

# 易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

## 2018年第二季度报告

操作上,组合自2月份以来进行了久期平滑,并在精准对部分品种进行了获利了结。5月份考虑宏观经济持续稳定的确定性增强,大幅提升了杠杆比例。信用债仍以久期结构为主,以获取稳定的利权收益。权益方面,组合在中期调整中积极进行仓位变动,并通过积极主导的方式投资于一些具备较好安全边际的品种。此外,组合积极参与新股申购。

4.2.2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1.666元,本报告期份额净值增长率为-0.48%,同期业绩比较基准收益率为1.14%。

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	288,530,000.33	5.88
2	固定收益投资	4,738,423,997.69	96.06
3	货币资金	4,738,423,997.69	96.06
4	买入返售金融资产	-	-
5	应收利息	-	-
6	其他资产	-	-
7	负债	-	-
8	净资产	4,926,954,000.02	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股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	煤炭	-	-
C	制造业	70,846,291.08	2.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,035,415.13	0.13
E	建筑业	50,015,068.01	1.52
F	金融业	14,202,366.79	0.43
G	信息技术业	-	-
H	日常消费品	-	-
I	医药、生物和医疗保健	-	-
J	公用事业	131,429,324.94	3.89
K	房地产业	6,796,465.39	0.17
L	交通运输、仓储和邮政业	-	-
M	综合类	3,282,577.08	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
O	国防军工、航空航天制造业	-	-
P	教育	7,788,087.28	0.24
Q	其他	-	-
S	合计	288,530,000.33	8.60

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	601398	工商银行	13,502,500	72,961,300.00	2.24
2	601117	中国平安	7,138,548	47,361,048.16	1.38
3	601288	农业银行	8,568,600	46,285,224.00	1.37
4	600102	华能国际	1,587,561	22,675,033.09	0.69
5	600109	中信证券	468,400	14,429,756.00	0.43
6	601101	华夏银行	603,262	10,380,314.63	0.31
7	601077	正邦科技	482,284	10,096,202.08	0.30
8	601318	中国平安	156,500	9,109,130.00	0.28
9	300016	山东墨龙	241,191	7,788,087.28	0.24
10	000066	长城汽车	239,000	7,282,280.00	0.22

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	国债	-	-
2	地方政府债	-	-
3	央行票据	-	-
4	中期票据	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	其他	-	-
7	合计	4,738,423,997.69	96.06

5.5 投资组合报告附注

5.1.1.本基金报告期内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。

5.1.2.本基金持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.3. 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	224,026.76
2	应收证券清算款	1,023,227.72
3	应收股利	-
4	应收利息	44,217,708.66
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	104,250,963.14

5.1.4.报告期内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	118111	光大转债	14,101,202.00	0.46
2	128013	浦发转债	16,202,414.44	0.49
3	110004	民生银行	6,248,280.00	0.19
4	123003	招商银行	6,135,812.51	0.19
5	111014	格力转债	6,779,002.20	0.19
6	121004	浦发转债	6,270,428.40	0.19
7	121004	浦发转债	6,427,280.00	0.19
8	113005	浦发转债	3,988,000.00	0.12
9	113005	浦发转债	3,810,500.00	0.12
10	110023	浦发转债	2,923,128.10	0.07
11	123006	浦发转债	1,947,300.00	0.06
12	110024	浦发转债	1,730,000.00	0.05
13	120006	浦发转债	1,043,700.00	0.03
14	113010	浦发转债	678,064.00	0.02

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	118111	光大转债	14,101,202.00	0.46	
2	128013	浦发转债	16,202,414.44	0.49	
3	110004	民生银行	6,248,280.00	0.19	
4	123003	招商银行	6,135,812.51	0.19	
5	111014	格力转债	6,779,002.20	0.19	

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.1.1.本基金报告期内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。

5.1.2.本基金持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.3. 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	224,026.76
2	应收证券清算款	1,023,227.72
3	应收股利	-
4	应收利息	44,217,708.66
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	104,250,963.14

5.1.4.报告期内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	118111	光大转债	14,101,202.00	0.46
2	128013	浦发转债	16,202,414.44	0.49
3	110004	民生银行	6,248,280.00	0.19
4	123003	招商银行	6,135,812.51	0.19
5	111014	格力转债	6,779,002.20	0.19
6	121004	浦发转债	6,270,428.40	0.19
7	121004	浦发转债	6,427,280.00	0.19
8	113005	浦发转债	3,988,000.00	0.12
9	113005	浦发转债	3,810,500.00	0.12
10	110023	浦发转债	2,923,128.10	0.07
11	123006	浦发转债	1,947,300.00	0.06
12	110024	浦发转债	1,730,000.00	0.05
13	120006	浦发转债	1,043,700.00	0.03
14	113010	浦发转债	678,064.00	0.02

5.6 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	国债	-	-
2	地方政府债	-	-
3	央行票据	-	-
4	中期票据	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	其他	-	-
7	合计	4,738,423,997.69	96.06

5.5 投资组合报告附注

5.1.1.本基金报告期内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。

5.1.2.本基金持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.3. 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	224,026.76
2	应收证券清算款	1,023,227.72
3	应收股利	-
4	应收利息	44,217,708.66
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	104,250,963.14

5.1.4.报告期内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	118111	光大转债	14,101,202.00	0.46
2	128013	浦发转债	16,202,414.44	0.49
3	110004	民生银行	6,248,280.00	0.19
4	123003	招商银行	6,135,812.51	0.19
5	111014	格力转债	6,779,002.20	0.19
6	121004	浦发转债	6,270,428.40	0.19
7	121004	浦发转债	6,427,280.00	0.19
8	113005	浦发转债	3,988,000.00	0.12
9	113005	浦发转债	3,810,500.00	0.12
10	110023	浦发转债	2,923,128.10	0.07
11	123006	浦发转债	1,947,300.00	0.06
12	110024	浦发转债	1,730,000.00	0.05
13	120006	浦发转债	1,043,700.00	0.03
14	113010	浦发转债	678,064.00	0.02

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	118111	光大转债	14,101,202.00	0.46	
2	128013	浦发转债	16,202,414.44	0.49	
3	110004	民生银行	6,248,280.00	0.19	
4	123003	招商银行	6,135,812.51	0.19	
5	111014	格力转债	6,779,002.20	0.19	

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.1.1.本基金报告期内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。

5.1.2.本基金持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.3. 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	224,026.76
2	应收证券清算款	1,023,227.72
3	应收股利	-
4	应收利息	44,217,708.66
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	104,250,963.14

5.1.4.报告期内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	118111	光大转债	14,101,202.00	0.46
2	128013	浦发转债	16,202,414.44	0.49
3	110004	民生银行	6,248,280.00	0.19
4	123003	招商银行	6,135,812.51	0.19
5	111014	格力转债	6,779,002.20	0.19
6	121004	浦发转债	6,270,428.40	0.19
7	121004	浦发转债	6,427,280.00	0.19
8	113005	浦发转债	3,988,000.00	0.12
9	113005	浦发转债	3,810,500.00	0.12
10	110023	浦发转债	2,923,128.10	0.07
11	123006	浦发转债	1,947,300.00	0.06
12	110024	浦发转债	1,730,000.00	0.05
13	120006	浦发转债	1,043,700.00	0.03
14	113010	浦发转债	678,064.00	0.02

5.6 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	国债	-	-
2	地方政府债	-	-
3	央行票据	-	-
4	中期票据	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	其他	-	-
7	合计	4,738,423,997.69	96.06

5.5 投资组合报告附注

5.1.1.本基金报告期内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。

5.1.2.本基金持有的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.3. 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	224,026.76
2	应收证券清算款	1,023,227.72
3	应收股利	-
4	应收利息	44,217,708.66
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	104,250,963.14

5.1.4.报告期内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	118111	光大转债	14,101,202.00	0.46
2	128013	浦发转债	16,202,414.44	0.49
3	110004	民生银行	6,248,280.00	0.19
4	123003	招商银行	6,135,812.51	0.19
5	111014	格力转债	6,779,002.20	0.19
6	121004	浦发转债	6,270,428.40	0.19
7	121004	浦发转债	6,427,280.00	0.19
8	113005	浦发转债	3,988,000.00	0.12
9	113005	浦发转债	3,810,500.00	0.12
10	110023	浦发转债	2,923,128.10	0.07
11	123006	浦发转债	1,947,300.00	0.06
12	110024	浦发转债	1,730,000.00	0.05
13	120006	浦发转债	1,043,700.00	0.03
14	113010	浦发转债	678,064.00	0.02

5.6 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	国债	-	-
2	地方政府债	-	-
3	央行票据	-	-
4	中期票据	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	其他	-	