

易方达科讯混合型证券投资基金

2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年十月二十六日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2016 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达科讯混合
基金主代码	110029
交易代码	110029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 12 月 18 日
报告期末基金份额总额	5,652,160,539.56 份
投资目标	根据市场环境变化，综合运用多种投资策略，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金综合运用多种投资策略，把握多种投资机会。股票投资策略方面，一般情况下以优势企业策略和成长策略为主，辅以行业周期策略、绝对价值策略、突发事件/收购兼并策略以及新兴技术策略。在特定的市场情况下，后四种策略中一种或多种的

	资金容量较大、不确定性较小、收益预期较高时，也可成为主策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合基金，理论上其风险收益水平高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2016 年 7 月 1 日-2016 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-248,108,226.73
2.本期利润	-532,737,558.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0891
4.期末基金资产净值	6,841,799,236.87
5.期末基金份额净值	1.2105

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.本基金已于 2008 年 1 月 4 日对原基金科讯退市时的基金份额进行了拆分，基金拆分比例为 1：2.825206742。

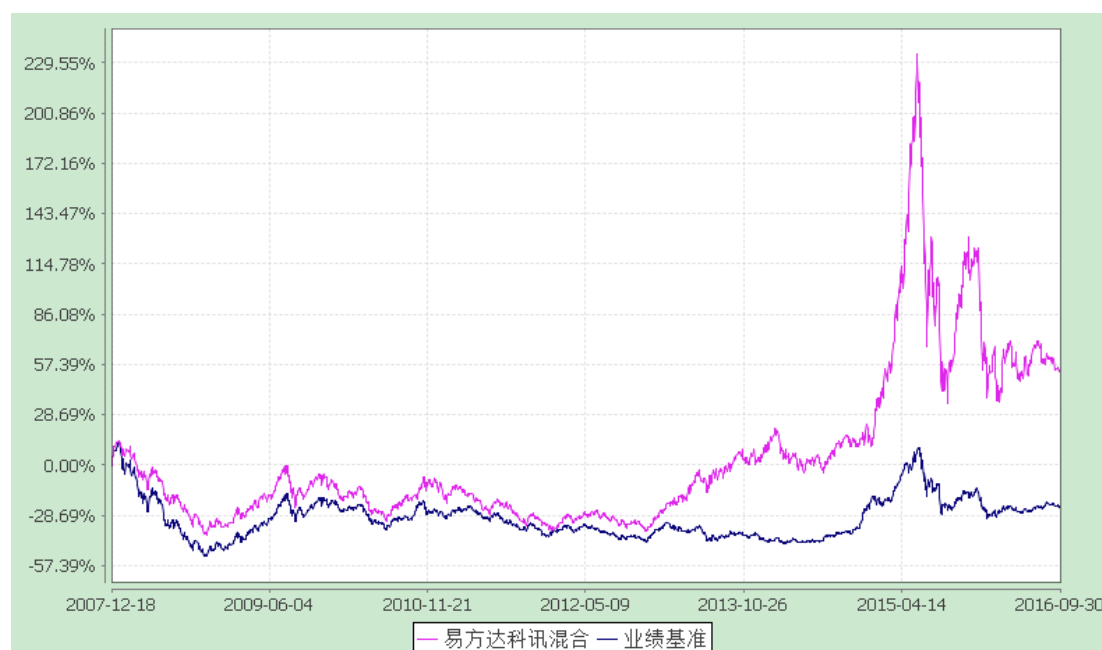
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-6.91%	1.04%	2.77%	0.64%	-9.68%	0.40%

3.2.2 自基金转型以来基金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

易方达科讯混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2007 年 12 月 18 日至 2016 年 9 月 30 日)



注：1.本基金由原基金科讯于 2007 年 12 月 18 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 54.29%，同期业绩比较基准收益率为-23.41%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋昆	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、易方达新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、公募基金投资部总经理	2010-09-11	-	10 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、公募基金投资部总经理助理、公募基金投资部副总经理、易方达创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 1 次，为指数量化投资因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年三季度，上证综指上涨 2.56%，深证综指上涨 1.08%，沪深 300 指数上涨 3.15%，创业板指下跌 3.50%，指数整体呈震荡态势。板块方面，三季度中信一级行业中，房地产、煤炭、家电、建筑、建材等板块涨幅居前，计算机、有色金属、国防军工、传媒等板块跌幅较大。

本基金延续了一贯的投资思路，我们认为在中国经济转型过程中战略新兴产业将成为增长的重要驱动力，其中的龙头公司有望脱颖而出成为牛股，也是基金重点关注的对象。与此同时，报告期内本基金根据市场变化，在股票仓位和行业配置上做出了调整应对。

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 1.2105 元，本报告期份额净值增长率为 -6.91%，同期业绩比较基准收益率为 2.77%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,440,152,286.62	89.54
	其中：股票	6,440,152,286.62	89.54
2	固定收益投资	330,183,183.24	4.59
	其中：债券	330,183,183.24	4.59

	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	-	-
	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	374,750,943.44	5.21
7	其他资产	47,482,027.58	0.66
8	合计	7,192,568,440.88	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	30,896,000.00	0.45
B	采矿业	17,650,012.00	0.26
C	制造业	2,575,290,686.34	37.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,780,400.00	0.04
E	建筑业	16,215,735.02	0.24
F	批发和零售业	68,099,984.15	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,748,000.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,481,917,072.30	36.28
J	金融业	7,643,921.93	0.11
K	房地产业	32,157,261.05	0.47
L	租赁和商务服务业	20,415,000.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	120,100,358.34	1.76
N	水利、环境和公共设施管理业	65,044,028.39	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	889,062,886.18	12.99
R	文化、体育和娱乐业	110,721,940.92	1.62
S	综合	409,000.00	0.01
	合计	6,440,152,286.62	94.13

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300015	爱尔眼科	12,020,172	420,225,213.12	6.14
2	300113	顺网科技	12,127,240	405,833,355.10	5.93
3	300068	南都电源	18,268,169	393,496,360.26	5.75
4	002280	联络互动	20,425,000	350,998,750.00	5.13
5	300383	光环新网	9,000,000	305,910,000.00	4.47
6	002530	丰东股份	8,599,627	257,988,810.00	3.77
7	600763	通策医疗	8,000,000	251,440,000.00	3.68
8	300007	汉威电子	10,000,000	230,200,000.00	3.36
9	601012	隆基股份	16,294,395	219,974,332.50	3.22
10	300024	机器人	7,986,000	187,990,440.00	2.75

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	329,967,000.00	4.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	216,183.24	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	330,183,183.24	4.83

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019546	16 国债 18	3,300,000	329,967,000.00	4.82
2	128009	歌尔转债	1,638	216,183.24	0.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,145,382.15
2	应收证券清算款	42,845,812.32
3	应收股利	-
4	应收利息	1,159,344.21
5	应收申购款	2,331,488.90

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,482,027.58

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	128009	歌尔转债	216,183.24	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分 的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限 情况说明
1	002280	联络互动	346,001,250.00	5.06	非公开发 行流通受 限
2	300024	机器人	187,990,440.00	2.75	非公开发 行流通受 限
3	300113	顺网科技	113,672,661.75	1.66	非公开发 行流通受 限
4	002280	联络互动	4,997,500.00	0.07	重大事项 停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	6,088,914,255.11
报告期基金总申购份额	325,167,403.77
减：报告期基金总赎回份额	761,921,119.32
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	5,652,160,539.56

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	72,448,816.90
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	36,000,000.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	36,448,816.90
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.64

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	赎回	2016-09-01	-36,000,000.00	-45,183,600.00	-
合计			-36,000,000.00	-45,183,600.00	

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会《关于核准科讯证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2007]330 号);
2. 《易方达科讯混合型证券投资基金基金合同》;
3. 《易方达科讯混合型证券投资基金托管协议》;
4. 中国证监会《关于同意科汇、科讯、科翔证券投资基金上市、扩募和续期的批复》(证监基金字[2001]11 号文);
5. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
6. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

8.2 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。

8.3 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

二〇一六年十月二十六日