

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：二〇一九年一月二十二日

§ 提示性提示

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2019年1月18日复核了本报告中的财务数据、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2018年10月26日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	易方达科顺定期开放灵活配置混合型证券投资基金
场内简称	
基金代码	061132
上市地	深圳证券交易所
基金合同生效日	2018年10月26日
报告期天数	55
报告期净值收益率	-16.93%
报告期净值收益率标准差	2.22%
报告期夏普比率	0.45
报告期收益分配情况	无
报告期总份额	1,070,300,234,000份
报告期单位净值	0.9367元
报告期资产净值	1,013,895,700.20元
报告期负债总额	-603,193,046.63元
报告期末基金份额总额	1,013,895,700.20份
报告期末基金资产净值	976,706.57元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期		报告期	报告期
	年初至报告期期末	1-3月		
1.本期已实现收益	2018年10月26日至2018年12月31日	-474,394,919.00		
2.本期利润		-1,877,137.17		
3.期初至报告期期末基金净资产(报告期期初基金净资产+本期利润)		2018年10月26日至2018年12月31日	200,000,000.00	-796,706.57
4.期末基金资产净值		976,706.57		
5.期末基金份额净值		0.9367		

注:1.所涉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将低于所列数字。

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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.本基金合同于2018年10月26日生效, 合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期间计算。

## 3.2 基金净值表现

3.2.1 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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	1-3月	2-6月
过去三个月	-0.60%	0.10%	-0.03%	0.00%	-0.62%	-0.60%

注:1.所涉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将低于所列数字。

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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.本基金合同于2018年10月26日生效, 合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期间计算。

## 3.2.2 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对比

# 易方达科顺定期开放灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第四季度报告

### 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、投资决策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 常规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41次, 其中40次为指数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将投资组合的“偏离度”、交易“日期”和“涉及证券”的名称等信息进行了披露。

### 4.4 报告期内基金的利润分配情况

截至报告期末, 本基金份额净值为0.9945元, 本报告期份额净值增长率为-0.55%, 同期业绩比较基准收益率为-0.53%。

### 4.5 管理人报告

#### 4.5.1 基金经理履行情况

本基金基金经理在报告期内未发生变更。

4.5.2 基金投资运作情况

本基金在报告期内严格按照基金合同约定的程序进行投资运作, 未发现存在违反基金合同约定的程序进行投资的情况。

4.5.3 基金的业绩表现

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.4 投资组合报告

4.5.5 其他需要说明的事项

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.6 其他重要事项

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.7 风险揭示

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.8 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.9 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.10 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.11 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.12 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.13 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.14 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.15 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.16 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.17 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.18 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.19 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.20 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.21 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.22 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.23 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.24 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.25 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.26 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.27 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.28 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.29 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.30 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.31 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.32 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.33 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.34 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.35 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.36 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.37 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.38 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.39 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.40 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.41 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.42 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.43 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.44 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.45 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.46 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.47 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.48 其他

本基金在报告期内未发生变更。

4.5.49 其他

本基金在报告期内未发生变更。