易方达现金增利货币市场基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十四日

§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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达现金增利货币		
基金主代码	000620		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年2月5日		
报告期末基金份额总额	27,337,537,513.51份		
投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量市场资金面走向、存款银行的信用资质、信用债券的信用评级以及各类资产的收益率水平、流动性特征等,确定各类资产的配置比例,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。		
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。		
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		
下属分级基金的基金简称	易方达现金增利货币A	易方达现金增利货币B	易方达现金增利货币C
下属分级基金的交易代码	000620	000621	005097
报告期末下属分级基金的份额总额	568,463,409.80份	26,769,073,363.29份	740.42份

注:自2018年3月8日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2018年3月12日。

§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7月1日-2018年9月30日)		
	易方达现金增利货币A	易方达现金增利货币B	易方达现金增利货币C
1.本期已实现收益	5,773,399.26	272,441,555.17	7.27
2.本期利润	5,773,399.26	272,441,555.17	7.27
3.期末基金资产净值	568,463,409.80	26,769,073,363.29	740.42

注:1.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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达现金增利货币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	0.9404%	0.0007%	0.3456%	0.0000%	0.5948%	0.0007%

易方达现金增利货币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	1.0016%	0.0007%	0.3456%	0.0000%	0.6560%	0.0007%

易方达现金增利货币C

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	0.9916%	0.0009%	0.3456%	0.0000%	0.6460%	0.0009%

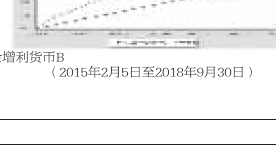
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达现金增利货币市场基金

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

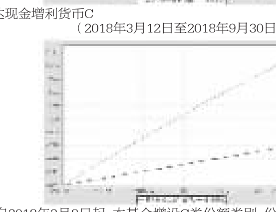
易方达现金增利货币A

(2015年2月5日至2018年9月30日)



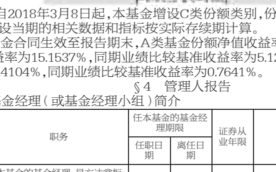
易方达现金增利货币B

(2015年2月5日至2018年9月30日)



易方达现金增利货币C

(2018年3月12日至2018年9月30日)



注:1.自2018年3月8日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2018年3月12日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为14.1526%,B类基金份额净值收益率为15.1537%,同期业绩比较基准收益率为5.1296%。C类基金份额净值收益率为2.4104%,同期业绩比较基准收益率为0.7641%。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石大怿	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、易方达易理财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、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益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助理、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	2015-02-05	-	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。
梁莹	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、易方达天天增利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、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益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、易方达易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	2015-06-19	-	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"离任日期"为公告确定的解聘日期,石大怿的"任职日期"为基金合同生效之日,梁莹的"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。

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24次,其中23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年三季度国内经济数据较为平稳,但受到前期融资环境收紧以及中美贸易摩擦升温的影响,市场对于未来经济下行的担忧加剧。三季度初,货币政策维持宽松,债券市场流动性较为充裕,无风险利率显著下行。内、外部环境双重影响下,经济增长乏力,财政政策也出现调整,同时表内信贷投放增多,社会融资总量增速也有所企稳。在稳增长政策的预期下,市场对于政策效果的期待较高。美国经济在三季度表现强劲,美债利率创出新高,人民币汇率贬值压力大幅上升。三季度,由于受到供给的影响,大宗商品价格走势较强,此外猪肉和蔬菜价格上涨使得市场对于通胀的担忧加剧。上述多重因素一起推动无风险利率在三季度后期出现明显上行。尽管银行表内信贷投放加速,但是在风险偏好下降的背景下,企业融资的压力仍较大。三季度债券违约事件频发,信用风险继续发酵。货币市场利率在三季度总体下行显著,货币市场基金收益率也缓慢下行。

操作方面,报告期内基金以同业存单、同业存款和短期逆回购为主要配置资产。在三季度组合保持了适中的剩余期限和杠杆率。总体来看,组合在三季度保持了较好的流动性和较稳定的收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A类基金份额净值收益率为0.9404%;B类基金份额净值收益率为1.0016%;C类基金份额净值收益率为0.9916%;同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

§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	固定收益投资	13,879,503,930.21	49.44
	其中:债券	13,879,503,930.21	49.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,095,119,401.72	7.46
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	11,852,362,184.52	42.22
4	其他资产	246,645,816.57	0.88
5	合计	28,073,631,333.02	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		3.24
	其中:买断式回购融资		-
2	报告期末债券回购融资余额	713,022,530.46	2.61
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	103

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	15.53	2.61
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	3.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	39.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.41	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	40.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.79	2.61

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	358,849,192.29	1.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,030,834,998.69	3.77
	其中:政策性金融债	1,030,834,998.69	3.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,235,009,205.50	11.83
6	中期票据	250,408,902.56	0.92
7	同业存单	9,004,401,631.17	32.94
8	其他	-	-
9	合计	13,879,503,930.21	50.77
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111816232	18上海银行CD232	12,600,000	1,257,793,591.46	4.60
2	111810446	18兴业银行CD446	11,000,000	1,093,772,736.32	4.00
3	111810422	18兴业银行CD422	9,000,000	895,460,057.99	3.28
4	111804036	18中国银行CD036	8,000,000	788,908,742.20	2.89
5	011801340	18招商局SCP006	5,000,000	499,255,726.83	1.83
6	111806087	18交通银行CD087	5,000,000	488,594,680.18	1.79
7	111820169	18广发银行CD169	4,000,000	398,072,041.87	1.46
8	111803149	18农业银行CD149	4,000,000	389,842,925.04	1.43
9	111809257	18浦发银行CD257	3,500,000	348,313,036.63	1.27
9	111811247	18平安银行CD247	3,500,000	348,313,036.63	1.27

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	2次
报告期内偏离度的最高值	0.2574%
报告期内偏离度的最低值	0.1283%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1736%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下:

(1)基金持有的债券(包括票据)购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入,每日计提收益;

(2)基金持有的回购以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;合同利率与实际利率差异较小的,也可采用合同利率计算确定利息收入;

(3)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项,按国家最新规定估值。

5.9.218平安银行CD247(代码:111811247)为易方达现金增利货币市场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。2018年6月28日,天津银监局针对平安银行贷前调查不到位,向环保未达标的企业提供融资;贷后管理失职,流动资金贷款被挪用,罚款人民币50万元。2018年7月26日,中国人民银行针对平安银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告,罚款人民币140万元。

18上海银行CD232(代码:111816232)为易方达现金增利货币市场基金的前十大持仓证券。2018年1月4日,上海银监局针对2015年上海银行对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎,部分理财资金用于增资和缴交土地出让金,与合同约定用途不一致的违法违规事实,责令上海银行改正,并处以人民币50万元行政处罚。

18广发银行CD169(代码:111820169)为易方达现金增利货币市场基金的前十大持仓证券。2017年11月17日,中国银监会针对广发银行的如下事由给予警告,没收违法所得人民币17553.79万元,并处3倍罚款人民币52661.37万元,对其他违法行为罚款人民币2000万元,罚没合计人民币72215.16万元:(一)出具与事实不符的金融票证;(二)未尽职审查保理业务贸易背景真实性;(三)内控管理严重违反审慎经营规则;(四)劳务派遣用工管理不到位;(五)对押品评估费用管理不到位;(六)未向监管部门报告风险信息;(七)未向监管部门报告重要信息系统突发事件;(八)会计核算管理薄弱;(九)信息系统与业务流程控制未按规定执行;(十)流动资金贷款用途监督不到位,未尽职审查银行承兑汇票贸易背景真实性;(十一)以流动资金贷款科目向房地产开发企业发放贷款;(十二)报送监管数据不真实。2018年5月31日,中国保监会广东监管局针对广发银行股份有限公司信用卡中心电销工作人员使用不实表述向投保人促销、电销工作人员未告知保险合同重要情况的违法违规事实,责令改正并处以人民币46万元行政处罚。

18浦发银行CD257(代码:111809257)为易方达现金增利货币市场基金的前十大持仓证券。根据上海浦东发展银行股份有限公司董事会2018年1月19日发布的《关于成都分行处罚事项的公告》,银监会四川监管局对成都分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处,并执行罚款46,175万元人民币。2018年2月12日,中国银监会针对上海浦东发展银行股份有限公司的如下事由罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款;(三)通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节;(四)理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求;(五)提供不实说明材料、不配合调查取证;(六)以贷转存,虚增存贷款;(七)票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严;(八)国内信用证业务贸易背景审查不严;(九)贷款管理严重缺失,导致大额不良贷款;(十)违规通过同业投资转存款方式,虚增存款;(十一)票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理;(十二)对代理收付资金的信托计划提供保本承诺;(十三)以存放同业业务名义开办委托定向投资业务,并少计风险资产;(十四)投资多款同业理财产品未尽职审查,涉及金额较大;(十五)修改总行理财合同标准文本,导致理财资金实际投向与合同约定不符;(十六)为非保本理财产品出具保本承诺函;(十七)向关系人发放信用贷款;(十八)向客户收取服务费,但未提供实质性服务,明显质价不符;(十九)收费超过服务价格目录,向客户转嫁成本。2018年3月19日,上海银监局针对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心2016年至2017年部分信用卡现金分期资金被用于证券交易,2015年至2017年部分信用卡分期资金被用于非消费领域,严重违反审慎经营规则的违法违规事实,责令改正,罚没合计人民币1751651.7元。2018年7月26日,中国人民银行针对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易,罚款人民币170万元。

18兴业银行CD446(代码:111810446)、18兴业银行CD422(代码:111810422)为易方达现金增利货币市场基金的前十大持仓证券。2018年3月26日,中国人民银行福州中心支行针对兴业银行股份有限公司违反国库管理规定的违法行为,给予警告并处罚款5万元人民币。2018年4月19日,中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行股份有限公司的如下事由罚款5870万元:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

18交通银行CD087(代码:111806087)为易方达现金增利货币市场基金的前十大持仓证券。2018年7月26日,中国人民银行针对交通银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户的违法违规事实,罚款人民币130万元。

本基金投资18平安银行CD247、18上海银行CD232、18广发银行CD169、18浦发银行CD257、18兴业银行CD446、18兴业银行CD422、18交通银行CD087的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除18平安银行CD247、18上海银行CD232、18广发银行CD169、18浦发银行CD257、18兴业银行CD446、18兴业银行CD422、18交通银行CD087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。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	211,806,812.00
4	应收申购款	34,839,004.57
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	246,645,816.57

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达现金增利货币A	易方达现金增利货币B	易方达现金增利货币C
报告期期初基金份额总额	645,491,114.40	26,645,981,342.50	733.15
报告期基金总申购份额	306,308,499.62	10,161,634,993.97	7.27
报告期基金总赎回份额	383,336,204.22	10,038,542,973.18	-
报告期期末基金份额总额	568,463,409.80	26,769,073,363.29	740.42

§7 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.中国证监会核准易方达现金增利货币市场基金募集的文件;

2.《易方达现金增利货币市场基金基金合同》;

3.《易方达现金增利货币市场基金托管协议》;

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

二〇一八年十月二十四日

易方达供给改革灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十四日

§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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达供给改革混合
基金主代码	002910
交易代码	002910
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月25日
报告期末基金份额总额	77,395,677.06份
投资目标	本基金在控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券等资产类别的配置比例。在行业配置方面,本基金将自上而下地综合考虑经济周期、产业发展规律、产业政策等因素,进行股票资产在与供给改革主题相关的行业间的配置。在个股选择方面,本基金将精选与供给改革主题相关的受益于创新红利、制度红利和落后产能淘汰、产能优化重组的相关上市公司。在债券投资方面,本基金将通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债新综合财富指数收益率×35%
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7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-8,840,669.04
2.本期利润	-3,425,122.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0303
4.期末基金资产净值	72,171,803.51
5.期末基金份额净值	0.9325

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

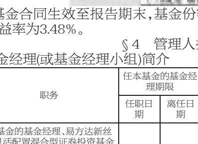
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.39%	1.44%	-0.82%	0.88%	-1.57%	0.56%

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

易方达供给改革灵活配置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1月25日至2018年9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-6.75%,同期业绩比较基准收益率为3.48%。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
常远	本基金的基金经理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达国防军工混合型证券投资基金的基金经理助理	2017-01-25	-	8年	博士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、投资经理、科瑞证券投资基金基金经理、易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
陈皓	本基金的基金经理、易方达新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达平稳增长证券投资基金的基金经理、易方达科翔混合型证券投资基金的基金经理、易方达国防军工混合型证券投资基金的基金经理、投资一部总经理	2017-01-25	-	11年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理、投资一部总经理助理、投资一部副总经理、易方达价值精选混合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24次,其中23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年三季度,在高频数据预示国内经济可能出现下行风险以及国际贸易摩擦加剧的背景下,上证综指下跌0.92%,同期创业板综指下跌11.84%。周期行业在产品价格和盈利高位震荡的情况下,也同步出现了一定程度的调整,整体估值进一步下降,体现了投资者对于未来经济形势和市场风险的担心。

三季度,本基金增加了采掘和油气相关资产的配置,降低了钢铁、有色等板块的配置,获得了较为明显的超额收益。展望四季度,受益于供给侧改革深化的细分子行业仍可能带来一定的回报。

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0.9325元,本报告期份额净值增长率为-2.39%,同期业绩比较基准收益率为-0.82%。

§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	67,237,602.86	92.20
	其中:股票	67,237,602.86	92.20
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	5,547,350.89	7.61
7	其他资产	140,888.24	0.19
8	合计	72,925,841.99	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	9,666,028.00	13.39
C	制造业	56,456,574.86	78.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,115,000.00	1.54
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	-	-
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	67,237,602.86	93.16

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	601225	陕西煤业	800,000	6,960,000.00	9.64
2	600426	华鲁恒升	334,400	5,755,024.00	7.97
3	002376	新北洋	313,400	5,556,582.00	7.70
4	600585	海螺水泥	150,000	5,518,500.00	7.65
5	600803	新奥股份	350,000	5,271,000.00	7.30
6	002353	杰瑞股份	200,000	4,356,000.00	6.04
7	600740	山西焦化	452,900	4,302,550.00	5.96
8	000932	华菱钢铁	500,000	4,195,000.00	5.81
9	000902	新洋丰	400,000	3,708,000.00	5.14
10	002217	合力泰	609,500	3,419,295.00	4.74

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	113,245.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,837.16
5	应收申购款	22,805.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,888.24

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	002217	合力泰	3,419,295.00	4.74	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	110,555,696.86
报告期基金总申购份额	16,456,415.22
减:报告期基金总赎回份额	49,616,435.02
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	77,395,677.06

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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					报告期末持有基金情况	
	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	持有份额	份额占比
机构	1	2018年07月01日~2018年09月24日	37,361,292.73	-	37,361,292.73	-	-

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的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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达供给改革灵活配置混合型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达供给改革灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达供给改革灵活配置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。

9.2 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。

9.3 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

二〇一八年十月二十四日

易方达国防军工混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十四日

§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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达国防军工混合
基金主代码	001475
交易代码	001475
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月19日
报告期末基金份额总额	5,253,595,348.23份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资方面,本基金将根据对国防军工行业各细分子行业(主要包括航空、航天、兵器、船舶、信息安全等)的综合分析,确定各细分子行业的资产配置比例。在各细分子行业中,本基金将选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的上市公司进行投资。当各细分子行业与上市公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时,本基金将对股票组合适时进行调整。在债券投资方面,本基金将通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	申万国防军工指数收益率×70%+一年期人民币定期存款利率(税后)×30%
风险收益特征	本基金为混合基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票基金,高于债券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7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-369,825,958.65
2.本期利润	-33,431,755.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0064
4.期末基金资产净值	3,925,416,924.23
5.期末基金份额净值	0.747

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

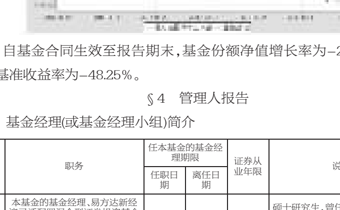
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.71%	1.69%	1.61%	1.27%	-3.32%	0.42%

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

易方达国防军工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

(2015年6月19日至2018年9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-25.30%,同期业绩比较基准收益率为-48.25%。

§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈皓	本基金的基金经理、易方达新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达平稳增长证券投资基金的基金经理、易方达科翔混合型证券投资基金的基金经理、易方达供给改革灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、投资一部总经理	2015-06-19	-	11年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理、投资一部总经理助理、投资一部副总经理、易方达价值精选混合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24次,其中23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年三季度,上证综指下跌0.92%,创业板综指下跌11.84%,同期申万一级军工指数上涨了1.82%,显著跑赢市场。军工板块体的估值水平处于历史低位,同时军工需求继续保持强势增长,并且这一趋势在三季度更为显著。本基金在板块上涨过程中逐步增加了一些核心标的的持仓权重。军工板块2018年仍然可能出现明显的相对收益,本基金将持续关注和投资于军工板块中业绩突出、估值合理的优质个股。

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0.747元,本报告期份额净值增长率为-1.71%,同期业绩比较基准收益率为1.61%。

§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	3,402,919,581.08	86.42
	其中:股票	3,402,919,581.08	86.42
2	固定收益投资	132,259,594.84	3.36
	其中:债券	132,259,594.84	3.36
	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	399,263,758.68	10.14
7	其他资产	3,250,085.74	0.08
8	合计	3,937,693,020.34	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	3,307,721,452.14	84.26
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	95,198,128.94	2.43
J	金融业	-	-
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	3,402,919,581.08	86.69

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	002179	中航光电	8,840,000	388,960,000.00	9.91
2	002013	中航机电	37,904,860	318,400,824.00	8.11
3	002025	航天电器	11,290,846	309,143,363.48	7.88
4	002384	东山精密	21,133,650	258,887,212.50	6.60
5	600967	内蒙一机	17,282,361	239,187,876.24	6.09
6	000768	中航飞机	13,500,000	214,380,000.00	5.46
7	600038	中直股份	5,300,000	211,258,000.00	5.38
8	600893	航发动力	8,400,000	202,104,000.00	5.15
9	600990	四创电子	4,700,000	202,100,000.00	5.15
10	600760	中航沈飞	4,700,000	179,070,000.00	4.56

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	100,170,000.00	2.55
	其中:政策性金融债	100,170,000.00	2.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	32,089,594.84	0.82
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	132,259,594.84	3.37

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	180209	18国开09	1,000,000	100,170,000.00	2.55
2	128045	机电转债	209,264	23,962,820.64	0.61
3	110042	航电转债	71,610	7,963,032.00	0.20
4	128020	水晶转债	1,780	163,742.20	0.00

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东山精密(代码:002384)为易方达国防军工混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。2018年8月27日,苏州东山精密制造股份有限公司董事会发布《关于高新区分公司收到行政处罚决定书的公告》,公司下属的高新区分公司收到苏州市虎丘区环境保护局出具的苏虎环行罚字(2018)第061号《行政处罚决定书》,虎丘区环境监察大队执法人员对高新区分公司进行现场监察,检查发现高新区分公司部分建设项目未完成环保验收;废水处理设施不正常运行;生产现状和环评报告中的生产情况不符;产生的废包装桶等由厂商回收,未办理危废转移联单;部分废机油桶露天堆放,危废堆放场所无标识牌;未编制环境应急预案,无事故应急池;北侧雨水总排口、玻璃切割车间旁雨水井、北侧污水总排口PH和COD指标超过国家排放标准。根据相关规定,虎丘区环保局对高新区分公司作出如下行政处罚:(1)将案件移送公安机关;(2)责令停止违法行为;(3)合计罚款人民币155.92万元。

本基金投资东山精密的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除东山精密外,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。

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	491,469.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	845,396.13
5	应收申购款	1,913,219.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,250,085.74

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	110042	航电转债	7,963,032.00	0.20
2	128020	水晶转债	163,742.20	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	4,695,268,119.77
报告期基金总申购份额	1,775,613,190.38
减:报告期基金总赎回份额	1,217,285,961.92
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	5,253,595,348.23

§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国防军工混合型证券投资基金注册的文件;

2.《易方达国防军工混合型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达国防军工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

二〇一八年十月二十四日