

易方达科讯混合型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

2017年3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
报告送出日期：二〇一七年四月二十一日

§ 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2017年4月18日核对了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，没有发现存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理王成对本报告的内容确信无虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者应认真阅读基金合同、招募说明书及相关公告。

本基金当前未进行分红。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金类型	地方行政区划债
交易代码	100009
上市地	上海证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月10日
报告期末基金资产净值	6,215,790,266.409
投资目标	根据国家政策导向，结合运用多种投资策略，追求基金资产的长期稳健增值。
本基金投资于国债、地方政府债券、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转债、权证、资产支持证券、货币市场工具以及其他品种的比例，不高于基金资产净值的5%；不投资股票、权证、基金、期货、期权、权证、资产支持证券、货币市场工具以及其他品种。	本基金投资于国债、地方政府债券、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转债、权证、资产支持证券、货币市场工具以及其他品种的比例，不高于基金资产净值的5%；不投资股票、权证、基金、期货、期权、权证、资产支持证券、货币市场工具以及其他品种。
投资策略	本基金投资于国债、地方政府债券、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转债、权证、资产支持证券、货币市场工具以及其他品种的比例，不高于基金资产净值的5%；不投资股票、权证、基金、期货、期权、权证、资产支持证券、货币市场工具以及其他品种。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×8%+中债总收益指数×20%
风险收益特征	本基金是混合基金，该基金的风险水平高于货币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

主要财务指标	(2017年1月1日至2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-473,306,099.63
2.本期利润	-100,305,729.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0187
4.期末净资产收益率	6,417,930,217.23
5.期末基金份额净值	1.0775

注：1.上述基金业报酬率不包括持有人交易基金的费用，计算采用后端费用模式，赎回费主要以现金形式支付。

2.本期已实现收益指基金本期利润减去所有必要的费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期已实现的公允价值变动收益。

3.本基金于2006年4月10日在易方达科讯资讯市场的基金份额进行了拆分，基金拆分比例为1:1.025520742。

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 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.78% 0.03% 3.24% -0.02% 0.41%

3.2.2 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16日至2017年3月31日)

注：1.本基金由原基金科讯于2007年12月18日转型而来。

2.自基金转型之日起，本基金的净值增长率为-2.24%，同期业绩比较基准收益率为-20.9%。

3.4 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间 证券从业年限 说明

任华伟 基金经理 2010年1月1日至2016年1月31日 11年 在任期间，任华伟先生担任易方达基金管理有限公司研究部研究员、易方达国际业务部研究员，同时担任易方达宏观策略组基金经理。

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

2.除从本基金的管理人之外，从基金管理人其他关联机构取得薪酬的人员，不享受基金经理的有关待遇。

3.2.1 本期基金管理人对基金经理的评价：基金经理严格遵守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，以客户利益为重，坚持诚信守法，尽职尽责，勤勉尽责的履行职责和用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋取最大利益。在本报告期内，基金经理尽职尽责，无损害基金份额持有人的利益。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.2 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.3 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.4 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.5 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.6 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.7 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.8 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.9 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.10 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.11 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.12 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.13 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.14 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.15 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.16 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.17 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.18 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.19 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.20 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.21 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.22 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.23 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.24 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.25 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.26 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.27 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.28 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.29 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.30 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.31 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.32 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.33 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.34 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.35 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.36 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并重视公平交易制度的执行情况，从而保证公平交易制度的执行效果。

4.2.37 公平交易制度的执行情况

本基金的管理人通过建立立行立改、规范化、透明化的公平交易制度，严格执行公平交易制度，并