易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达量化策略精选混合	
基金主代码	002216	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12月19日	
报告期末基金份额总额	170,137,009.12份	
投资目标	本基金采用量化策略进行投资组合管理,追求基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	量化策略是指根据金融市场历史数据,借助量化模型,进行金融市场的分析、判断和交易的策略。本基金基于不同市场情况,精选多种量化模型进行投资,运用的量化模型包括但不限于量化资产配置模型、多因子量化模型、行业轮动模型、事件超额收益模型。精选多种量化模型进行投资的原因,一是建立多种量化策略可以弥补单一量化策略失效的可能,并形成互补,保证整体投资业绩的持续性;二是精选多种量化策略进行投资,量化策略之间相关性越低,组合的整体风险越分散,有利于追求基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	易方达量化策略精选混合A	易方达量化策略精选混合C
下属分级基金的交易代码	002216	002217
报告期末下属分级基金的份额总额	141,712,553.50份	28,424,455.62份

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	易方达量化策略精选混合A	易方达量化策略精选混合C
1.本期已实现收益	-17,620,787.07	-3,701,950.83
2.本期利润	-8,836,184.23	-1,859,346.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0606	-0.0618
4.期末基金资产净值	117,137,285.53	23,400,620.58
5.期末基金份额净值	0.827	0.823

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。

3.2 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

易方达量化策略精选混合A

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	-6.87%	1.35%	-0.75%	0.82%	-6.12%	0.53%

易方达量化策略精选混合C

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	-7.01%	1.34%	-0.75%	0.82%	-6.26%	0.52%

3.2.2 自基金合同生效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

易方达量化策略精选灵活配置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

(2017年12月19日至2018年9月30日)

易方达量化策略精选混合A

易方达量化策略精选混合C

注:1.本基金合同于2017年12月19日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

3. 自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为-17.30%,C类基金份额净值增长率为-17.70%,同期业绩比较基准收益率为-6.81%。

§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		
官泽帆	本基金的基金经理、易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达沪深300量化增强证券投资基金的基金经理	2017-12-19	-	8年	硕士研究生,曾任招商基金管理有限公司投资开发工程师,摩根士丹利华鑫基金管理有限公司数量化研究员、基金经理助理,易方达基金管理有限公司易方达沪深300量化增强证券投资基金基金经理助理。

注:1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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。本基金管理人制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,通过投资交易系统中的公平交易模块,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24次,其中23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,1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 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

回顾本报告期,国内经济略显疲态,9月最新公布的制造业PMI指数为50.8%,较前几个月出现明显回落,低于市场预期;生产、需求、进口、出口分项均处于近两年震荡中枢的下方,经济景气程度相对回落。经济下行压力扩大,近期刺激提振经济的相关政策也频繁出台。监管政策方面,理财新规延续监管边际放松的基调;税收政策上,李克强总理再度表示下一步要更大力度简政、减税、减费,考虑降低增值税税率。外围环境同样趋紧,中美贸易摩擦持续升级,9月18日美方宣布对约2000亿美元中国商品加征关税,同时与其他经济体进行多边联合的意图显著,未来争端局势演化的不确定性仍然较大。

在国内外诸多因素冲击下,2018年2月以来A股开启新一轮下跌,同时经历数次风格变换。整体而言,三季度上证综指微跌0.92%,上证50上涨5.11%,沪深300下跌2.05%,上半年表现相对较好的创业板指则大幅下挫12.16%,中证500、中证1000也分别下跌7.99%和11.08%,市场整体表现结构分化显著。行业板块来看,大多数行业受市场环境影响持续下跌,上季度仍表现强势的食品饮料、家电、医药在本季度也开启补跌行情,金融板块则逆势上涨。本季度的市场分化在因子角度也表现得比较明显,市场风格上,大市值、低PB、低流动性、低波动的风格跑出超额收益,全年来看,市值和估值因子在进入下半年后出现了大幅的反弹。前期表现强势的alpha因子却都在本季度开始走弱,上半年贡献主要超额收益的盈利质量因子如ROE、ROA均出现了较大幅度的回撤。

本基金立足长期增长逻辑,顺应市场风格趋势进行配置,优选经营稳健、盈利质量高的个股,相对超配食品饮料、医药行业,低配银行、非银板块,本季度受系统性市场冲击,表现略低于预期。近期市场整体估值水平已随本轮下跌滑落至历史相对低位,我们的量化模型将根据市场风格适当进行切换,捕捉反弹机会。本基金坚持采用长期有效的基本面量化模型进行选股,配置稳健的策略模型优选蓝筹白马,力争为投资人创造持续稳健的超额收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为0.827元,本报告期份额净值增长率为-6.87%;C类基金份额净值为0.823元,本报告期份额净值增长率为-7.01%;同期业绩比较基准收益率为-0.75%,各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

§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	127,266,609.76	90.02
	其中:股票	127,266,609.76	90.02
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	14,086,848.27	9.96
7	其他资产	27,972.13	0.02
8	合计	141,381,430.16	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	505,344.00	0.36
B	采矿业	1,334,288.00	0.95
C	制造业	83,435,462.62	59.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,605,600.00	1.14
E	建筑业	422,304.20	0.30
F	批发和零售业	6,937,522.00	4.94
G	交通运输、仓储和邮政业	912,222.00	0.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,826,826.14	6.28
J	金融业	13,209,539.00	9.40
K	房地产业	2,175,562.00	1.55
L	租赁和商务服务业	5,278,593.00	3.76
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,203,212.00	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,186,363.00	0.84
R	文化、体育和娱乐业	78,019.00	0.06
S	综合	155,752.80	0.11
	合计	127,266,609.76	90.56

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	000651	格力电器	154,400	6,206,880.00	4.42
2	000661	长春高新	17,500	4,147,500.00	2.95
3	600519	贵州茅台	5,500	4,015,000.00	2.86
4	601318	中国平安	56,800	3,890,800.00	2.77
5	601888	中国国旅	49,000	3,332,980.00	2.37
6	000568	泸州老窖	67,600	3,211,676.00	2.29
7	601336	新华保险	61,600	3,109,568.00	2.21
8	601009	南京银行	391,100	2,991,915.00	2.13
9	600426	华鲁恒升	172,700	2,972,167.00	2.11
10	000596	古井贡酒	34,300	2,854,789.00	2.03

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

5.11.12018年1月9日,江苏银监局针对南京银行股份有限公司镇江分行违法违规办理票据业务,严重违反审慎经营规则的违法违规事实处以人民币3230万元的行政处罚。

2017年11月9日,人民银行南京分行营业管理部针对南京银行的如下事由对南京银行给予警告并处罚款人民币30万元:(一)下属支行作为异地存款银行的开户银行,涉及47户银行同业账户;(二)未见存款银行经营范围批准文件,涉及48户银行同业账户;(三)未采取多种措施对开户证明文件的真实性、完整性和合规性以及存款银行开户意愿真实性进行审核,涉及48户银行同业账户;(四)对账地址(联系地址)不是存款银行经营所在地或工商注册地址,涉及34户银行同业账户;(五)未执行开户生效日制度,涉及1户银行同业账户;(六)未执行久悬制度,涉及6户银行同业账户。

本基金投资南京银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除南京银行外,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。

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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,931.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,640.32
5	应收申购款	5,399.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,972.13

5.11.4报告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。

5.11.5报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达量化策略精选混合A	易方达量化策略精选混合C
报告期期初基金份额总额	137,802,053.98	32,062,046.46
报告期基金总申购份额	12,153,580.74	2,357,513.33
减:报告期基金总赎回份额	8,243,081.22	5,995,104.17
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	141,712,553.50	28,424,455.62

§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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年07月01日~2018年09月30日	49,999,000.00	-	-	49,999,000.00	29.39%
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,可能带来流动性风险;如个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务办理;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形;持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达量化策略精选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。

9.2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。

9.3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
二〇一八年十月二十四日

易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达恒信定开债券发起式
基金主代码	005740
交易代码	005740
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年3月27日
报告期末基金份额总额	2,009,999,000.00份
投资目标	本基金为纯债基金,管理人主要通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在封闭运作期与开放运作期采取不同的投资策略。封闭期内,本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。本基金将对资金面进行综合分析的基础上,比较债券收益率、存款利率和融资成本,判断利差空间,力争通过杠杆操作提高组合收益。在衍生品投资上,本基金将根据风险管理的原则,主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易,以对冲投资组合的系统性风险、有效管理组合流动性风险或调整组合久期中的冲击成本等。开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债新综合指数(全价)收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	21,241,801.49
2.本期利润	38,291,929.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0191
4.期末基金资产净值	2,064,558,234.60
5.期末基金份额净值	1.0271

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。

3.2 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	1.88%	0.07%	0.57%	0.07%	1.31%	0.00%

3.2.2自基金合同生效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

易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金

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

(2018年3月27日至2018年9月30日)

注:1.本基金合同于2018年3月27日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为2.71%,同期业绩比较基准收益率为1.61%。

§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		
李一硕	本基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理助理	2018-03-27	-	10年	硕士研究生,曾任瑞银证券有限公司研究员,中国国际金融有限公司研究员,易方达基金管理有限公司研究员、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达裕如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"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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。本基金管理人制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,通过投资交易系统中的公平交易模块,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24次,其中23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,1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 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

2018年三季度我国宏观经济仍然面临一定的不确定性。7-8月工业增加值同比增速位于6-6.1%左右的偏低水平,季度环比数据则相对更弱。三季度以来固定资产投资增速进一步下行,其中基建投资的不断下滑是主要推动原因,值得特别关注。房地产投资及制造业投资则相对稳定,但2017年四季度制造业投资增速明显上行,将对今年未来几个月的同比数据构成压力。外贸方面,此前较为稳定的出口增速在8月份也有所回落。此前市场担忧较多的社融数据近期同比增速开始企稳,但结构上仍然难言乐观,其中信托及委托贷款维持下滑态势,票据冲量的现象依旧较为明显。通胀数据在三季度以来小幅升温,结构上食品及非食品部分均高于预期。

三季度央行仍然维持了相对宽松的货币环境,债券市场流动性较为充裕。7月份市场收益率整体下行,随后8-9月份有所回升,反映出市场投资者对于宏观经济走势仍抱有信心。在三季度收益率波动的过程中,中短端品种整体表现较好,收益率曲线由此前极为平坦的形态趋向于正常。由于信用事件的发生频率仍然偏高,信用利差并未收窄,评级间利差依然保持在相对偏高的水平上。

操作上,组合主要以配置中短期限信用债为主,以获取票息收益为主要投资策略。

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1.0271元,本报告期份额净值增长率为1.88%,同期业绩比较基准收益率为0.57%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	2,798,489,500.00	96.22
	其中:债券	2,798,489,500.00	96.22
	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	24,906,711.97	0.86
7	其他资产	84,921,082.79	2.92
8	合计	2,908,317,294.76	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	220,416,000.00	10.68
	其中:政策性金融债	220,416,000.00	10.68
4	企业债券	1,265,253,500.00	61.28
5	企业短期融资券	554,081,000.00	26.84
6	中期票据	758,739,000.00	36.75
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,798,489,500.00	135.55

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	180209	18国开09	1,600,000	160,272,000.00	7.76
2	101800642	18中铝集MTN001	1,200,000	122,628,000.00	5.94
3	143520	18金地01	1,200,000	122,316,000.00	5.92
4	101800384	18普洛斯洛华MTN002	1,000,000	101,060,000.00	4.89
5	101800378	18津城建MTN009	1,000,000	100,530,000.00	4.87

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本基金本报告期没有投资股票。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	150,664.56
2	应收证券清算款	40,988,186.71
3	应收股利	-
4	应收利息	43,782,231.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,921,082.79

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,009,999,000.00
报告期基金总申购份额	-
减:报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	2,009,999,000.00

§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	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.50

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.4975%	10,000,000.00	0.4975%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.4975%	10,000,000.00	0.4975%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018年07月01日~2018年09月30日	1,999,999,000.00	-	-	1,999,999,000.00	99.50%
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,可能带来流动性风险;如个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务办理;本基金基金合同生效满三年后继续存续时,若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形;持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、定期开放运作的风险

(1)本基金以定期开放方式运作且不上市交易,投资者仅可在开放运作期申赎基金份额,在封闭运作期内无法申购赎回。若投资者在开放运作期未赎回基金份额,则需继续持有至下一封闭运作期结束才能赎回,投资者在封闭运作期内存在无法赎回基金份额的风险。

(2)基金合同生效后的首个运作期为封闭运作期,自基金合同生效日至基金管理人规定的时间,首个封闭运作期可能少于或者超过3个月,投资者应仔细阅读相关法律文件及公告,并及时行使相关权利。

(3)除首个运作期封闭运作外,本基金的运作期包含"封闭运作期"和"开放运作期",运作期期限3个月,基金管理人在每个封闭运作期结束前公布开放运作期和下一封闭运作期的具体时间安排,由于市场环境等因素的影响,本基金每次开放运作期和封闭运作期的时间及长度不完全一样,投资者应关注相关公告并及时行使权利,否则会面临无法申购/赎回基金份额的风险。

2、单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过50%的风险

(1)本基金单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过50%,单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者大额赎回时,可能会对本基金资产运作及净值表现产生较大影响。

(2)巨额赎回的风险

相对于其他基金,本基金更可能因开放期内单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者集中大额赎回发生巨额赎回。当发生巨额赎回时,基金管理人可能根据基金当时的资产组合状况决定延缓支付赎回款,投资者面临赎回款被延缓支付的风险。

3、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同的风险

(1)本基金的销售对象主要为机构投资者,不向个人投资者公开发售,基金持续营销及募集规模可能受到影响,若基金合同生效之日起三年后的对应日基金资产净值低于2亿元,基金合同自动终止且不得通过召开基金份额持有人大会延续,投资者将面临基金合同终止的风险。

(2)本基金基金合同生效满三年后继续存续的,若连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于5000万元情形,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。投资者面临转换基金运作方式、与其他基金合并或终止基金合同的风险。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件;

2.《易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》;

3.《易方达恒信定期开放债券型发起式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。

10.2 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。

10.3 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
二〇一八年十月二十四日

易方达科翔混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十四日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达科翔混合
基金主代码	110013
交易代码	110013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年11月13日
报告期末基金份额总额	1,167,667,809.23份
投资目标	本基金主要投资于红利股,追求在有效控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳健增值。
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、货币市场工具及其他金融工具的比例,追求更高收益,回避市场风险。
业绩比较基准	80%×中证红利指数收益率+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合基金,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	中国工商银行股份有限公司

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-244,776,745.45
2.本期利润	-174,608,891.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1498
4.期末基金资产净值	2,729,708,656.20
5.期末基金份额净值	2.338

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12月12日对原基金科翔退市时的基金份额进行了拆分,基金拆分比例为1:1.340278796。

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

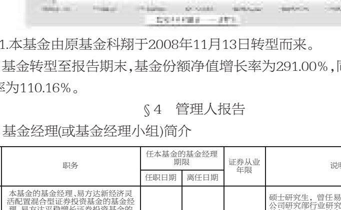
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.99%	1.46%	-1.46%	0.92%	-4.53%	0.54%

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

易方达科翔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

(2008年11月13日至2018年9月30日)



注:1.本基金由原基金科翔于2008年11月13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291.00%,同期业绩比较基准收益率为110.16%。

§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		
陈皓	本基金的基金经理、易方达新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达平稳增长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、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、投资一部总经理	2014-05-10	-	11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、投资一部总经理助理、投资一部副总经理、易方达价值精选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。本基金管理人制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,通过投资交易系统中的公平交易模块,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24次,其中23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,1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 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

2018年三季度,上证综指下跌0.92%,同期创业板综指下跌11.84%,继二季度市场下跌之后继续呈现下行走势。

期间,本基金继续坚守和集中核心持仓,持有受益于PCB行业下游需求趋势增长和产业转移背景下的龙头公司股票,以及显著受益于无人零售领域的机电软一体化提供商的公司股票;显著增加了自主可控和国防军工领域的仓位,在当期获得了较为明显的相对收益。在市场总体风险偏好下降和预期悲观的背景下,本基金持续加强对于重点布局领域的研究,寻找可供长期投资的价值股的出现。

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2.338元,本报告期份额净值增长率为-5.99%,同期业绩比较基准收益率为-1.46%。

§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	2,223,539,387.96	81.15
	其中:股票	2,223,539,387.96	81.15
2	固定收益投资	83,774,846.82	3.06
	其中:债券	83,774,846.82	3.06
	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	199,820,419.73	7.29
	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	201,440,102.50	7.35
7	其他资产	31,417,409.35	1.15
8	合计	2,739,992,166.36	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	40,098,769.36	1.47
B	采矿业	50,079,086.00	1.83
C	制造业	1,789,858,394.04	65.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	34,525,334.26	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	42,940.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	129,217,730.77	4.73
J	金融业	165,059,321.60	6.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,265,655.93	0.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	392,156.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,223,539,387.96	81.46

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	002376	新北洋	11,684,021	207,157,692.33	7.59
2	002384	东山精密	15,971,800	195,654,550.00	7.17
3	300476	胜宏科技	11,741,912	180,355,768.32	6.61
4	002025	航天电器	4,367,090	119,570,924.20	4.38
5	002013	中航机电	14,119,291	118,602,044.40	4.34
6	600703	三安光电	6,958,721	113,844,675.56	4.17
7	600967	内蒙一机	7,133,567	98,728,567.28	3.62
8	300383	光环新网	6,096,500	87,667,670.00	3.21
9	002179	中航光电	1,881,903	82,803,732.00	3.03
10	300316	晶盛机电	6,993,694	78,609,120.56	2.88

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,119,000.00	2.57
	其中:政策性金融债	70,119,000.00	2.57
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)	13,655,846.82	0.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	83,774,846.82	3.07

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	180209	18国开09	700,000	70,119,000.00	2.57
2	128045	机电转债	103,660	11,870,106.60	0.43
3	123003	蓝思转债	19,107	1,785,740.22	0.07

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东山精密(代码:002384)为易方达科翔混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。2018年8月27日,苏州东山精密制造股份有限公司董事会发布《关于高新区分公司收到行政处罚决定书的公告》,公司下属的高新区分公司收到苏州市虎丘区环境保护局出具的苏虎环行罚字(2018)第061号《行政处罚决定书》,虎丘区环境监察大队执法人员对高新区分公司进行现场监察,检查发现高新区分公司部分建设项目未完成环保验收;废水处理设施不正常运行;生产现状和环评报告中的生产情况不符;产生的废包装桶等由厂商回收,未办理危废转移联单;部分废机油桶露天堆放,危废堆放场所无标识牌;未编制环境应急预案,无事故应急池;北侧雨水总排口、玻璃切割车间旁雨水井、北侧污水总排口PH和COD指标超过国家排放标准。根据相关规定,虎丘区环保局对高新区分公司作出如下行政处罚:(1)将案件移送公安机关;(2)责令停止违法行为;(3)合计罚款人民币155.92万元。

本基金投资东山精密的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除东山精密外,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。

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	878,457.60
2	应收证券清算款	26,948,352.54
3	应收股利	-
4	应收利息	646,841.30
5	应收申购款	2,943,757.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,417,409.35

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	123003	蓝思转债	1,785,740.22	0.07

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	300383	光环新网	87,667,670.00	3.21	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	1,164,094,523.47
报告期基金总申购份额	58,386,309.10
减:报告期基金总赎回份额	54,813,023.34
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,167,667,809.23

§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	57,976,567.48
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	57,976,567.48
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.97

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.科翔证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告;

2.中国证监会《关于核准科翔证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》(证监许可[2008]1221号);

3.《易方达科翔混合型证券投资基金基金合同》;

4.《易方达科翔混合型证券投资基金托管协议》;

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
二〇一八年十月二十四日