易方达保本一号混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

易方达保本一号混合型证券投资基金
2018年半年度报告摘要
2018年6月30日
基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:二〇一八年八月二十八日

1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	易方达保本一号混合
基金主代码	000189
交易代码	000189
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月13日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,423,815,576.64份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用投资组合保险技术控制本金损失的风险,并力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金采用投资组合保险策略,借鉴恒定比例组合保险（CPPI）策略的原理在安全资产与风险资产之间进行动态配置,以确保基金在保本周期到期时,力争实现基金资产在保本基础上增值的目的。债券投资方面,通过分析宏观经济运行趋势及货币财政政策变化,预测未来市场利率趋势及市场信用环境变化,综合考虑各类风险因素,构造债券投资组合;股票投资方面,主要采取“自下而上”的投资策略,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,精选高成长、低估值、盈利稳定提升的上市公司,构建股票投资组合,并持续优化调整,控制风险,保证投资组合的稳定性和收益性。
业绩比较基准	中国人民银行公布的三年期银行整存整取定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,理论上其风险收益水平低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	张燕
	联系电话	020-85102688	0755-83199084
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95555
传真		020-85104666	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦43楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月1日至2018年6月30日）
本期已实现收益	9,730,574.95
本期利润	-1,118,585.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0003
本期基金份额净值增长率	-0.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0184
期末基金资产净值	3,499,859,965.25
期末基金份额净值	1.022

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。

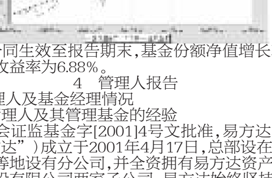
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.39%	0.11%	0.23%	0.01%	0.16%	0.10%
过去三个月	0.00%	0.14%	0.70%	0.01%	-0.70%	0.13%
过去六个月	-0.10%	0.20%	1.38%	0.01%	-1.48%	0.19%
过去一年	3.74%	0.18%	2.79%	0.01%	0.95%	0.17%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.21%	0.13%	6.88%	0.01%	1.33%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

易方达保本一号混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2016年1月13日至2018年6月30日）



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为8.21%,同期业绩比较基准收益率为6.88%。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于2001年4月17日,总部设在广州,在北京、上海、成都、大连等地设有分公司,并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下,通过市场化、专业化的运作,为投资人的资产实现持续稳定的保值增值,成为国内领先的综合性资产管理机构,具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一,拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、基本养老保险基金投资等业务资格,投资业务包括主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资、另类投资等六大板块,为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至2018年6月30日,易方达旗下管理的各类资产规模总计1.3万亿元,服务各类客户总数7580万户,公募基金累计分红超过1000亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王晓晨	本基金的基金经理、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、易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式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、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、易方达资产管理（香港）有限公司固定收益投资决策委员会委员、固定收益基金投资部副总经理	2016-01-13	-	15年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管、固定收益总部总经理助理、易方达货币市场基金基金经理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理。
林虎	本基金的基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理助理	2016-01-19	-	6年	博士研究生,曾任宏源证券研究所固定收益分析师,国信证券研究所宏观分析师。
张雅君	本基金的基金经理助理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒益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、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理	2016-01-19	-	9年	硕士研究生,曾任海通证券股份有限公司项目经理,工银瑞信基金管理有限公司债券交易员,易方达基金管理有限公司债券交易员、固定收益研究员、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理助理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理。

注:1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期,王晓晨的“任职日期”为基金合同生效之日,张雅君、林虎的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

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。

3.为加强基金流动性管理,本基金安排了相关助理协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。本基金管理人规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66次,其中64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;2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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年实体经济数据基本符合预期,经济增速呈现小幅放缓迹象,但融资数据大幅下滑,金融去杠杆的影响传导到实体经济,民营企业和融资平台资金链紧张,加之贸易战的影响,资本市场悲观情绪螺旋升温,资本市场大幅波动,人民币汇率由升转贬。

债券市场方面,收益率大幅下行,信用利差水平扩大。年初经济数据表现良好,微观产品价格不断上升,市场对于经济的乐观预期逐步升温,加上金融监管文件密集出台,市场对金融监管的担忧不断强化,债券延续了2017年四季度以来的下跌行情。3月开始多重因素刺激下,市场对于未来经济的预期转向悲观。一方面是大宗商品由于库存积累,下游开工较晚,价格出现明显下跌,也带动权益市场的相关板块出现回撤。同时在3月下旬中美贸易摩擦进一步升温,考虑到出口是2017年支撑经济的重要因素,这也加剧了市场对于未来经济下行的担忧。之后市场主线基本由贸易战和信用收缩主导,民企违约集中出现,市场的风险偏好大幅降低。在货币政策转向和资金面宽松不断确认下,利率债和高等级信用债出现较大涨幅,中低等级信用债则出现了较为严重的分化,民企和城投平台收益率大幅上行,融资困难,信用利差大幅扩张。

股票市场方面同样波动剧烈。1月份大盘蓝筹股持续上涨,创业板则出现大幅下跌。2月初海外市场波动后,市场风格出现切换。由于对未来经济下行的担心加剧,大盘蓝筹股持续回调,创业板则表现强势。二季度市场对于中美贸易摩擦的担忧日益悲观,加之市场对于信用收缩格局下国内经济担忧加剧,汇率的快速贬值也再次引发资本外流担心,市场风险偏好大幅下降,股票市场经历了较大幅度的调整。

本基金已进入保本周期的最后一年,组合债券部分以短久期、AAA评级的稳健资产为主要配置,权益部分保持较低仓位。信用债给本组合提供了最大业绩贡献,权益部分由于股票市场波动率较大,对组合造成业绩拖累。

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1.022元,本报告期份额净值增长率为-0.10%,同期业绩比较基准收益率为1.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,面对复杂的国内外经济形势,留给监管层的政策空间越来越有限,货币政策不能大水漫灌,财政政策更加需要考虑预算收支平衡,汇率政策需要考虑外汇储备和外债余额,稳增长面临一定的难度。我们相信政府有能力从有限的政策组合中找到解决问题的方法,但融资环境和投资意愿的改变需要较长时间的修复。目前宏观政策明确偏向防风险、稳增长,货币政策稳健宽松,财政政策更加积极,融资环境边际上逐渐改善,资本市场的预期也正在逐步产生一些变化。实体经济层面,支持稳增长的社会需要的有效大型基础设施建设项目预计将会陆续推出,继续加快对外开放,调整经济结构、提质增效,支持小微、三农的政策以及国有企业改革等正在稳步推进;对贸易战的极度悲观情绪正在向冷静接受、理性应对转变。基金经理判断,资本市场前期极度悲观的情绪有望得到一定程度的修复,但资本市场的最终走向仍将取决于未来的经济数据和企业盈利数据。短期来看,债券市场尤其是收益率曲线短端的机会较为明确,无风险利率水平和高等级债券收益率仍有下行的空间,同时兼具较好的流动性。长端品种的波动率增加,宜作为波段操作品种。权益市场方面,风险仍然大于机会,但优质企业的估值已经接近历史最低水平,即使考虑到经济下行的压力,此类企业的长期配置价值已经非常突出,适合长期持有。

针对本组合,鉴于今年是最后一个保本周期,本着保本以及获取一定收益的要求,组合的债券部分将继续以短久期、高等级的稳健资产为主,股票部分保持极低仓位并随着临近保本周期结束逐步减持,力争为投资者创造保本条件下的最佳收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,公司首席运营官担任估值委员会主席,主动权益板块、固定收益板块、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据,由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体:易方达保本一号混合型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	1,007,271.66	718,625.98
结算备付金	23,112,690.86	20,849,687.20
存出保证金	489,835.54	321,738.54
交易性金融资产	3,453,565,884.55	4,013,399,135.80
其中:股票投资	123,127,801.15	461,672,357.72
基金投资	-	-
债券投资	3,330,438,083.40	3,551,726,778.08
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	23,000,000.00	50,730,196.10
应收证券清算款	13,879,650.01	80,156.64
应收利息	65,025,231.55	52,650,808.71
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,580,080,564.17	4,138,750,348.97
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	61,000,000.00	219,000,000.00
应付证券清算款	12,306,038.55	-
应付赎回款	1,722,585.87	51,241,728.09
应付管理人报酬	3,467,440.64	4,130,407.53
应付托管费	577,906.78	688,401.25
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	571,756.19	958,312.43
应交税费	113,242.30	-
应付利息	54,572.57	711,274.34
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	407,056.02	790,165.43
负债合计	80,220,598.92	277,520,289.07
所有者权益:		
实收基金	3,423,815,576.64	3,775,987,585.93
未分配利润	76,044,388.61	85,242,473.97
所有者权益合计	3,499,859,965.25	3,861,230,059.90
负债和所有者权益总计	3,580,080,564.17	4,138,750,348.97

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.022元,基金份额总额3,423,815,576.64份。

6.2 利润表

会计主体:易方达保本一号混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	39,764,886.99	154,622,997.93
1.利息收入	79,587,479.02	93,369,248.39
其中:存款利息收入	330,238.16	37,974,806.51
债券利息收入	78,602,459.70	54,848,334.01
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	654,781.16	546,107.87
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-30,786,591.16	-21,806,833.48
其中:股票投资收益	-25,946,057.11	32,593,283.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-7,631,363.61	-56,617,848.51
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,790,829.56	2,217,731.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-10,849,160.65	78,977,435.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,813,159.78	4,083,147.05
减:二、费用	40,883,472.69	34,845,208.15
1. 管理人报酬	21,887,251.80	25,012,279.87
2. 托管费	3,647,875.33	4,168,713.29
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,542,996.86	711,055.34
5. 利息支出	12,452,244.46	4,703,677.12
其中:卖出回购金融资产支出	12,452,244.46	4,703,677.12
6. 税金及附加	119,766.16	-
7. 其他费用	233,338.08	249,482.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,118,585.70	119,777,789.78
减:所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,118,585.70	119,777,789.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:易方达保本一号混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,775,987,585.93	85,242,473.97	3,861,230,059.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,118,585.70	-1,118,585.70
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-352,172,009.29	-8,079,499.66	-360,251,508.95
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-352,172,009.29	-8,079,499.66	-360,251,508.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,423,815,576.64	76,044,388.61	3,499,859,965.25
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,478,265,468.09	60,678,182.49	4,538,943,650.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	119,777,789.78	119,777,789.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-531,545,555.39	-10,430,447.49	-541,976,002.88
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-531,545,555.39	-10,430,447.49	-541,976,002.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,946,719,912.70	170,025,524.78	4,116,745,437.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:刘晓艳,主管会计工作负责人:陈荣,会计机构负责人:邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达保本一号混合型证券投资基金(以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]657号《关于核准易方达保本一号混合型证券投资基金募集的批复》和证监许可[2015]1988号《关于准予易方达保本一号混合型证券投资基金变更注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达保本一号混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达保本一号混合型证券投资基金基金合同》于2016年1月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,634,146,239.58份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号《年度报告和半年度报告》》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达保本一号混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。金融商品转让,按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。存款利息收入不征收增值税。

（2）对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

（3）对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

（5）本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、基金销售机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,725,040,717.42	100.00%	-	-

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	1,380,033.04	100.00%	563,289.81	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,887,251.80	25,012,279.87
其中:支付销售机构的客户维护费	1,394,221.81	2,015,536.28

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×1.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等,支付日期顺延。到期操作期间(保本周期到期日除外)及过渡期内本基金不计提管理费。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,647,875.33	4,168,713.29

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等,支付日期顺延。到期操作期间(保本周期到期日除外)及过渡期内本基金不计提托管费。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	1,007,271.66	46,093.31	2,203,387.74	50,170.78

注:本基金的上述银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入 数量（单位:股/张）	总金额
本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
广发证券	002927	泰永长征	新股网下发行	961	14,203.58
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日					
广发证券	002841	视源股份	新股网下发行	1,680	32,020.80
广发证券	002842	翔鹭钨业	新股网下发行	932	10,643.44
广发证券	002867	周大生	新股网下发行	3,444	68,604.48
广发证券	108601	国开1703	分销	4,000,000	399,800,000.00
广发证券	300599	雄塑科技	新股网下发行	3,155	22,211.20
广发证券	300639	凯普生物	新股网下发行	1,046	19,235.94
广发证券	300647	超频三	新股网下发行	1,244	11,146.24
广发证券	300658	延江股份	新股网下发行	1,110	21,545.10
广发证券	300669	沪宁股份	新股网下发行	841	9,251.00
广发证券	603042	华脉科技	新股网下发行	1,232	13,872.32
广发证券	603043	广州酒家	新股网下发行	1,810	23,855.80
广发证券	603089	正裕工业	新股网下发行	1,087	12,641.81
广发证券	603639	海利尔	新股网下发行	1,206	30,089.70

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300713	英可瑞	2017-10-23	2018-11-01	老股转让流通受限	40.29	39.07	12,614	282,352.32	492,828.98	-
002572	索菲亚	2016-07-28	2018-08-01	非公开发行流通受限	53.05	31.41	150,801	3,999,996.53	4,736,659.41	-

注:1） 索菲亚家居股份有限公司于2017年4月24日（流通受限期内）,向全体股东每10股派7元人民币现金（含税）,同时按每10股转增10股进行资本公积金转增股本;于2018年4月25日（流通受限期内）,向全体股东每10股派4.5元人民币现金（含税）;2）深圳市英可瑞科技股份有限公司于2018年6月19日（流通受限期内）,向全体股东每10股派1元人民币现金（含税）,同时按每10股转增8股进行资本公积金转增股本;

3）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%。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额61,000,000.00元,于2018年7月2日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为118,119,882.26元,属于第二层次的余额为3,335,446,002.29元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次365,842,642.34元,第二层次3,647,556,493.46元,无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	123,127,801.15	3.44
	其中:股票	123,127,801.15	3.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,330,438,083.40	93.03
	其中:债券	3,330,438,083.40	93.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	23,000,000.00	0.64
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,119,962.52	0.67
8	其他各项资产	79,394,717.10	2.22
9	合计	3,580,080,564.17	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1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	13,341,215.92	0.38
C	制造业	93,546,341.15	2.67
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	9,306,548.08	0.27
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	6,933,696.00	0.20
K	房地产业	-	-
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	123,127,801.15	3.52

7.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000338	潍柴动力	3,879,600	33,946,500.00	0.97
2	600519	贵州茅台	27,768	20,311,181.28	0.58
3	000858	五 粮 液	233,700	17,761,200.00	0.51
4	600585	海螺水泥	469,700	15,725,556.00	0.45
5	601088	中国神华	669,068	13,341,215.92	0.38
6	600009	上海机场	167,746	9,306,548.08	0.27
7	601336	新华保险	161,700	6,933,696.00	0.20
8	002572	索菲亚	150,801	4,736,659.41	0.14
9	603823	百合花	36,764	572,415.48	0.02
10	300713	英可瑞	12,614	492,828.98	0.01

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601088	中国神华	77,241,803.40	2.00
2	000338	潍柴动力	63,143,572.40	1.64
3	601318	中国平安	56,288,389.72	1.46
4	600585	海螺水泥	44,767,659.54	1.16
5	601117	中国化学	38,662,715.00	1.00
6	000333	美的集团	38,565,614.26	1.00
7	600887	伊利股份	38,562,534.62	1.00
8	002027	分众传媒	38,428,233.32	1.00
9	600048	保利地产	38,283,781.08	0.99
10	600009	上海机场	33,181,417.79	0.86
11	300285	国瓷材料	28,775,918.38	0.75
12	600362	江西铜业	19,417,108.00	0.50
13	601899	紫金矿业	19,416,751.89	0.50
14	002001	新 和 成	19,356,272.00	0.50
15	600188	兖州煤业	19,352,156.53	0.50
16	601336	新华保险	19,350,123.00	0.50
17	600104	上汽集团	19,342,518.00	0.50
18	600276	恒瑞医药	19,334,965.89	0.50
19	000581	威孚高科	19,294,466.28	0.50
20	002271	东方雨虹	18,971,101.84	0.49

注:买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	84,141,525.98	2.18
2	600585	海螺水泥	83,354,193.88	2.16
3	300285	国瓷材料	62,531,477.53	1.62
4	002142	宁波银行	56,939,892.80	1.47
5	601088	中国神华	51,152,514.16	1.32
6	002027	分众传媒	50,378,115.20	1.30
7	600887	伊利股份	49,736,875.47	1.29
8	600309	万华化学	45,674,968.31	1.18
9	002366	台海核电	37,769,562.10	0.98
10	601117	中国化学	34,390,664.97	0.89
11	000333	美的集团	33,260,605.64	0.86
12	600048	保利地产	30,519,563.65	0.79
13	000338	潍柴动力	27,825,771.44	0.72
14	601336	新华保险	27,422,802.78	0.71
15	600009	上海机场	25,725,667.74	0.67
16	600066	宇通客车	24,277,111.05	0.63
17	601012	隆基股份	23,404,855.81	0.61
18	600276	恒瑞医药	21,174,495.00	0.55
19	002271	东方雨虹	19,283,375.00	0.50
20	601899	紫金矿业	18,859,065.63	0.49

注:卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本（成交）总额	733,889,271.08
卖出股票收入（成交）总额	992,514,828.69

注:“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	558,245,000.00	15.95
	其中:政策性金融债	390,570,000.00	11.16
4	企业债券	490,119,513.90	14.00
5	企业短期融资券	231,223,000.00	6.61
6	中期票据	552,274,000.00	15.78
7	可转债（可交换债）	221,569.50	0.01
8	同业存单	1,498,355,000.00	42.81
9	其他	-	-
10	合计	3,330,438,083.40	95.16

7.6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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111892832	18宁波银行CD046	4,000,000	386,960,000.00	11.06
2	111714268	17江苏银行CD268	3,000,000	287,070,000.00	8.20
3	018005	国开1701	2,000,000	200,760,000.00	5.74
4	111895582	18宁波银行CD060	2,000,000	198,020,000.00	5.66
5	111811077	18平安银行CD077	2,000,000	193,620,000.00	5.53

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11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。

7.12投资组合报告附注

7.12.118平安银行CD077（代码:111811077）为易方达保本一号混合型证券投资基金的前十大持仓证券。2018年2月7日,大连银监局针对平安银行贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现,贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票的违法事实,对平安银行处以人民币四十万元行政罚款。2018年3月14日,中国人民银行针对平安银行违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定,给予警告,没收违法所得3,036,061.39元,并处罚款10,308,084.15元,合计处罚金额13,344,145.54元。

18宁波银行CD046（代码:111892832）、18宁波银行CD060（代码:111895582）为易方达保本一号混合型证券投资基金的前十大持仓证券。2017年10月10日,宁波银监局针对宁波银行以贷转存等违法违规事实,处以人民币50万元的行政处罚。2018年6月7日,宁波银监局针对宁波银行以不正当手段违规吸收存款的违法违规事实,处以人民币60万元的行政处罚。

11中远MTN1（代码:1182359）为易方达保本一号混合型证券投资基金的前十大持仓证券。2018年5月14日,国家外汇管理局滨海新区中心支局针对中远海运控股股份有限公司违反外汇登记管理规定,依据《外汇管理条例》第四十八条第（五）项对中远海运控股股份有限公司处以警告及罚款。

本基金投资18平安银行CD077、18宁波银行CD046、18宁波银行CD060、11中远MTN1的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除18平安银行CD077、18宁波银行CD046、18宁波银行CD060、11中远MTN1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。

7.12.2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。

7.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	489,835.54
2	应收证券清算款	13,879,650.01
3	应收股利	-
4	应收利息	65,025,231.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,394,717.10

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127004	模塑转债	221,569.50	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002572	索菲亚	4,736,659.41	0.14	非公开发行流通受限
2	300713	英可瑞	492,828.98	0.01	老股转让流通受限

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%。

8 基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
6,187	553,388.65	2,685,933,594.07	78.45%	737,881,982.57	21.55%

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	200,887.80	0.0059%

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

9开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日（2016年1月13日）基金份额总额	4,634,146,239.58
本报告期期初基金份额总额	3,775,987,585.93
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	352,172,009.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,423,815,576.64

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2018年6月8日发布公告,自2018年6月8日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官（副总经理级）,聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
新时代证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	1,725,040,717.42	100.00%	1,380,033.04	100.00%	-

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下:

1） 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

2） 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

3） 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

1） 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2） 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
新时代证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	246,209,500.00	72.81%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
广发证券	91,962,185.94	27.19%	36,502,600,000.00	100.00%	-	-

11影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年01月01日~2018年06月30日	899,999,000.00	-	-	899,999,000.00	26.29%
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。							

易方达基金管理有限公司
二〇一八年八月二十八日