

# 科瑞证券投资基金

## 2016 年年度报告

2016 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：二〇一七年三月三十一日

## § 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 3 月 27 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 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1	主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2	基金净值表现 .....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况 .....	9
§ 4	管理人报告 .....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
§ 5	托管人报告 .....	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	14
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 .....	14
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 .....	14
§ 6	审计报告 .....	14
6.1	管理层对财务报表的责任 .....	15
6.2	注册会计师的责任 .....	15
6.3	审计意见 .....	15
§ 7	年度财务报表 .....	15
7.1	资产负债表 .....	15
7.2	利润表 .....	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
7.4	报表附注 .....	20
§ 8	投资组合报告 .....	43
8.1	期末基金资产组合情况 .....	43
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
8.3	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 .....	45
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
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 .....	50

8.7	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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	50
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
8.12	投资组合报告附注 .....	50
§ 9	基金份额持有人信息 .....	51
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	52
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
9.4	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 .....	52
§ 10	重大事件揭示 .....	52
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4	基金投资策略的改变 .....	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8	其他重大事件 .....	56
§ 11	备查文件目录 .....	59
11.1	备查文件目录 .....	59
11.2	存放地点 .....	59
11.3	查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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

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市场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
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	上海市浦东新区银城中路188号
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	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		510620	200120
法定代表人		刘晓艳	牛锡明

## 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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-578,774,862.34	1,665,934,691.50	438,841,317.70
本期利润	-1,134,498,592.11	1,860,167,340.19	329,471,351.73
加权平均基金份额本期利润	-0.3782	0.6201	0.1098
本期加权平均净值利润率	-38.98%	38.77%	9.90%

本期基金份额净值增长率	-21.22%	52.99%	10.01%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
期末可供分配利润	-437,917,905.62	1,673,382,539.42	277,447,847.92
期末可供分配基金份额利润	-0.1460	0.5578	0.0925
期末基金资产净值	2,562,082,094.38	5,211,580,688.68	3,621,413,348.49
期末基金份额净值	0.8540	1.7372	1.2071
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	556.23%	732.99%	444.46%

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.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

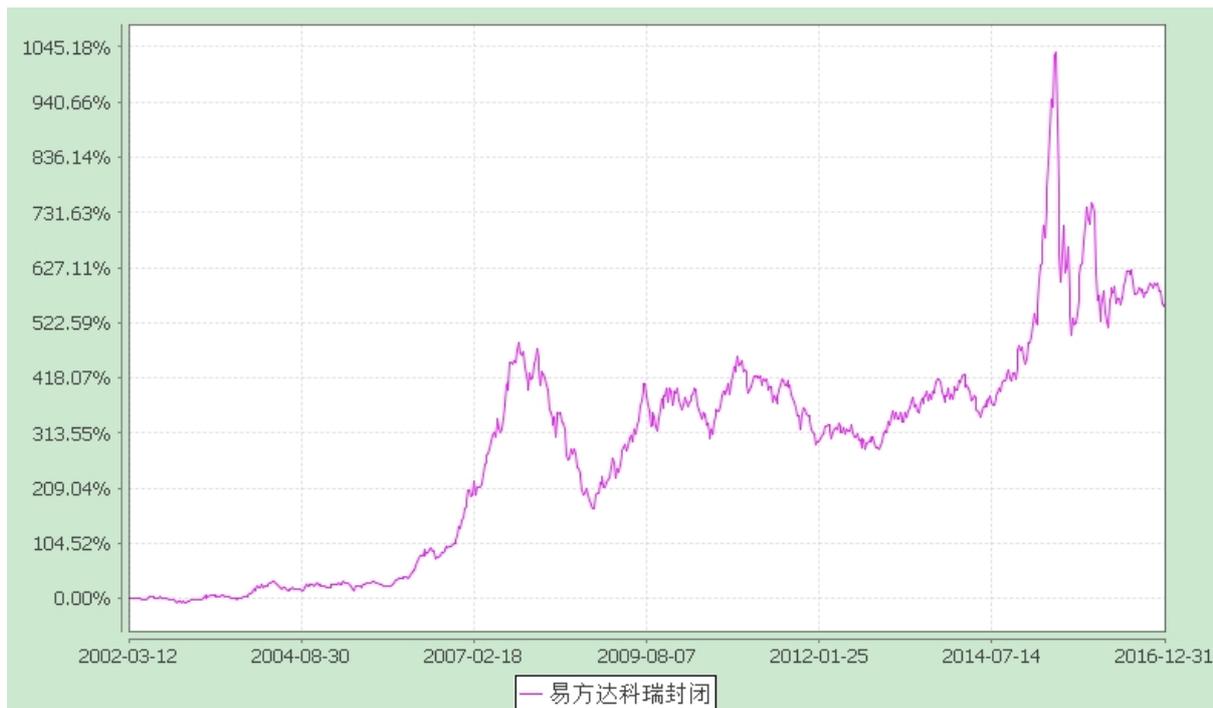
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.49%	1.39%	-	-	-	-
过去六个月	-8.80%	1.39%	-	-	-	-
过去一年	-21.22%	3.30%	-	-	-	-
过去三年	32.59%	3.90%	-	-	-	-
过去五年	59.81%	3.31%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	556.23%	3.03%	-	-	-	-

#### 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

科瑞证券投资基金

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

（2002年3月12日至2016年12月31日）



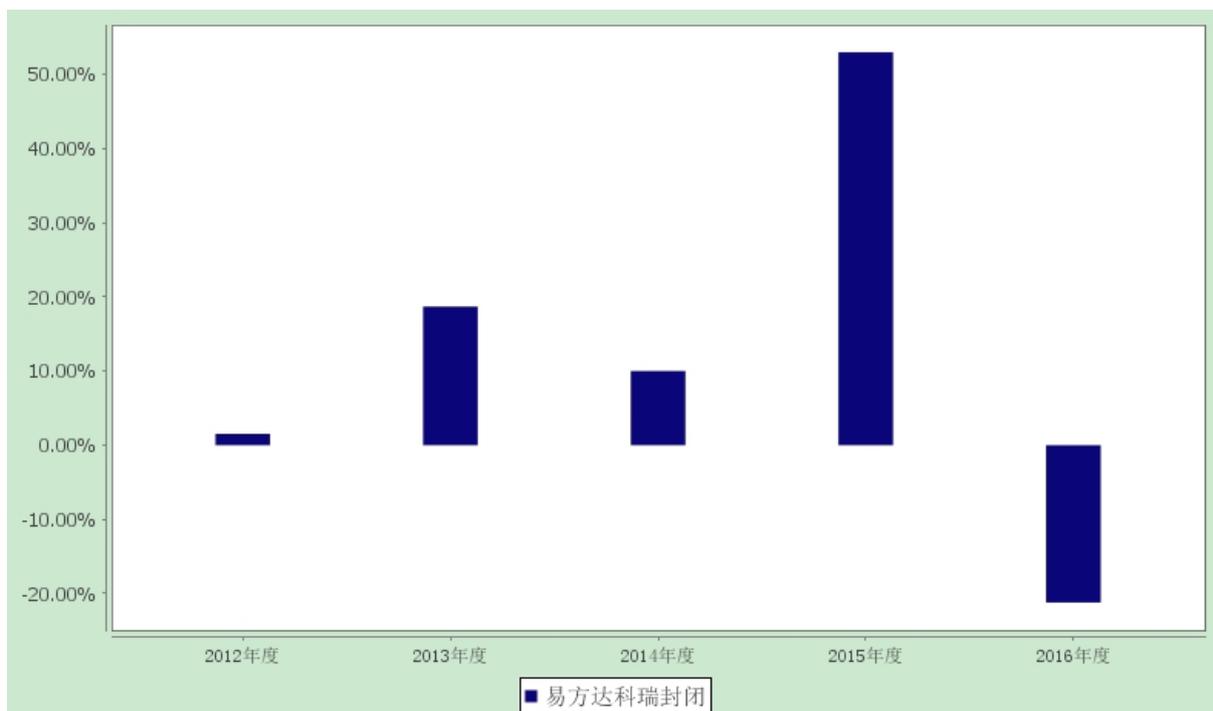
注：1.本基金基金合同未规定业绩比较基准。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 556.23%。

### 3.2.3 过去五年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

科瑞证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	5.050	1,515,000,002.19	-	1,515,000,002.19	-
2015年	0.900	270,000,000.00	-	270,000,000.00	-
2014年	-	-	-	-	-
合计	5.950	1,785,000,002.19	-	1,785,000,002.19	-

## § 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、南京等六个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2016年12月31日，公司旗下管理的各类资产总规模10491亿元，其中公募基金规模4283亿元，公募基金规模排名连续12年保持在行业前五名，服务客户超过5000万户，公司净资产66亿元，在国内资产管理行业具有领先的市场地位和综合实力。

#### 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		
郑希	本基金的基金经理、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、投资一部副总经理	2012-09-28	-	10 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、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理。
常远	本基金的基金经理	2016-01-23	-	6 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。

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关助理协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

#### 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和分配机制，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 2016 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 29 次，其中 26 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，3 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

2016 年 A 股市场整体呈现震荡下跌行情，大盘蓝筹下跌相对较小，中小创下跌幅度较大。2016 年沪深 300 指数下跌 11.28%，上证综指下跌 12.31%，中小盘指数下跌 20.14%，创业板指数下跌 27.71%，创业板综指下跌 20.35%。

从宏观经济层面看，全球经济开始复苏：美国经济增长，欧洲、中国以及日本经济数据有所好转。在美元走强的同时，全球资源价格出现普遍上升，全球流动性拐点也逐步形成。在此大背景

下，全球资产价格出现分化，传统产业由于盈利明显好转得到资金的持续流入，而高估值的新兴产业估值收缩压力较大。

从国内流动性层面看，在供给侧改革、汇率贬值和传统行业盈利改善的背景下，PPI 及 CPI 的上行压力显现，国内流动性拐点的预期和整体资本市场的流动性压力正逐步形成。

从实体层面看，在供给侧改革、环保压力以及去产能等多重效应的作用下，工业品价格出现回升，周期性行业盈利能力明显提升。

本基金在 2016 年保持仓位稳定，依然以成长性投资品种为核心仓位，保持了半导体、软件、军工等新兴成长类核心品种的占比，同时适当配置了化工、资源、油气服务等周期性行业。

#### 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 0.8540 元，本报告期份额净值增长率为-21.22%。

#### 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，国内整体流动性趋于平稳偏紧，随着新股发行加快，股市未来的流动性环境也将维持偏紧状态，预计整体市场将逐步分化，与周期性盈利恢复相关的板块将有结构性的机会。

基于以上判断，本基金在 2017 年将保持中性偏低仓位，增加周期性投资品种的配置比例，降低组合的平均估值水平。组合将立足中长期盈利成长性和稳定性的原则进行构建，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，并在中小市值股票中寻找能超越周期的个股。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控内幕交易等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，及时贯彻落实新法规及新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 严守合规底线、管好合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行，完善信息隔离和利益冲突管理制度机制。

(3) 继续坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具、新投资策略的推出和应用，重点加强了对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、研究、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保了旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

(4) 对投研交易、销售宣传、客户服务、人员规范、运营及 IT 治理、反洗钱等方面开展了一系列专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

(6) 督促落实销售适当性管理制度，推动完善销售规范及客户投诉处理机制流程，保障投资者合法权益。

(7) 深入贯彻“风险为本”的监管精神，持续完善制度流程，探索建立风险识别、评估、预警和控制一体化的洗钱风险防控体系，推动提升客户身份识别工作水平，强化可疑交易监测分析，做好反洗钱宣传培训、系统研发、内部审计、信息报送等各项工作。

(8) 紧跟法规、市场变化和业务发展，持续优化完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、完整、准确、及时、规范。

(9) 不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，使合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性得到提升。

2016 年，公司获得 ISAE3402（《国际鉴证业务准则 3402 号》）无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告，鉴证日期区间为 2014 年 7 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。同时，公司通过了 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。通过开展上述外部审计鉴证及验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、

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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《科瑞证券投资基金基金合同》，本基金本报告期不满足分红条件，不进行利润分配；本报告期内 2016 年 2 月 16 日已实施的利润分配 300,000,000.00 元、2016 年 3 月 2 日已实施的利润分配 420,000,000.00 元、2016 年 3 月 17 日已实施的利润分配 375,000,002.19 元、2016 年 3 月 24 日已实施的利润分配 420,000,000.00 元是对 2015 年度利润进行的分配。

### § 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

2016 年度，基金托管人在科瑞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

2016 年度，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，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 4 次收益分配，分配金额为 1,515,000,002.19 元，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

2016 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科瑞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(2017)审字第 60468000\_G01 号

科瑞证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的科瑞证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人易方达基金管理有限公司的责任。这种责任包括：

（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了科瑞证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册会计师

赵雅 李明明

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2017-03-24

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：科瑞证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	87,111,232.62	290,142,282.83
结算备付金		9,110,351.91	22,980,263.13
存出保证金		1,093,888.75	3,138,229.38
交易性金融资产	7.4.7.2	2,257,906,504.20	4,899,398,673.56
其中：股票投资		1,712,131,464.20	3,811,831,747.36
基金投资		-	-
债券投资		545,775,040.00	1,087,566,926.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	199,975,499.96	-
应收证券清算款		-	15,000,210.97
应收利息	7.4.7.5	19,340,651.50	31,633,774.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,574,538,128.94</b>	<b>5,262,293,434.54</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,958,029.82	29,353,849.66
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,309,623.68	6,604,305.56
应付托管费		551,603.94	1,100,717.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,669,138.26	11,695,934.20
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	7.4.7.8	659,700.00	650,000.00
<b>负债合计</b>		<b>12,456,034.56</b>	<b>50,712,745.86</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-437,917,905.62	2,211,580,688.68
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,562,082,094.38</b>	<b>5,211,580,688.68</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,574,538,128.94</b>	<b>5,262,293,434.54</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8540 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：科瑞证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-1,029,540,207.91</b>	<b>2,017,370,923.59</b>
1.利息收入		32,182,365.62	49,969,411.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,343,199.80	1,758,903.70
债券利息收入		30,274,356.95	48,064,914.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		564,808.87	145,593.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-505,998,843.76	1,773,168,863.49
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-513,025,474.81	1,756,875,679.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,298,216.03	10,278,527.89
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	4,728,415.02	6,014,656.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-555,723,729.77	194,232,648.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>104,958,384.20</b>	<b>157,203,583.40</b>
1. 管理人报酬		44,389,322.35	71,700,164.91
2. 托管费		7,398,220.29	11,950,027.45
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	48,018,408.32	69,906,263.30
5. 利息支出		-	2,330,381.06
其中：卖出回购金融资产支出		-	2,330,381.06
6. 其他费用	7.4.7.19	5,152,433.24	1,316,746.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号</b>		<b>-1,134,498,592.11</b>	<b>1,860,167,340.19</b>

填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>-1,134,498,592.11</b>	<b>1,860,167,340.19</b>

### 7.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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	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）	-	-1,134,498,592.11	-1,134,498,592.11
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	-437,917,905.62	2,562,082,094.38
项目	上年度可比期间		

	2015 年 1 月 1 日至 2015 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	621,413,348.49	3,621,413,348.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,860,167,340.19	1,860,167,340.19
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)	-	-270,000,000.00	-270,000,000.00
五、期末所有者权益 (基金净值)	3,000,000,000.00	2,211,580,688.68	5,211,580,688.68

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：张优造，会计机构负责人：陈荣

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

### 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《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。

#### 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 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。

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 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。

##### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按照前一日基金资产净值乘以 1.5% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按照前一日基金资产净值乘以 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按融入资金应收或实际收到的总额及实际利率（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；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.9 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配的比例不低于基金会计年度净收益的 90%，并采取现金形式进行；

(2) 基金收益每年至少分配一次；

(3) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(4) 基金投资当年亏损，则不进行收益分配；

(5) 每份基金单位享有同等分配权；

(6) 上述规定因国家法律、法规或政策变化发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开持有人大会。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	87,111,232.62	290,142,282.83

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	87,111,232.62	290,142,282.83

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,725,380,890.88	1,712,131,464.20	-13,249,426.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,189,288.00	2,206,040.00
	银行间市场	547,861,905.83	543,569,000.00
	合计	550,051,193.83	545,775,040.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,275,432,084.71	2,257,906,504.20	-17,525,580.51
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,288,932,786.50	3,811,831,747.36	522,898,960.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,580,237.60	4,606,926.20
	银行间市场	1,067,687,500.20	1,082,960,000.00
	合计	1,072,267,737.80	1,087,566,926.20

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,361,200,524.30	4,899,398,673.56	538,198,149.26

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	199,975,499.96	-
合计	199,975,499.96	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	31,791.00	25,245.87
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	4,099.70	10,341.10
应收债券利息	19,173,078.18	31,596,775.50

应收买入返售证券利息	131,190.42	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	492.20	1,412.20
合计	19,340,651.50	31,633,774.67

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,668,418.30	11,694,184.20
银行间市场应付交易费用	719.96	1,750.00
合计	3,669,138.26	11,695,934.20

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	-	-
预提费用	400,000.00	400,000.00
其他应付款	9,700.00	-
合计	659,700.00	650,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

本基金本报告期及上年度可比期间实收基金的份额未发生变动。

#### 7.4.7.10 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	1,673,382,539.42	538,198,149.26	2,211,580,688.68
本期利润	-578,774,862.34	-555,723,729.77	-1,134,498,592.11

本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,515,000,002.19	-	-1,515,000,002.19
本期末	-420,392,325.11	-17,525,580.51	-437,917,905.62

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	1,075,416.83	1,201,062.07
定期存款利息收入	-	225,458.33
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	237,341.55	298,039.10
其他	30,441.42	34,344.20
合计	1,343,199.80	1,758,903.70

## 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	16,866,990,489.33	23,656,902,753.84
减：卖出股票成本总额	17,380,015,964.14	21,900,027,074.81
买卖股票差价收入	-513,025,474.81	1,756,875,679.03

## 7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	583,069,820.47	603,775,833.53

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	562,246,983.97	580,030,824.35
减：应收利息总额	18,524,620.47	13,466,481.29
买卖债券差价收入	2,298,216.03	10,278,527.89

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,728,415.02	6,014,656.57
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,728,415.02	6,014,656.57

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-555,723,729.77	194,232,648.69
——股票投资	-536,148,387.54	194,263,716.68
——债券投资	-19,575,342.23	-31,067.99
——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	-555,723,729.77	194,232,648.69

#### 7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	48,016,483.32	69,897,838.30
银行间市场交易费用	1,925.00	8,425.00
合计	48,018,408.32	69,906,263.30

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	3,133.23	7,896.68
银行间账户维护费	45,000.00	36,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
其他	4,300.00	2,850.00
分红手续费	4,545,000.01	810,000.00
持有人大会费	95,000.00	-
合计	5,152,433.24	1,316,746.68

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1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。

##### 7.4.8.2资产负债表日后事项

1.2017年1月6日财政部、国家税务总局颁布了《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，就其于2016年12月21日颁布的《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》(财税[2016]140号)中关于“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”的规定做出补充通知，要求2017年7月1日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

2.本基金于 2017 年 1 月 3 日终止上市，自终止上市之日起，基金名称变更为易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金，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》自同一起失效。

#### 7.4.9 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
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	基金托管人
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
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	2,319,292,002.34	7.10%	1,284,159,250.79	2.77%

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	1,988,860.37	7.04%	247,410.32	6.74%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	1,192,952.23	2.87%	693,299.41	5.93%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12 月31日	2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	44,389,322.35	71,700,164.91
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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12 月31日	2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,398,220.29	11,950,027.45

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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
报告期初持有的基金份额	219,110,562.00	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	219,110,562.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.95%	7.30%

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。

##### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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。

#### 7.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	87,111,232.62	1,075,416.83	290,142,282.83	1,201,062.07

注：本基金的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。

#### 7.4.10.6 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 2016年1月1日至2016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	002101	广东鸿图	配股发行	120,000	1,147,200.00
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	603313	恒康家居	新股网下发行	3,371	51,947.11
广发证券	603339	四方冷链	新股网下发行	2,793	28,460.67
上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016-02-15	2016-02-16	-	1.000	300,000,000.00	-	300,000,000.00	-
2	2016-03-01	2016-03-02	-	1.400	420,000,000.00	-	420,000,000.00	-
3	2016-03-16	2016-03-17	-	1.250	375,000,002.19	-	375,000,002.19	-
4	2016-03-23	2016-03-24	-	1.400	420,000,000.00	-	420,000,000.00	-
合计				5.050	1,515,000,002.19	-	1,515,000,002.19	-

## 7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016-12-21	2017-01-03	新股流通受限	4.00	4.00	1,000	4,000.00	4,000.00	-

## 7.4.12.2 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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-	-	290,200	11,136,153.1 8	11,178,504.0 0	-
300223	北京君正	2016-12-19	重大事项 停牌	48.40	-	-	832,859	30,179,214.5 9	40,310,375.6 0	-
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	15,700,064.3 7	15,863,000.0 1	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

##### 7.4.13.2 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，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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 2016 年 12 月 31 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%(2015 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 7.4.13.2.1 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	251,951,338.79	548,052,862.67
合计	251,951,338.79	548,052,862.67

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。

#### 7.4.13.2.2 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	312,996,779.39	571,110,839.03
合计	312,996,779.39	571,110,839.03

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。

#### 7.4.13.3 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，其余亦可在银行间同业市场交易，期末除 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	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	240,901,000.00	304,874,040.00	-	1,712,131,464.20	2,257,906,504.20
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	-	-	-	19,340,651.50	19,340,651.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	538,191,973.24	304,874,040.00	-	1,731,472,115.70	2,574,538,128.94
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	-	-	-	3,309,623.68	3,309,623.68
应付托管费	-	-	-	551,603.94	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	-	-	-	659,700.00	659,700.00
负债总计	-	-	-	12,456,034.56	12,456,034.56
利率敏感度缺口	538,191,973.24	304,874,040.00	-	1,719,016,081.14	2,562,082,094.38
<b>上年度末</b> <b>2015 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	290,142,282.83	-	-	-	290,142,282.83
结算备付金	22,980,263.13	-	-	-	22,980,263.13
存出保证金	3,138,229.38	-	-	-	3,138,229.38
交易性金融资产	535,502,233.40	549,792,000.00	2,272,692.80	3,811,831,747.36	4,899,398,673.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	15,000,210.97	15,000,210.97
应收利息	-	-	-	31,633,774.67	31,633,774.67
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	851,763,008.74	549,792,000.00	2,272,692.80	3,858,465,733.00	5,262,293,434.54

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	-	-	-	29,353,849.66	29,353,849.66
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	6,604,305.56	6,604,305.56
应付托管费	-	-	-	1,100,717.58	1,100,717.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	11,695,934.20	11,695,934.20
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	-	-	-	650,000.00	650,000.00
负债总计	-	-	-	50,712,745.86	50,712,745.86
利率敏感度缺口	851,763,008.74	549,792,000.00	2,272,692.80	3,807,752,987.14	5,211,580,688.68

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	1.市场利率下降25个基点		1,384,409.89
2.市场利率上升25个基点		-1,374,162.75	-2,916,069.60

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,712,131,464.20	66.83	3,811,831,747.36	73.14
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	1,712,131,464.20	66.83	3,811,831,747.36	73.14

#### 7.4.13.4.3.2 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	107,233,287.29	173,200,979.66
2.业绩比较基准下降 5%	-107,233,287.29	-173,200,979.66	

注：股票投资业绩基准取上证 A 指。

#### 7.4.14 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 2016 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 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(2015 年 12 月 31 日：第一层次 2,971,457,694.36 元，第二层次 1,927,940,979.20 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 2016 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(2015 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	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	20,434,540.25	0.79
8	合计	2,574,538,128.94	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	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

## 8.3 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	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
11	600997	开滦股份	5,100,389	36,467,781.35	1.42
12	300458	全志科技	372,000	34,011,960.00	1.33
13	300236	上海新阳	856,400	32,971,400.00	1.29
14	300025	华星创业	2,565,502	28,220,522.00	1.10
15	600759	洲际油气	2,800,000	27,496,000.00	1.07
16	601009	南京银行	2,450,000	26,558,000.00	1.04
17	000661	长春高新	237,000	26,508,450.00	1.03
18	600183	生益科技	2,200,000	24,200,000.00	0.94
19	600497	驰宏锌锗	3,067,420	21,563,962.60	0.84
20	600584	长电科技	1,200,000	21,180,000.00	0.83
21	002260	德奥通航	900,000	20,790,000.00	0.81
22	300097	智云股份	370,829	20,325,137.49	0.79
23	600104	上汽集团	853,400	20,012,230.00	0.78
24	600016	民生银行	2,200,000	19,976,000.00	0.78
25	000581	威孚高科	880,000	19,747,200.00	0.77
26	600409	三友化工	2,050,000	19,249,500.00	0.75

27	600458	时代新材	1,275,181	18,043,811.15	0.70
28	300199	翰宇药业	1,000,000	17,980,000.00	0.70
29	002036	联创电子	920,000	17,627,200.00	0.69
30	601818	光大银行	4,500,000	17,595,000.00	0.69
31	002758	华通医药	590,000	17,487,600.00	0.68
32	600976	健民集团	540,458	17,256,823.94	0.67
33	000933	*ST 神火	3,100,000	17,205,000.00	0.67
34	600547	山东黄金	450,000	16,429,500.00	0.64
35	600211	西藏药业	300,000	16,242,000.00	0.63
36	002353	杰瑞股份	800,000	16,240,000.00	0.63
37	603986	兆易创新	89,133	15,863,000.01	0.62
38	600276	恒瑞医药	338,605	15,406,527.50	0.60
39	000568	泸州老窖	464,600	15,331,800.00	0.60
40	300313	天山生物	799,936	15,198,784.00	0.59
41	600123	兰花科创	1,799,957	14,471,654.28	0.56
42	300164	通源石油	1,397,800	14,453,252.00	0.56
43	002422	科伦药业	887,000	14,298,440.00	0.56
44	600056	中国医药	750,000	14,272,500.00	0.56
45	600585	海螺水泥	800,000	13,568,000.00	0.53
46	002376	新北洋	1,080,117	13,393,450.80	0.52
47	000807	云铝股份	1,877,770	12,581,059.00	0.49
48	000630	铜陵有色	3,700,000	11,396,000.00	0.44
49	000089	深圳机场	1,400,000	11,200,000.00	0.44
50	300065	海兰信	290,200	11,178,504.00	0.44
51	300106	西部牧业	690,000	11,129,700.00	0.43
52	002640	跨境通	600,000	10,980,000.00	0.43
53	000400	许继电气	600,000	10,890,000.00	0.43
54	601225	陕西煤业	2,199,901	10,669,519.85	0.42
55	300138	晨光生物	559,908	10,207,122.84	0.40
56	600141	兴发集团	661,052	10,054,600.92	0.39
57	600500	中化国际	850,000	9,911,000.00	0.39
58	600596	新安股份	900,000	9,216,000.00	0.36
59	002217	合力泰	500,000	8,950,000.00	0.35
60	002659	中泰桥梁	380,000	8,770,400.00	0.34
61	300327	中颖电子	259,990	8,683,666.00	0.34
62	000651	格力电器	350,000	8,617,000.00	0.34
63	600295	鄂尔多斯	900,000	8,541,000.00	0.33
64	300059	东方财富	500,000	8,465,000.00	0.33
65	002535	林州重机	1,300,000	8,463,000.00	0.33
66	601600	中国铝业	1,999,976	8,439,898.72	0.33
67	600285	羚锐制药	660,000	8,421,600.00	0.33
68	600062	华润双鹤	360,000	8,002,800.00	0.31
69	300481	濮阳惠成	240,000	7,992,000.00	0.31
70	600209	罗顿发展	600,000	7,698,000.00	0.30

71	000601	韶能股份	800,000	6,872,000.00	0.27
72	000937	冀中能源	1,000,000	6,740,000.00	0.26
73	600782	新钢股份	2,000,000	6,680,000.00	0.26
74	600961	株冶集团	566,500	6,344,800.00	0.25
75	601595	上海电影	150,000	5,943,000.00	0.23
76	000878	云南铜业	500,000	5,905,000.00	0.23
77	002127	南极电商	500,000	5,740,000.00	0.22
78	601601	中国太保	200,000	5,554,000.00	0.22
79	300007	汉威电子	277,800	5,380,986.00	0.21
80	002234	民和股份	245,491	5,297,695.78	0.21
81	002550	千红制药	700,000	5,054,000.00	0.20
82	002074	国轩高科	160,000	4,958,400.00	0.19
83	300373	扬杰科技	250,000	4,920,000.00	0.19
84	601166	兴业银行	300,000	4,842,000.00	0.19
85	300069	金利华电	100,000	4,725,000.00	0.18
86	000759	中百集团	500,000	4,640,000.00	0.18
87	600057	象屿股份	400,000	4,600,000.00	0.18
88	000401	冀东水泥	379,954	4,521,452.60	0.18
89	000902	新洋丰	400,000	4,504,000.00	0.18
90	000417	合肥百货	500,000	4,315,000.00	0.17
91	002475	立讯精密	199,844	4,146,763.00	0.16
92	300089	文化长城	220,000	4,050,200.00	0.16
93	600889	南京化纤	300,000	3,945,000.00	0.15
94	002648	卫星石化	320,000	3,910,400.00	0.15
95	601998	中信银行	600,000	3,846,000.00	0.15
96	601388	怡球资源	1,000,000	3,830,000.00	0.15
97	600563	法拉电子	100,000	3,667,000.00	0.14
98	002391	长青股份	200,000	3,496,000.00	0.14
99	002458	益生股份	100,000	3,440,000.00	0.13
100	002588	史丹利	300,000	3,405,000.00	0.13
101	002352	鼎泰新材	80,000	3,323,200.00	0.13
102	002601	佰利联	259,950	3,290,967.00	0.13
103	300461	田中精机	49,945	3,187,989.35	0.12
104	002600	江粉磁材	300,000	3,072,000.00	0.12
105	600176	中国巨石	300,000	2,952,000.00	0.12
106	300398	飞凯材料	43,618	2,540,312.32	0.10
107	600667	太极实业	300,000	2,313,000.00	0.09
108	600110	诺德股份	200,000	2,132,000.00	0.08
109	300115	长盈精密	79,997	2,084,721.82	0.08
110	002371	七星电子	70,000	1,862,000.00	0.07
111	300192	科斯伍德	120,300	1,816,530.00	0.07
112	300219	鸿利智汇	150,000	1,627,500.00	0.06
113	300395	菲利华	40,000	926,800.00	0.04
114	300346	南大光电	30,000	913,200.00	0.04

115	601699	潞安环能	100,000	805,000.00	0.03
116	000825	太钢不锈	200,000	788,000.00	0.03
117	002123	梦网荣信	50,000	750,000.00	0.03
118	600362	江西铜业	43,605	729,511.65	0.03
119	603718	海利生物	40,000	712,800.00	0.03
120	603026	石大胜华	10,000	397,400.00	0.02
121	000567	海德股份	10,000	375,800.00	0.01
122	603806	福斯特	4,000	185,080.00	0.01
123	300528	幸福蓝海	4,500	145,215.00	0.01
124	300548	博创科技	754	63,773.32	0.00
125	603859	能科股份	1,121	59,895.03	0.00
126	300537	广信材料	1,024	49,960.96	0.00
127	601375	中原证券	1,000	4,000.00	0.00

#### 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	000933	*ST 神火	181,615,787.83	3.48
2	300073	当升科技	173,374,295.93	3.33
3	300097	智云股份	155,679,060.98	2.99
4	000983	西山煤电	155,651,485.14	2.99
5	600549	厦门钨业	151,525,858.98	2.91
6	002601	佰利联	148,684,090.28	2.85
7	002340	格林美	128,795,195.09	2.47
8	600395	盘江股份	124,019,381.57	2.38
9	000807	云铝股份	117,614,883.40	2.26
10	300236	上海新阳	117,552,548.95	2.26
11	000567	海德股份	116,343,923.02	2.23
12	300033	同花顺	115,576,051.83	2.22
13	002384	东山精密	115,476,922.97	2.22
14	002224	三力士	114,796,710.20	2.20
15	603799	华友钴业	114,718,055.44	2.20
16	002077	大港股份	111,829,417.28	2.15
17	300458	全志科技	111,491,754.41	2.14
18	300231	银信科技	107,272,764.31	2.06
19	300014	亿纬锂能	106,125,630.46	2.04
20	002643	万润股份	104,011,038.90	2.00

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	300073	当升科技	200,348,646.52	3.84
2	300113	顺网科技	176,528,438.28	3.39
3	300097	智云股份	166,866,499.67	3.20
4	002601	佰利联	163,942,407.19	3.15
5	000933	*ST 神火	159,583,514.34	3.06
6	000983	西山煤电	154,670,239.12	2.97
7	600391	成发科技	146,998,216.36	2.82
8	600549	厦门钨业	144,793,460.39	2.78
9	002329	皇氏集团	141,270,419.37	2.71
10	000858	五 粮 液	135,588,519.18	2.60
11	002340	格林美	132,222,229.76	2.54
12	002224	三 力 士	129,139,412.48	2.48
13	000567	海德股份	126,453,642.33	2.43
14	603799	华友钴业	123,926,027.66	2.38
15	600395	盘江股份	123,606,928.87	2.37
16	300364	中文在线	122,029,316.90	2.34
17	300014	亿纬锂能	120,337,624.93	2.31
18	300033	同花顺	114,763,341.43	2.20
19	300242	明家联合	112,251,864.06	2.15
20	300199	翰宇药业	111,227,038.12	2.13
21	002643	万润股份	110,347,565.99	2.12
22	002494	华斯股份	110,228,608.12	2.12
23	300367	东方网力	107,131,025.86	2.06
24	000807	云铝股份	105,824,048.10	2.03

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	15,816,464,068.52
卖出股票收入（成交）总额	16,866,990,489.33

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**

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

**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**

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

**8.7 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。

**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 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	1,093,888.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,340,651.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,434,540.25

**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**

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

## § 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
21,110	142,112.74	1,625,990,684.00	54.20%	1,374,009,316.00	45.80%

## 9.2 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	332,286,942.00	11.08%
2	易方达基金管理有限公司	148,612,662.00	4.95%
3	泰康人寿保险股份有限公司—传统— 普通保险产品—019L—CT001 沪	105,558,957.00	3.52%
4	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%
5	中国人寿保险股份有限公司	80,609,888.00	2.69%
6	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	57,549,602.00	1.92%
7	建信人寿保险有限公司—普通	56,294,025.00	1.88%
8	中国太平洋财产保险股份有限公司— 传统—普通保险产品—013C—CT001 沪	52,200,623.00	1.74%
9	泰康人寿保险股份有限公司—万能— 一个险万能	48,574,561.00	1.62%
10	工银瑞信基金—农业银行—吉祥人寿 保险—吉祥人寿传统产品	43,022,292.00	1.43%

## 9.3 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%

## 9.4 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 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，自 2016 年 8 月 31 日起至 2016 年 10 月 10 日 17:00 止（投票表决时间以基金管理人指定的表决票收件人收到表决票时间为准）进行了投票表决。会议审议通过了《关于科瑞证券投资基金转型有关事项的议案》，同意按照《科瑞证券投资基金转型方案说明书》对基金科瑞实施转型，主要包括转换基金运作方式及变更基金名称，调整基金存续期限，申请终止或提前终止基金的上市交易并进行变更登记，增加申购、赎回等业务安排，调整投资目标、投资范围、投资策略等条款，变更收益分配条款，调整管理费和托管费计提方式等。为实施基金科瑞转型方案，同意授权基金管理人办理本次基金科瑞转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型实施的具体时间并办理与转型相关的所有具体事宜，以及根据《科瑞证券投资基金转型方案说明书》的有关内容和法律法规的规定，对《科瑞证券投资基金基金合同》进行修改和补充。

根据上述表决，本次基金份额持有人大会决定的事项自 2016 年 10 月 11 日起正式生效。

### 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 2016 年 4 月 30 日发布公告，自 2016 年 4 月 30 日起聘任詹余引先生担任公司董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚先生不再担任公司副总经理；于 2016 年 8 月 27 日发布公告，自 2016 年 8 月 27 日起聘任吴欣荣先生担任公司副总经理。

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

本基金自基金合同生效以来连续 15 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 100,000.00 元。

## 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	
国泰君安	2	1,758,532,834.96	5.38%	1,637,720.35	5.80%	-
招商证券	1	225,087,317.39	0.69%	209,624.29	0.74%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	292,848,777.52	0.90%	272,731.28	0.97%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	1,156,216,060.80	3.54%	924,970.77	3.27%	-
国联证券	1	1,252,855,761.54	3.83%	1,166,780.91	4.13%	-
华龙证券	1	126,047,039.69	0.39%	100,837.63	0.36%	-
国信证券	1	3,393,426,760.65	10.39%	3,160,302.21	11.19%	-
瑞银证券	1	1,092,805,043.28	3.34%	874,243.42	3.09%	-
天风证券	1	2,509,866,068.40	7.68%	2,007,891.06	7.11%	-
华鑫证券	1	961,458,722.67	2.94%	769,166.18	2.72%	-
大通证券	1	841,246,457.50	2.57%	672,996.60	2.38%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	155,588,781.36	0.48%	144,899.41	0.51%	-
平安证券	1	1,615,641,084.69	4.94%	1,504,648.58	5.33%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	3,283,668,581.90	10.05%	2,896,457.98	10.25%	-
银河证券	1	341,065,678.24	1.04%	317,633.70	1.12%	-
光大证券	1	2,379,235,069.36	7.28%	2,215,775.69	7.84%	-
中原证券	1	553,986,802.19	1.70%	443,189.67	1.57%	-
东北证券	1	821,763,328.09	2.51%	657,410.27	2.33%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	507,132,394.09	1.55%	472,293.46	1.67%	-
长城证券	1	959,679,870.35	2.94%	893,748.63	3.16%	-
广发证券	1	2,319,292,002.34	7.10%	1,988,860.37	7.04%	-
国元证券	1	129,518,142.00	0.40%	120,621.22	0.43%	-
华创证券	1	2,351,702,895.00	7.20%	1,881,361.03	6.66%	-

海通证券	1	3,645,878,203.28	11.16%	2,916,698.76	10.32%	-
------	---	------------------	--------	--------------	--------	---

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增东北证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、瑞银证券有限责任公司、天风证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司各一个交易单元。

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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

#### 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	2016-01-05
2	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	2016-01-08
3	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	2016-01-12
4	科瑞证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-23
5	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	2016-01-28
6	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	2016-01-29
7	科瑞证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-02

8	科瑞证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-02-25
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	2016-02-26
10	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购厦门瑞尔特卫浴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	2016-03-02
11	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	2016-03-05
12	科瑞证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-11
13	科瑞证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-18
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏赛福天钢索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	2016-03-25
15	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	2016-04-22
16	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
17	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	2016-04-30
18	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	2016-04-30
19	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	2016-05-04
20	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购南通四方冷链装备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	2016-05-12
21	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	2016-05-19
22	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	2016-06-01

		理人网站	
23	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购上海沪工焊接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	2016-06-01
24	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购深圳市盛讯达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	2016-06-21
25	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	2016-07-07
26	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	2016-07-27
27	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	2016-07-29
28	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	2016-08-27
29	易方达基金管理有限公司关于召开科瑞证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-08-31
30	科瑞证券投资基金持续停牌提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-08-31
31	易方达基金管理有限公司关于召开科瑞证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-01
32	易方达基金管理有限公司关于召开科瑞证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-02
33	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江苏恒康家居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	2016-09-30
34	易方达基金管理有限公司关于科瑞证券投资基金复牌的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-10-12
35	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-10-12
36	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	2016-10-19
37	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分	中国证券报、上海证券	2016-11-29

	基金估值调整情况的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
38	科瑞证券投资基金终止上市公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-26
39	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信息的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-26
40	易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-26
41	关于科瑞证券投资基金终止上市的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-28
42	关于科瑞证券投资基金终止上市的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-30

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.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；
- 2.中国证券监督管理委员会《关于同意科瑞证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2001] 59号文）；
- 3.《科瑞证券投资基金基金合同》；
- 4.《科瑞证券投资基金托管协议》；
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 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

二〇一七年三月三十一日