183,767.58	5.12
4	601318	中国平安	547,293	30,703,137.30	4.34
5	002304	洋河股份	268,631	25,444,728.32	3.60
6	603708	家家悦	1,258,043	25,274,083.87	3.58
7	600036	招商银行	719,372	18,128,174.40	2.56
8	300398	飞凯材料	1,121,777	17,611,898.90	2.49
9	600511	国药股份	730,700	16,988,775.00	2.40
10	002179	中航光电	376,829	12,691,600.72	1.80

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) 网站的年度报告正文。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	601939	建设银行	82,061,543.08	8.68
2	002697	红旗连锁	59,549,900.62	6.30
3	600887	伊利股份	56,009,411.22	5.93
4	600754	锦江股份	55,550,037.10	5.88
5	603708	家家悦	54,936,044.52	5.81
6	600028	中国石化	52,549,593.47	5.56
7	000858	五粮液	51,012,849.08	5.40
8	002891	中宠股份	50,952,053.50	5.39
9	000651	格力电器	50,760,607.31	5.37
10	601088	中国神华	49,254,271.52	5.21
11	600809	山西汾酒	47,390,763.61	5.01
12	601318	中国平安	45,003,170.38	4.76
13	600036	招商银行	44,203,498.47	4.68
14	600519	贵州茅台	40,454,996.25	4.28
15	300398	飞凯材料	40,067,691.88	4.24
16	601111	中国国航	38,349,006.90	4.06
17	000568	泸州老窖	37,487,565.49	3.97
18	002191	劲嘉股份	37,364,085.04	3.95
19	000998	隆平高科	36,945,328.53	3.91
20	603589	口子窖	36,696,158.30	3.88

21	002126	银轮股份	36,066,065.32	3.82
22	000895	双汇发展	35,926,578.29	3.80
23	000333	美的集团	35,814,131.80	3.79
24	002304	洋河股份	35,621,777.12	3.77
25	002202	金风科技	35,136,652.92	3.72
26	600030	中信证券	35,104,558.52	3.71
27	002299	圣农发展	34,640,289.49	3.67
28	600258	首旅酒店	32,774,619.66	3.47
29	601117	中国化学	31,898,128.84	3.38
30	600779	水井坊	31,794,658.18	3.36
31	000002	万科 A	31,510,570.86	3.33
32	600967	内蒙一机	31,259,931.12	3.31
33	600845	宝信软件	30,189,432.81	3.19
34	002262	恩华药业	29,087,844.40	3.08
35	000902	新洋丰	28,705,930.89	3.04
36	601009	南京银行	27,677,536.18	2.93
37	002311	海大集团	27,657,576.24	2.93
38	600511	国药股份	27,456,418.89	2.91
39	601336	新华保险	27,077,185.89	2.87
40	002458	益生股份	26,368,103.51	2.79
41	600153	建发股份	26,090,530.09	2.76
42	002572	索菲亚	25,992,003.46	2.75
43	600643	爱建集团	25,104,159.96	2.66
44	002127	南极电商	24,765,421.45	2.62
45	603839	安正时尚	23,920,878.07	2.53
46	300059	东方财富	23,638,620.20	2.50
47	000418	小天鹅 A	23,202,086.02	2.46
48	002234	民和股份	22,924,997.19	2.43
49	600547	山东黄金	22,118,110.55	2.34
50	600104	上汽集团	22,069,176.63	2.34
51	300511	雪榕生物	21,819,470.52	2.31
52	001979	招商蛇口	21,430,257.13	2.27
53	600690	青岛海尔	21,397,070.58	2.26
54	000596	古井贡酒	21,140,435.42	2.24
55	600655	豫园股份	20,554,024.24	2.17
56	002179	中航光电	19,221,161.82	2.03

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。

#### 8.4.2 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

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	601939	建设银行	86,007,382.82	9.10
2	600887	伊利股份	71,374,637.55	7.55
3	000858	五粮液	68,572,036.80	7.26
4	000651	格力电器	62,218,579.78	6.58
5	002142	宁波银行	61,508,334.54	6.51
6	601318	中国平安	61,290,844.94	6.49
7	603708	家家悦	60,112,656.74	6.36
8	600036	招商银行	59,812,494.29	6.33
9	600258	首旅酒店	53,823,051.60	5.70
10	601088	中国神华	51,299,736.72	5.43
11	600030	中信证券	49,723,847.45	5.26
12	600809	山西汾酒	49,625,929.35	5.25
13	600754	锦江股份	47,949,077.17	5.07
14	601336	新华保险	40,832,743.01	4.32
15	000998	隆平高科	39,851,978.53	4.22
16	600028	中国石化	39,585,881.91	4.19
17	601111	中国国航	36,493,646.08	3.86
18	002126	银轮股份	36,308,621.66	3.84
19	002496	ST 辉丰	35,432,543.41	3.75
20	603833	欧派家居	35,411,198.65	3.75
21	300398	飞凯材料	32,604,490.42	3.45
22	000333	美的集团	32,440,938.92	3.43
23	600038	中直股份	32,263,579.09	3.41
24	601117	中国化学	30,991,259.74	3.28
25	600845	宝信软件	30,418,618.81	3.22
26	600779	水井坊	30,393,305.56	3.22
27	002262	恩华药业	30,284,735.91	3.20
28	603589	口子窖	29,662,377.40	3.14
29	000902	新洋丰	28,958,986.74	3.06
30	002458	益生股份	28,837,877.98	3.05
31	601009	南京银行	28,799,116.96	3.05
32	600196	复星医药	28,670,190.18	3.03
33	000002	万科 A	28,647,163.71	3.03
34	600690	青岛海尔	28,388,927.83	3.00
35	600048	保利地产	28,131,012.01	2.98
36	000895	双汇发展	27,709,349.04	2.93
37	002013	中航机电	27,377,830.35	2.90
38	002191	劲嘉股份	27,271,768.05	2.89
39	600643	爱建集团	27,075,091.26	2.86
40	002299	圣农发展	26,925,572.62	2.85
41	002311	海大集团	26,915,192.27	2.85
42	000568	泸州老窖	25,141,252.93	2.66

43	000418	小天鹅 A	24,695,687.97	2.61
44	600967	内蒙一机	24,672,745.72	2.61
45	601601	中国太保	24,499,956.80	2.59
46	002697	红旗连锁	24,245,283.78	2.57
47	002234	民和股份	23,658,355.01	2.50
48	300059	东方财富	23,136,154.47	2.45
49	600153	建发股份	22,635,346.67	2.40
50	600104	上汽集团	21,936,569.80	2.32
51	000661	长春高新	21,736,678.67	2.30
52	002127	南极电商	21,268,183.15	2.25
53	300511	雪榕生物	21,239,385.24	2.25
54	603788	宁波高发	20,744,442.04	2.20
55	600655	豫园股份	20,626,305.30	2.18
56	002139	拓邦股份	20,208,260.33	2.14
57	600362	江西铜业	19,707,798.94	2.09

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。

#### 8.4.3 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	3,589,770,318.29
卖出股票收入（成交）总额	3,650,868,430.44

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。2018年2月12日，中国银监会针对招商银行股份有限公司的如下事由罚款6570万元，没收违法所得3.024万元，罚没合计6573.024万元：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。2018年7月5日，深圳保监局针对招商银行股份有限公司电话销售欺骗投保人罚款30万元。

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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	256,612.12
2	应收证券清算款	1,086,070.03
3	应收股利	-
4	应收利息	53,982.78
5	应收申购款	16,560.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,413,225.59
---	----	--------------

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
15,572	55,181.47	142,944,869.44	16.64%	716,340,908.54	83.36%

注：持有人户数含未确权的原持有人户数。

#### 9.2 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	44,159.81	0.0051%

#### 9.3 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	0~10

### § 10 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
本报告期期初基金份额总额	945,188,031.29



本报告期基金总申购份额	37,596,214.73
减：本报告期基金总赎回份额	123,498,468.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	859,285,777.98

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 8 日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官（副总经理级），聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官（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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自转型之后连续 2 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 75,000.00 元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
财达证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	5,424,958.30	0.08%	5,052.44	0.08%	-
长城证券	1	1,134,937,690.44	15.72%	1,056,967.87	16.75%	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	225,327,782.93	3.12%	180,262.18	2.86%	-
光大证券	1	537,234,093.01	7.44%	500,328.83	7.93%	-
广发证券	1	337,126,021.75	4.67%	269,700.84	4.28%	-
国联证券	1	221,538,907.81	3.07%	206,316.88	3.27%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	318,358,915.64	4.41%	296,487.70	4.70%	-
国元证券	1	232,504,869.87	3.22%	216,532.83	3.43%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	0	44,941,967.31	0.62%	35,953.46	0.57%	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	47,755,237.72	0.66%	38,204.32	0.61%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	978,227,340.31	13.55%	911,017.75	14.44%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	550,879,582.74	7.63%	440,702.65	6.99%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	617,603,385.47	8.55%	494,080.91	7.83%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	137,955,333.36	1.91%	128,475.36	2.04%	-
招商证券	0	161,168,322.90	2.23%	150,095.58	2.38%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	1,669,219,438.27	23.12%	1,378,376.60	21.85%	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少招商证券股份有限公司、华创证券有限责任公司各一个交易单元,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。

#### 11.7.2 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
财达证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	30,000,000.00	100.00%	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	2,102,707.20	77.57%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	544,171.08	20.07%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	63,983.36	2.36%	-	-	-	-

湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一九年三月二十八日