易方达行业领先企业混合型证券投资基金

2019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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十九日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达行业领先混合
基金主代码	110015
交易代码	110015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月26日
报告期末基金份额总额	366,408,805.87份
投资目标	在优化行业资产配置的基础上,从行业领先企业中精选行业龙头与高成长企业进行投资,力求基金资产的长期增值。
投资策略	在行业配置的基础上,本基金将从各细分行业中选择行业领先企业,然后从行业领先企业中选择行业龙头企业和具有较高成长性的公司,构造股票组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合基金,理论上其风险收益水平高于债券基金和货币市场基金,低于股票基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	-3,938,898.49
2.本期利润	18,330,217.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0491
4.期末基金资产净值	871,867,863.30
5.期末基金份额净值	2.379

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。

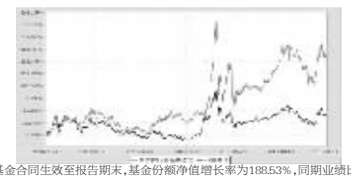
3.2 基金净值表现

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	2.10%	1.65%	-1.07%	1.22%	3.17%	0.43%

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

易方达行业领先企业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
(2009年3月26日至2019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188.53%,同期业绩比较基准收益率为48.32%。

§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		
冯波	本基金的基金经理、易方达中盘成长混合型证券投资基金的基金经理、研究部总经理	2010-01-01	-	18年	硕士研究生,曾任广东发展银行行员,易方达基金管理有限公司市场拓展部研究员、市场拓展部副经理、市场部大区销售经理、北京分公司副总经理、研究部行业研究员、基金经理助理、研究部总经理助理、研究部副总经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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《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28次,其中27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

二季度,国内外政治、经济环境较为复杂。从外部看,全球经济数据较为疲软,中美贸易谈判先恶化后缓解,不确定性加大;从国内看,经济数据较弱,货币、财政政策表现较为积极。较为复杂的国内外环境使投资者预期极不稳定,市场也相应呈现出了较大的波动性。同时,随着A股市场化和国际化趋势的持续深化,各个行业和企业的估值水平与国际成熟市场进一步靠近,这导致A股市场出现了剧烈的结构分化。截止季末,上证综指收于2979点,下跌3.62%,振幅达15.09%;中证500指数收于4950点,下跌10.76%,振幅达23.01%。

基于上述变化,本基金二季度在资产配置上,保持了相对灵活的股票仓位,根据市场变化适当调整股票投资比例。行业配置上,维持了在白酒、家电、金融、新能源发电、消费电子、医药等行业的配置。个股方面,继续坚持配置核心竞争力突出、估值水平合理、与国际市场相比较为低估的个股,取得了较好效果。

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2.379元,本报告期份额净值增长率为2.10%,同期业绩比较基准收益率为-1.07%。

§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	775,778,553.73	88.42
	其中:股票	775,778,553.73	88.42
2	固定收益投资	29,973,000.00	3.42
	其中:债券	29,973,000.00	3.42
	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	70,939,355.11	8.09
7	其他资产	682,147.74	0.08
8	合计	877,373,056.58	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	363,431.25	0.04
C	制造业	603,964,655.68	69.27
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	21,082,599.76	2.42
J	金融业	91,112,869.94	10.45
K	房地产业	12,511,997.10	1.44
L	租赁和商务服务业	31,994,000.00	3.67
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	14,749,000.00	1.69
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	775,778,553.73	88.98

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	000651	格力电器	1,500,000	82,500,000.00	9.46
2	600519	贵州茅台	75,000	73,800,000.00	8.46
3	000568	泸州老窖	700,000	56,581,000.00	6.49
4	002202	金风科技	4,500,000	55,935,000.00	6.42
5	601012	隆基股份	2,367,758	54,718,887.38	6.28
6	600036	招商银行	1,300,000	46,774,000.00	5.36
7	601318	中国平安	500,000	44,305,000.00	5.08
8	000661	长春高新	124,100	41,945,800.00	4.81
9	002475	立讯精密	1,450,000	35,945,500.00	4.12
10	002179	中航光电	937,957	31,384,041.22	3.60

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	29,973,000.00	3.44
	其中:政策性金融债	29,973,000.00	3.44
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,973,000.00	3.44

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	190302	19进出02	300,000	29,973,000.00	3.44

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招商银行(代码:600036)为易方达行业领先企业混合型证券投资基金的前十大重仓证券之一。2018年7月5日,深圳保监局针对招商银行股份有限公司电话销售欺骗投保人罚款30万元。

本基金投资招商银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除招商银行外,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	90,301.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	234,771.96
5	应收申购款	357,073.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	682,147.74

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

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	388,636,349.24
报告期基金总申购份额	28,398,299.75
减:报告期基金总赎回份额	50,625,843.12
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	366,408,805.87

§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.中国证监会核准易方达行业领先企业股票型证券投资基金募集的文件;

2.易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名及修改基金合同、托管协议的公告

3.《易方达行业领先企业混合型证券投资基金基金合同》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.《易方达行业领先企业混合型证券投资基金托管协议》;

6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

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
二〇一九年七月十九日

易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金

2019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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十九日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中证军工ETF
场内简称	中证军工
基金主代码	512560
交易代码	512560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年7月14日
报告期末基金份额总额	27,563,496.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时,基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到紧密跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中证军工指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
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

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	89,807.48
2.本期利润	-2,252,877.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0824
4.期末基金资产净值	22,167,348.69
5.期末基金份额净值	0.8042

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。

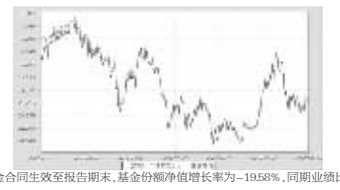
3.2 基金净值表现

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	-9.60%	1.90%	-9.85%	1.93%	0.25%	-0.03%

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

易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金
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7月14日至2019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-19.58%,同期业绩比较基准收益率为-19.05%。

§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		
余海燕	本基金的基金经理、易方达中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达新趋势混合型证券投资基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理	2017-07-14	-	14年	硕士研究生,曾任汇丰银行Consumer Credit Risk信用风险分析师,华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理、易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。

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《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28次,其中27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

二季度宏观经济的下行压力相对一季度有所加大。5月工业增加值同比增长5.0%,较4月份的5.4%进一步走低。固定资产投资方面,5月增速单月同比也由此前的5.7%降至4.4%,季调后连续两个月下滑,其回落速度有所加快。具体分项来看,制造业投资在今年以来连续4个月持续回落后虽略有反弹,但尚未扭转弱势。在目前中美贸易纠纷尚未完全解决以及工业企业利润疲弱的背景下,制造业投资仍承受压力。二季度基建投资同样维持在相对偏低水平,对冲经济回落的效果并不显著,主要是由于地方政府债务水平仍然面临较为严格的约束。虽然保持基建投资增速稳定的政策导向仍然延续,例如明确"允许将专项债券作为符合条件的重大项目资本金",但对基建投资的实际拉动效果或许比较有限。房地产投资是今年经济增速平稳的重要支撑,但5月份同比增速就跌降低至9.5%,在经历了1-4月的高速增长阶段后有所回落。此外,5月商品房销售面积单月同比增速明显放缓至-5.5%,较此前数据也出现了明显的下滑,融资方面,二季度表内信贷和社融数据低于预期,其中企业中长期贷款相对偏弱,反映实体融资需求可能仍然不足。

在上述经济增速回落的情况下,央行保持了相对较为宽松的货币政策,同时强调降低风险溢价,债券市场整体面临较好的投资环境。虽然3月份较为正面的经济数据带动债市收益率在4月一度走高,但随后呈现下行态势。值得注意的是,受质押回购难度增大的影响,6月份以来中低评级信用债收益率走高,评级利差开始出现扩大。

二季度,本基金由短期理财基金转型为中短债基金。操作上,转型之前,作为类货币产品,产品的资产配置以同业存单、同业存款、短期逆回购为主,组合保持了较好的流动性和稳定的收益。转型为中短债基金之后,配置结构发生了变化。考虑到目前中短期收益率曲线形态较为陡峭,我们主要增加了1-3年期高评级信用债品种的配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2019年6月30日,易方达安源中短债债券型证券投资基金A类基金份额净值为1.0030元,本报告期(2019年5月28日-2019年6月30日)份额净值增长率为0.30%,C类基金份额净值为1.0027元,本报告期(2019年5月28日-2019年6月30日)份额净值增长率为0.27%;同期业绩比较基准收益率为0.44%。

原易方达双月利理财债券型证券投资基金本报告期内(2019年4月1日-2019年5月27日)A类基金份额净值收益率为0.3995%;B类基金份额净值收益率为0.4451%;同期业绩比较基准收益率为0.2138%。

§5 投资组合报告

5.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

(报告期:2019年5月28日-2019年6月30日)

5.1.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	132,704,200.00	93.53
	其中:债券	132,704,200.00	93.53
	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	6,234,329.80	4.39
7	其他资产	2,938,910.76	2.07
8	合计	141,877,440.56	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.1.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 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	39,884,000.00	28.18
	其中:政策性金融债	39,884,000.00	28.18
4	企业债券	80,663,000.00	56.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	12,157,200.00	8.59
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	132,704,200.00	93.75

5.1.5 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	190202	19国开02	300,000	29,901,000.00	21.12
2	101473013	14中航航电MTN001	120,000	12,157,200.00	8.59
3	112672	18深建01	100,000	10,302,000.00	7.28
4	143273	17闽江01	100,000	10,143,000.00	7.17
5	122486	15旭辉01	100,000	10,108,000.00	7.14

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	13,976.35	0.06
C	制造业	20,529,022.40	92.61
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	1,276,010.00	5.76
J	金融业	21,337.82	0.10
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	21,840,346.57	98.52

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	601989	中国重工	413,400	2,298,504.00	10.37
2	000768	中航飞机	93,886	1,478,704.50	6.67
3	600893	航发动力	61,000	1,385,310.00	6.25
4	002179	中航光电	34,870	1,166,750.20	5.26
5	600482	中国动力	46,600	1,100,692.00	4.97
6	002465	海格通信	109,500	1,044,630.00	4.71
7	002268	卫士通	39,800	973,110.00	4.39
8	600879	航天电子	147,400	907,984.00	4.10
9	600118	中国卫星	40,100	904,255.00	4.08
10	002013	中航机电	122,300	841,424.00	3.80

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	-
2	应收证券清算款	39,863,071.62
3	应收股利	772,335.74
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	40,635,407.36

§6 开放式基金份额变动

6.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

单位:份

项目	易方达安源中短债债券A	易方达安源中短债债券C
基金合同生效日基金份额总额	45,192,290.57	96,787,364.06
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,898,756.16	7,285,072.57
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	228,389.79	13,782,423.92
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	50,862,656.94	90,290,012.71

注:本基金A类基金份额由原易方达双月利理财债券型证券投资基金B类基金份额转型而来,C类基金份额由原易方达双月利理财债券型证券投资基金A类基金份额转型而来,基金合同于2019年5月28日起生效,本报告期的相关数据按实际存续期计算。

6.2 易方达双月利理财债券型证券投资基金

单位:份

项目	易方达双月利理财债券A	易方达双月利理财债券B
本报告期期初基金份额总额	149,673,529.93	375,111,923.03
报告期基金总申购份额	451,809.43	1,080,013.66
减:报告期基金总赎回份额	53,337,975.30	330,999,646.12
本报告期期末基金份额总额	96,787,364.06	45,192,290.57

注:自2019年5月28日起原易方达双月利理财债券型证券投资基金转型为易方达安源中短债债券型证券投资基金,本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

7.1.1 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。

7.1.2 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。

7.2易方达双月利理财债券型证券投资基金

7.2.1 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双月利理财债券型证券投资基金变更注册为易方达安源中短债债券型证券投资基金的文件;

2.《易方达双月利理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》;

3.《易方达安源中短债债券型证券投资基金基金合同》;

4.《易方达安源中短债债券型证券投资基金托管协议》;

5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

6.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
二〇一九年七月十九日

易方达安源中短债债券型证券投资基金

(原易方达双月利理财债券型证券投资基金转型)

2019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:二〇一九年七月十九日

§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2019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。

自2019年5月28日起原易方达双月利理财债券型证券投资基金转型为易方达安源中短债债券型证券投资基金。原易方达双月利理财债券型证券投资基金本报告期自2019年4月1日至2019年5月27日止,易方达安源中短债债券型证券投资基金本报告期自2019年5月28日至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

基金简称	易方达安源中短债债券
基金主代码	110062
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年5月28日
报告期末基金份额总额	141,152,669.66份
投资目标	本基金主要投资中短期债券,在严格控制风险和保持较高流动性的基础上,力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资中短期债券,在严格控制风险和保持较高流动性的基础上,力求获得超越业绩比较基准的投资回报。久期策略方面,基金管理人将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,预测未来收益率曲线变动趋势,积极调整本基金的组合久期。期限结构配置方面,本基金对债券市场收益率期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,预测收益率期限结构的变化方式,确定期限结构配置策略以及各期限债券的配置比例,以达到期限投资收益最大化的目的。类属配置方面,本基金对不同类型债券品种的利差水平、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、短期融资券、中期票据等投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。个券策略方面,本基金对于信用类固定收益品种的投资,将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素,对信用债进行信用风险评估,积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资,并采取分散化投资策略,严格控制组合整体的违约风险水平。

业绩比较基准	中债综合财富(1-3年)指数收益率
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	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	易方达安源中短债债券A /