易方达安心回报债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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
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。

基金托管人中国工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	易方达安心回报债券	
基金主代码	110027	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月21日	
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	
报告期末基金份额总额	4,351,704,037.91份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B
下属分级基金的交易代码	110027	110028
报告期末下属分级基金的份额总额	2,591,832,949.41份	1,759,871,088.50份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争战胜通货膨胀和银行定期存款利率,主要面向以储蓄存款为主要投资工具的中小投资者,追求基金资产的长期、持续、稳定增值,努力为投资者提供有吸引力的回报,为投资者提供养老投资的工具。
投资策略	本基金采取稳健的资产配置策略,通过自上而下的方法进行固定收益类品种与权益类品种的战略及战术资产配置,在控制基金资产净值波动、追求收益稳定的基础上,提高基金的收益水平。 具体来看,本基金主要通过研究各类资产在较长时期的收益与风险水平特征,及各类资产收益与风险间的相关关系,对国内外宏观经济形势与政策、市场利率走势、信用利差水平、利率期限结构以及证券市场走势等因素进行分析,在本基金合同约定范围内制定合理的战略资产配置计划。 固定收益品种投资方面,本基金将经济分为衰退、萧条、复苏、繁荣四个阶段,并在各个阶段通过投资不同的固定收益类属资产,以获得超越长期平均通胀水平的回报。 权益类品种投资方面,本基金采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略,严格管理权益类品种的投资比例以及净值的波动幅度。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率(税后)+1.0%
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低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105798
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-85104666	010-66105799

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)	
	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B
本期已实现收益	39,224,887.20	14,022,183.39
本期利润	-260,622,753.57	-179,939,313.49
加权平均基金份额本期利润	-0.0873	-0.0915
本期基金份额净值增长率	-4.95%	-5.16%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B
期末可供分配基金份额利润	0.0342	0.0260
期末基金资产净值	3,925,232,468.35	2,643,072,796.35
期末基金份额净值	1.514	1.502

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

易方达安心回报债券A

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	-2.45%	0.81%	0.31%	0.01%	-2.76%	0.80%
过去三个月	-3.32%	0.72%	0.93%	0.01%	-4.25%	0.71%
过去六个月	-4.95%	0.72%	1.86%	0.01%	-6.81%	0.71%
过去一年	-1.70%	0.58%	3.75%	0.01%	-5.45%	0.57%
过去三年	8.63%	0.72%	11.88%	0.01%	-3.25%	0.71%
自基金合同生效起至今	159.85%	0.81%	33.92%	0.02%	125.93%	0.79%

易方达安心回报债券B

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	-2.47%	0.82%	0.31%	0.01%	-2.78%	0.81%
过去三个月	-3.41%	0.72%	0.93%	0.01%	-4.34%	0.71%
过去六个月	-5.16%	0.72%	1.86%	0.01%	-7.02%	0.71%
过去一年	-2.06%	0.58%	3.75%	0.01%	-5.81%	0.57%
过去三年	7.52%	0.72%	11.88%	0.01%	-4.36%	0.71%
自基金合同生效起至今	153.67%	0.81%	33.92%	0.02%	119.75%	0.79%

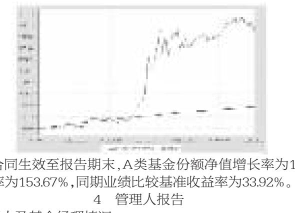
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达安心回报债券型证券投资基金

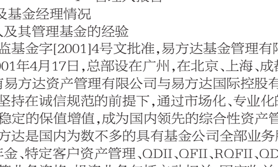
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年6月21日至2018年6月30日)

易方达安心回报债券A



易方达安心回报债券B



注:自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为159.85%,B类基金份额净值增长率为153.67%,同期业绩比较基准收益率为33.92%。

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
张清华	本基金的基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自2015年04月02日至2018年02月01日)、易方达裕丰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(自2016年03月15日至2018年02月01日)、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自2016年03月29日至2018年02月01日)、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自2015年04月17日至2018年02月01日)、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自2016年03月15日至2018年02月01日)、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自2015年12月09日至2018年02月01日)、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自2016年12月07日至2018年02月01日)、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自2016年08月06日至2018年02月01日)、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自2017年01月11日至2018年02月01日)、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理(自2016年12月15日至2018年02月01日)、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理、固定收益基金投资部总经理	2013-12-23	-	11年	硕士研究生,曾任晨星资讯(深圳)有限公司数量分析师,中信证券股份有限公司研究员、易方达基金管理有限公司投资经理。
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助理、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、易方达保本一号混合型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	2015-02-17	-	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、固定收益研究员、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。
田宇	本基金的基金经理助理、易方达恒久添利1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、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助理、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理助理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理助理	2017-02-24	-	7年	硕士研究生,曾任中信证券股份有限公司资金运营部研究员,中信建投证券股份有限公司固定收益部投资经理、易方达恒久添利1年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。

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年上半年债券市场波动较大。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17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,价格出现明显下跌,权益市场的相关板块也出现一定回撤。同时3月下旬中美贸易摩擦进一步升温,进一步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,民企和城投平台债收益率大幅上行,融资困难,低等级信用利差大幅扩张。

权益市场波动同样剧烈。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影响日益悲观,同时对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,股票市场各个板块均经历了较大幅度的调整。

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。权益部分持仓以盈利增长稳定、估值合理的股票为主,并保持了较高的转债仓位,转债对组合净值的影响较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.514元,本报告期份额净值增长率为-4.95%;B类基金份额净值为1.502元,本报告期份额净值增长率为-5.16%;同期业绩比较基准收益率为1.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,虽然货币政策和财政政策均明显转向,但预计仍较难在短期内改变经济下行的方向。分项看,上半年房地产投资一枝独秀,但相对领先的300城土地成交数据在6月份出现了较大幅度下滑,预计随着龙头房企补库存完成、资金链收紧和棚改退出预期的影响,土地投资增速下滑将逐渐对地产投资增速构成拖累,房地产投资增速高点大概率已经见到。出口方面,上半年压力不大,但考虑到出口商对于贸易战的担忧提前备货出口的倾向较为明显,下半年随着贸易战的升温,出口的压力将会越来越显著。基建方面,上半年下滑幅度较大,但考虑到本次地方政府各方面的约束较大,稳增长传递效果可能较慢,基建投资很难在短期内大幅提升。债券面临的基本面环境并未发生本质变化。但值得注意的是,债券市场前期对经济的预期较为悲观,需要警惕预期差引起的市场波动风险。

本基金将继续保持较高的杠杆水平,债券部分以获取较为确定的持有期回报为主。权益部分将继续积极把握股票市场结构性机会,并根据市场情况灵活调整仓位,力争以优异的业绩回报基金持有人。

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

易方达安心回报债券A:本报告期内实施的利润分配金额为222,543,755.17元。

易方达安心回报债券B:本报告期内实施的利润分配金额为132,406,487.92元。

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

本报告期内,本基金托管人在对易方达安心回报债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,易方达安心回报债券型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达安心回报债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,易方达安心回报债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为354,950,243.09元。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达安心回报债券型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

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:易方达安心回报债券型证券投资基金

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	1,369,452.10	2,349,999.28
结算备付金	135,681,485.48	12,736,722.91
存出保证金	659,647.64	485,581.83
交易性金融资产	8,358,924,724.45	7,750,795,899.99
其中:股票投资	1,244,249,318.01	1,459,214,707.30
基金投资	-	-
债券投资	7,114,675,406.44	6,291,581,192.69
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	-	195,820,613.73
应收证券清算款	160,133,449.64	16,781,423.28
应收利息	48,653,020.99	68,189,106.57
应收股利	-	-
应收申购款	2,929,539.58	5,627,458.88
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,708,351,319.88	8,052,786,806.47
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	1,942,000,000.00	698,000,000.00
应付证券清算款	115,790,355.63	-
应付赎回款	73,857,144.13	24,144,676.43
应付管理人报酬	3,944,138.60	4,470,620.58
应付托管费	1,126,896.73	1,277,320.14
应付销售服务费	864,585.15	1,000,462.70
应付交易费用	500,078.66	894,515.90
应交税费	354,714.01	126,944.80
应付利息	1,135,673.07	725,652.57
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	472,469.20	422,431.25
负债合计	2,140,046,055.18	731,062,624.37
所有者权益:		
实收基金	4,351,704,037.91	4,421,441,154.20
未分配利润	2,216,601,226.79	2,900,283,027.90
所有者权益合计	6,568,305,264.70	7,321,724,182.10
负债和所有者权益总计	8,708,351,319.88	8,052,786,806.47

注:报告截止日2018年6月30日,A类基金份额净值1.514元,B类基金份额净值1.502元;基金份额总额4,351,704,037.91份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额2,591,832,949.41份,B类基金份额总额1,759,871,088.50份。

6.2 利润表

会计主体:易方达安心回报债券型证券投资基金

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	-357,340,691.44	331,437,756.26
1.利息收入	81,011,015.09	41,292,172.85
其中:存款利息收入	914,015.60	410,455.49
债券利息收入	79,523,141.38	40,485,712.46
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	573,858.11	396,004.90
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	53,135,774.89	26,581,885.97
其中:股票投资收益	73,357,120.61	17,056,632.76
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-34,768,810.06	-84,297.24
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	14,547,464.34	9,609,550.45
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-493,809,137.65	263,253,404.16
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	2,321,656.23	310,293.28
减:二、费用	83,221,375.62	34,111,626.34
1. 管理人报酬	27,770,660.25	13,849,765.85
2. 托管费	7,934,474.37	3,957,076.04
3. 销售服务费	6,273,949.20	3,975,509.37
4. 交易费用	2,612,288.26	2,042,308.48
5. 利息支出	38,148,967.93	10,049,289.42
其中:卖出回购金融资产支出	38,148,967.93	10,049,289.42
6. 税金及附加	235,900.73	-
7. 其他费用	245,134.88	237,677.18
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-440,562,067.06	297,326,129.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-440,562,067.06	297,326,129.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达安心回报债券型证券投资基金

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)	4,421,441,154.20	2,900,283,027.90	7,321,724,182.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-440,562,067.06	-440,562,067.06
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)	-69,737,116.29	111,830,509.04	42,093,392.75
其中:1.基金申购款	2,955,650,687.12	1,928,337,445.82	4,883,988,132.94
2.基金赎回款	-3,025,387,803.41	-1,816,506,936.78	-4,841,894,740.19
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)	-	-354,950,243.09	-354,950,243.09
五、期末所有者权益(基金净值)	4,351,704,037.91	2,216,601,226.79	6,568,305,264.70
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)	2,843,679,970.06	1,371,486,757.70	4,215,166,727.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	297,326,129.92	297,326,129.92
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)	-298,940,657.76	-141,833,915.51	-440,774,573.27
其中:1.基金申购款	485,489,762.10	263,897,131.89	749,386,893.99
2.基金赎回款	-784,430,419.86	-405,731,047.40	-1,190,161,467.26
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)	2,544,739,312.30	1,526,978,972.11	4,071,718,284.41

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

易方达安心回报债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]665号《关于核准易方达安心回报债券型证券投资基金募集的批复》核准,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《易方达安心回报债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达安心回报债券型证券投资基金基金合同》于2011年6月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,790,229,532.54份基金份额,其中认购资金利息折合786,926.23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,注册登记机构为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

(1)印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

(2)增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让,按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定,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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,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(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,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;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。

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。

(3)企业所得税

证券投资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,股权的股息、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。

(4)个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金从上市公司分配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,减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,减按25%计入应纳税所得额;自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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
中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")	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

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股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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	27,770,660.25	13,849,765.85
其中:支付销售机构的客户维护费	3,688,931.38	2,985,482.82

注:基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.70%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起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、公休假等,支付日期顺延。

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	7,934,474.37	3,957,076.04

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.20%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B	合计
易方达基金管理有限公司	-	4,007,166.84	4,007,166.84
中国工商银行	-	516,024.14	516,024.14
广发证券	-	5,971.45	5,971.45
合计	-	4,529,162.43	4,529,162.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,940,619.55	1,940,619.55
中国工商银行	-	490,065.30	490,065.30
广发证券	-	5,785.01	5,785.01
合计	-	2,436,469.86	2,436,469.86

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,B类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

本基金销售服务费按前一日B类基金资产净值的0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.40%÷当年天数

H为B类基金份额每日应计提的销售服务费

E为B类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性划出,由注册登记机构代收,注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

易方达安心回报债券A

无。

易方达安心回报债券B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2017年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发期货有限公司	10,000,450.00	0.57%	10,000,450.00	0.59%

注:除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。广发期货有限公司是基金管理人股东广发证券控制的机构。

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
中国工商银行-活期存款	1,369,452.10	190,260.98	1,726,200.30	67,983.22

注:本基金的上述银行存款由基金托管人中国工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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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
000568	泸州老窖	2017-09-13	2018-09-14	非公开发行流通受限	48.00	58.45	583,333	27,999,984.00	34,095,813.85	-
000568	泸州老窖	2017-09-13	2019-09-16	非公开发行流通受限	48.00	55.31	583,333	27,999,984.00	32,264,148.23	-

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%。

6.4.9.2 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1,942,000,000.00元,于2018年7月2日、2018年7月3日、2018年7月4日、2018年7月5日、2018年7月6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5,021,131,812.77元,属于第二层次的余额为3,337,792,911.68元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次3,600,166,192.32元,第二层次4,150,629,707.67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	1,244,249,318.01	14.29
	其中:股票	1,244,249,318.01	14.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,114,675,406.44	81.70
	其中:债券	7,114,675,406.44	81.70
	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	-	-
	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	137,050,937.58	1.57
8	其他各项资产	212,375,657.85	2.44
9	合计	8,708,351,319.88	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	131,464,282.40	2.00
C	制造业	781,973,950.89	11.91
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	97,999,705.56	1.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,107,054.80	0.81
J	金融业	104,380,304.36	1.59
K	房地产业	75,324,020.00	1.15
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	1,244,249,318.01	18.94

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	000651	格力电器	3,009,414	141,893,870.10	2.16
2	600426	华鲁恒升	6,045,657	106,343,106.63	1.62
3	601318	中国平安	1,781,842	104,380,304.36	1.59
4	600009	上海机场	1,766,397	97,999,705.56	1.49
5	002008	大族激光	1,833,185	97,507,110.15	1.48
6	600188	兖州煤业	6,451,753	84,130,859.12	1.28
7	600048	保利地产	6,174,100	75,324,020.00	1.15
8	002179	中航光电	1,880,692	73,346,988.00	1.12
9	000568	泸州老窖	1,166,666	66,359,962.08	1.01
10	600660	福耀玻璃	2,420,022	62,218,765.62	0.95

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.efunds.com.cn网站的半年度报告正文。

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	600188	兖州煤业	125,559,629.49	1.71
2	601088	中国神华	119,008,625.79	1.63
3	600596	新安股份	110,487,509.89	1.51
4	600426	华鲁恒升	76,660,726.85	1.05
5	601225	陕西煤业	73,173,895.27	1.00
6	600029	南方航空	64,617,657.05	0.88
7	600115	东方航空	60,020,742.34	0.82
8	600845	宝信软件	47,665,345.20	0.65
9	600887	伊利股份	19,400,803.22	0.26
10	600009	上海机场	19,253,004.43	0.26
11	600585	海螺水泥	13,089,161.64	0.18
12	002236	大华股份	12,973,298.00	0.18
13	002217	合力泰	6,532,945.28	0.09
14	601012	隆基股份	6,521,203.80	0.09
15	600901	江苏租赁	6,250.00	0.00
16	002926	华西证券	4,730.00	0.00

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	601088	中国神华	90,947,303.00	1.24
2	600596	新安股份	80,520,151.56	1.10
3	600426	华鲁恒升	71,886,849.84	0.98
4	000651	格力电器	70,503,967.90	0.96
5	002179	中航光电	67,776,311.38	0.93
6	002008	大族激光	64,868,256.73	0.89
7	000921	海信科龙	63,739,904.61	0.87
8	600115	东方航空	53,748,047.60	0.73
9	600029	南方航空	49,917,574.13	0.68
10	600056	中国医药	40,110,468.08	0.55
11	000537	广宇发展	37,897,667.21	0.52
12	002572	索菲亚	32,516,524.10	0.44
13	601336	新华保险	30,940,574.31	0.42
14	000568	泸州老窖	29,796,138.90	0.41
15	601318	中国平安	29,753,260.45	0.41
16	002366	台海核电	21,726,606.53	0.30
17	002415	海康威视	18,058,246.70	0.25
18	600196	复星医药	17,383,097.00	0.24
19	601225	陕西煤业	17,180,193.04	0.23
20	600009	上海机场	12,943,127.00	0.18

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	754,975,528.25
卖出股票收入(成交)总额	913,389,830.17

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	67,123,000.00	1.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	522,614,000.00	7.96
	其中:政策性金融债	522,614,000.00	7.96
4	企业债券	559,581,231.00	8.52
5	企业短期融资券	110,648,000.00	1.68
6	中期票据	367,729,000.00	5.60
7	可转债(可交换债)	5,486,980,175.44	83.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,114,675,406.44	108.32

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	132013	17宝武EB	6,315,320	632,479,298.00	9.63
2	132009	17中油EB	6,248,330	608,337,408.80	9.26
3	113011	光大转债	5,752,190	583,732,241.20	8.89
4	123006	东财转债	3,783,507	455,042,386.89	6.93
5	113008	电气转债	3,778,030	378,860,848.40	5.77

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

7.12.1宁行转债(代码:128024)为易方达安心回报债券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。

常熟转债(代码:113018)为易方达安心回报债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2017年12月15日,苏州银监分局针对江苏常熟农村商业银行通过交易所转标和借通道等方式,规避非标准化债权资产业务监管指标要求的违法违规事实,处以人民币40万元行政处罚。

三一转债(代码:110032)为易方达安心回报债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2017年7月19日,北京市发展和改革委员会针对三一重工违反《中华人民共和国节约能源法》第十七条"禁止使用国家明令淘汰的用能设备"规定,处以没收Y2160L-4型(编号:2420)等总计15台电动机的行政处罚。

本基金投资宁行转债、常熟转债、三一转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除宁行转债、常熟转债、三一转债外,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	659,647.64
2	应收证券清算款	160,133,449.64
3	应收股利	-
4	应收利息	48,653,020.99
5	应收申购款	2,929,539.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	212,375,657.85

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	113011	光大转债	583,732,241.20	8.89
2	123006	东财转债	455,042,386.89	6.93
3	113008	电气转债	378,860,848.40	5.77
4	113009	广汽转债	285,999,420.00	4.35
5	113013	国君转债	245,207,684.70	3.73
6	128024	宁行转债	221,049,089.58	3.37
7	110032	三一转债	214,432,917.00	3.26
8	110033	国贸转债	136,481,118.20	2.08
9	110034	九州转债	135,040,000.00	2.06
10	132008	17山高EB	125,442,575.00	1.91
11	132002	15天集EB	120,599,809.00	1.84
12	110030	格力转债	87,660,096.70	1.33
13	113014	林洋转债	77,606,400.00	1.18
14	110038	济川转债	77,107,965.00	1.17
15	123004	铁汉转债	68,142,872.76	1.04
16	123002	国祯转债	55,940,500.00	0.85
17	128022	众信转债	54,553,089.74	0.83
18	132007	16凤凰EB	49,173,000.00	0.75
19	128010	顺昌转债	34,505,481.84	0.53
20	120001	16以岭EB	32,526,267.20	0.50
21	128016	雨虹转债	29,935,147.34	0.46
22	113015	隆基转债	26,769,521.60	0.41
23	128014	永东转债	20,632,100.00	0.31
24	127003	海印转债	18,830,243.10	0.29
25	132005	15国资EB	13,704,668.60	0.21
26	128015	久其转债	8,975,023.20	0.14
27	128013	洪涛转债	2,743,111.20	0.04
28	127004	模塑转债	2,161,041.19	0.03

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	000568	泸州老窖	34,095,813.85	0.52	非公开发行流通受限
2	000568	泸州老窖	32,264,148.23	0.49	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%。

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	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
易方达安心回报债券A	91,080	28,456.66	1,341,785,239.84	51.77%	1,250,047,709.57	48.23%
易方达安心回报债券B	28,725	61,266.18	1,049,835,739.35	59.65%	710,035,349.15	40.35%
合计	119,805	36,323.23	2,391,620,979.19	54.96%	1,960,083,058.72	45.04%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达安心回报债券A	96,955.95	0.0037%
	易方达安心回报债券B	95,726.52	0.0054%
	合计	192,682.47	0.0044%

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	份额级别	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	易方达安心回报债券A	0
	易方达安心回报债券B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达安心回报债券A	0
	易方达安心回报债券B	0
	合计	0

9开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B
基金合同生效日(2011年6月21日)基金份额总额	476,546,478.86	1,313,683,053.68
本报告期期初基金份额总额	2,717,259,042.16	1,704,182,112.04
本报告期基金总申购份额	1,586,625,044.12	1,369,025,643.00
减:本报告期基金总赎回份额	1,712,051,136.87	1,313,336,666.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,591,832,949.41	1,759,871,088.50

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
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	1,194,291,225.88	73.69%	1,112,243.86	76.53%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	426,397,807.34	26.31%	341,117.36	23.47%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增国盛证券有限责任公司一个交易单元。

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
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	48,993,600.00	1.19%	-	-	-	-
国信证券	2,753,909,758.00	66.93%	117,866,300,000.00	96.91%	-	-
长江证券	19,739,200.00	0.48%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	1,291,712,552.16	31.40%	3,762,000,000.00	3.09%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

易方达基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日