易方达丰惠混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

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:二〇一八年七月十九日

§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7月17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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达丰惠混合
基金主代码	002602
交易代码	002602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月24日
报告期末基金份额总额	127,149,387.04份
投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产,并通过较灵活的资产配置,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势,深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等,综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素,在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例。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。本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略,精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断,对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析,追求股票投资组合的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%
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

§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4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	509,104.30
2.本期利润	-11,208,873.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0800
4.期末基金资产净值	120,152,073.67
5.期末基金份额净值	-

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。

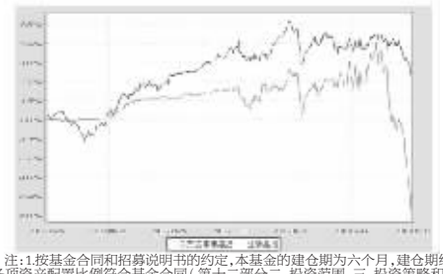
3.2 基金净值表现

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	-8.52%	0.67%	-1.18%	0.29%	-7.34%	0.38%

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

易方达丰惠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3月24日至2018年6月30日)



注:1.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。

2.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为-5.50%,同期业绩比较基准收益率为3.94%。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
胡剑	本基金的基金经理、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、易方达信用债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、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益研究部总经理	2017-03-24	-	12年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)基金经理、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达裕景添利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

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27次,其中26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年二季度我国宏观经济下行压力整体有所增大。4月份经济数据仍然稳健,当月工业增加值同比增长7%,一度高于市场预期,但5月份回落至6.8%,月度环比下降的幅度相对更为明显。投资数据方面,4-5月份持续呈现下降趋势,其中基建投资回落是主要原因。相较之下,我们认为社会融资总量同比增速的下滑可能更值得关注。二季度该数据延续了2017年年末以来的收缩态势,除表内信贷总体平稳之外,委托贷款和信托贷款下降速度均有所加快。根据测算,扣除贷款以外的社融增速在3-5月连续3个月维持在5-6%的较低水平。与此同时,M1、M2同比增速分别下降至6%和8.3%的历史低点,不过在投资及融资数据回落的背景下,宏观经济仍然显示出一定韧性。企业盈利状况保持在较好水平,且房地产行业销售及投资增速也依然高于预期。

随着经济增速下行的预期开始有所增加,以及央行货币政策在边际上出现了一定宽松迹象,二季度债券市场收益率整体下行,但利率债与信用债走势出现明显分化。由于今年以来融资政策普遍收紧,信用市场违约事件出现的频率有所增加,导致信用利差整体呈现扩大趋势,尤其是中低等级及民营企业发行人的信用利差上行更为明显。

在不确定性上升的背景下,二季度权益市场出现明显调整,上证综指在一季度回落的基础上进一步下行10.14%。

操作上,二季度组合债券久期处于中性水平,权益部分持仓以盈利基本面较好的价值型股票为主。组合整体表现受到了大盘下跌带来的估值回调影响。

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0.945元,本报告期份额净值增长率为-8.52%,同期业绩比较基准收益率为-1.18%。

§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	56,512,511.84	41.78
	其中:股票	56,512,511.84	41.78
2	固定收益投资	76,626,016.30	56.65
	其中:债券	76,626,016.30	56.65
	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	1,144,290.56	0.85
7	其他资产	974,986.31	0.72
8	合计	135,257,805.01	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,618,968.20	14.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,219,848.00	1.02
E	建筑业	9,122,515.00	7.59
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	12,124,755.00	10.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,990,000.00	1.66
J	金融业	11,975,540.64	9.97
K	房地产业	2,460,885.00	2.05
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	56,512,511.84	47.03

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	601117	中国化学	1,355,500	9,122,515.00	7.59
2	601398	工商银行	1,354,577	7,206,349.64	6.00
3	600029	南方航空	589,500	4,981,275.00	4.15
4	601111	中国国航	492,200	4,375,658.00	3.64
5	002179	中航光电	103,100	4,020,900.00	3.35
6	601601	中国太保	104,900	3,341,065.00	2.78
7	601877	正泰电器	129,420	2,888,654.40	2.40
8	600115	东方航空	418,100	2,767,822.00	2.30
9	601012	隆基股份	164,120	2,739,162.80	2.28
10	000703	恒逸石化	172,480	2,566,502.40	2.14

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	10,017,000.00	8.34
	其中:政策性金融债	10,017,000.00	8.34
4	企业债券	28,875,000.00	24.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,059,000.00	7.54
7	可转债(可交换债)	28,675,016.30	23.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	76,626,016.30	63.77

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	170311	17进出11	100,000	10,017,000.00	8.34
2	136293	16兆泰02	100,000	9,790,000.00	8.15
3	136448	16万达03	100,000	9,730,000.00	8.10
4	101662082	16鲁宏桥MTN002	100,000	9,059,000.00	7.54
5	113015	隆基转债	82,240	8,145,049.60	6.78

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	24,843.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	946,762.00
5	应收申购款	3,380.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	974,986.31

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	113015	隆基转债	8,145,049.60	6.78
2	128024	宁行转债	3,989,930.01	3.32
3	123003	蓝思转债	2,633,083.25	2.19
4	113014	林洋转债	2,566,425.60	2.14
5	127004	模塑转债	1,961,889.31	1.63
6	128019	久立转2	923,919.15	0.77
7	110042	航电转债	873,796.50	0.73
8	110040	生益转债	796,480.00	0.66
9	113012	骆驼转债	477,093.90	0.40
10	120001	16以岭EB	216,657.28	0.18
11	110038	济川转债	1,222.50	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

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

报告期期初基金份额总额	164,335,110.28
报告期基金总申购份额	4,977,316.16
减:报告期基金总赎回份额	42,163,039.40
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	127,149,387.04

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达丰惠混合型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达丰惠混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达丰惠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。

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
二〇一八年七月十九日

易方达丰和债券型证券投资基金

2018年第二季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十九日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达丰和债券
基金主代码	002969
交易代码	002969
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月23日
报告期末基金份额总额	5,109,670,025.03份
投资目标	本基金主要投资于债券资产,严格管理权益类品种的投资比例,在控制基金资产净值波动的基础上,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势,深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等,综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素,在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例。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。本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略,精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断,对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析,追求股票投资组合的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+中债新综合指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%
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	中国银行股份有限公司

§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4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	150,043,306.26
2.本期利润	53,643,012.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0091
4.期末基金资产净值	5,748,636,221.79
5.期末基金份额净值	1.1251

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

易方达保证金货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8488%	0.0031%	0.0885%	0.0000%	0.7603%	0.0031%

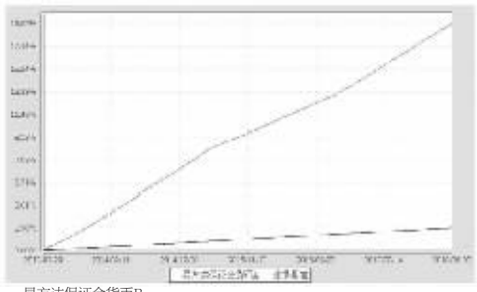
易方达保证金货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9119%	0.0031%	0.0885%	0.0000%	0.8234%	0.0031%

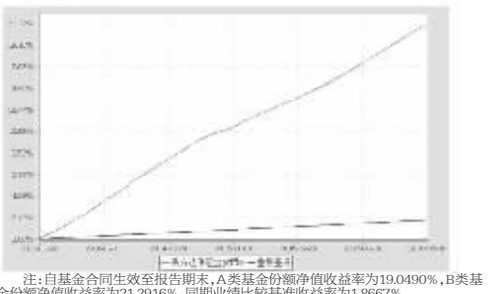
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达保证金收益货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年3月29日至2018年6月30日)

易方达保证金货币A



易方达保证金货币B



注:自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为19.0490%,B类基金份额净值收益率为21.2916%,同期业绩比较基准收益率为1.8667%。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
石大锋	本基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳健理财货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达天天发货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达财富钱线货币市场基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理	2013-04-22	-	9年	硕士研究生,曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。
梁雪	本基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达财富钱线货币市场基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理助理、易方达月利理财货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理	2017-08-08	-	8年	硕士研究生,曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员、易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益基金经理助理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理。

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27次,其中26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2季度债券市场收益率震荡下行。央行进行定向降准,银行间流动性较为充裕;社融和经济指标出现回落,市场对于经济前景担忧上升;中美贸易摩擦持续,避险情绪上升,推动无风险利率走低。结构上看,利率债和高等级信用债收益率下行幅度较大;由于民营企业和城投平台融资环境收紧,低评级债券收益率走高,信用利差有所扩大。

权益方面,2季度股票市场深度调整,中美贸易摩擦、社融和经济数据下行、信用收缩担忧上升等因素使得风险偏好大幅下降,各主要板块股票均出现较大幅度的下跌。

报告期内,组合债券部分持仓以高等级信用债和利率债为主,保持中性的杠杆水平,并逐步拉长了组合久期。权益部分持仓以盈利增长稳定、估值合理的品种为主,并降低了股票仓位,一定程度上降低了股票市场波动对组合净值的影响。

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1.1251元,本报告期份额净值增长率为0.68%,同期业绩比较基准收益率为0.03%。

§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	645,502,642.24	8.76
	其中:股票	645,502,642.24	8.76
2	固定收益投资	6,449,735,382.30	87.49
	其中:债券	6,449,735,382.30	87.49
	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	68,155,595.36	0.92
7	其他资产	208,481,723.86	2.83
8	合计	7,371,875,343.76	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

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	-	-
B	采矿业	48,737,000.00	0.85
C	制造业	397,348,688.14	6.91
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	84,403,776.76	1.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	107,496,806.14	1.87
K	房地产业	7,516,371.20	0.13
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	645,502,642.24	11.23

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	600009	上海机场	1,521,337	84,403,776.76	1.47
2	601318	中国平安	1,343,683	78,712,950.14	1.37
3	002415	海康威视	2,083,950	77,377,063.50	1.35
4	600887	伊利股份	2,027,322	56,562,283.80	0.98
5	600309	万华化学	1,243,400	56,475,228.00	0.98
6	600188	兖州煤业	3,737,500	48,737,000.00	0.85
7	000651	格力电器	990,101	46,683,262.15	0.81
8	000568	泸州老窖	750,000	42,660,000.00	0.74
9	002008	大族激光	694,268	36,928,114.92	0.64
10	000338	潍柴动力	3,324,930	29,093,137.50	0.51

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	481,738,000.00	8.38
	其中:政策性金融债	481,738,000.00	8.38
4	企业债券	1,078,459,500.00	18.76
5	企业短期融资券	2,100,770,000.00	36.54
6	中期票据	2,656,826,000.00	46.22
7	可转债(可交换债)	131,941,882.30	2.30
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,449,735,382.30	112.20

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	101800662	18京能源MTN001	2,000,000	201,440,000.00	3.50
2	011800319	18金地SCP001	2,000,000	201,020,000.00	3.50
3	101761005	17首钢MTN001	2,000,000	200,680,000.00	3.49
4	011800074	18津城建SCP003	1,600,000	160,800,000.00	2.80
5	101363002	13中色MTN001	1,500,000	151,425,000.00	2.63

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。

5.11.1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	7,013,052.37
2	应收证券清算款	61,949,599.12
3	应收股利	-
4	应收利息	114,323,671.84
5	应收申购款	25,195,400.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	208,481,723.86

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	113013	国君转债	64,373,387.10	1.12
2	132008	17山高EB	22,713,098.00	0.40
3	113011	光大转债	12,175,570.40	0.21
4	128016	雨虹转债	5,191,000.00	0.09

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	000568	泸州老窖	21,918,750.00	0.38	非公开发行流通受限
2	000568	泸州老窖	20,741,250.00	0.36	非公开发行流通受限

注:根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》,大股东以外的股东减持所持有的上市公司非公开发行股份,采取集中竞价交易方式的,在任意连续90日内,减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%。持有上市公司非公开发行股份的股东,通过集中竞价交易减持该部分股份的,除遵守前款规定外,自股份解除限售之日起12个月内,减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	6,202,826,519.49
报告期基金总申购份额	880,120,757.50
减:报告期基金总赎回份额	1,973,277,251.96
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	5,109,670,025.03

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达丰和债券型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达丰和债券型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达丰和债券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。

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
二〇一八年七月十九日

易方达保证金收益货币市场基金

2018年第二季度报告

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年七月十九日

§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2018年7月17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