

信息披露 Disclosure

易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金


2019年第二季度报告

[illegible]

易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

易方达易智量化策略混合C



易方达易智量化策略混合C

注：1.按基金合同和招募说明书约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时资产配置比例符合基金合同（第十二部分二、投资范围、三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为-11.41%，C类基金份额净值增长率为-11.80%，同期业绩比较基准收益率为-4.76%。

§ 4 管理人承诺

4.1 基金经理（或基金经小组）简介

姓名	职务	任本基金基金经理年限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
张晖帆	系基金的基金经理，曾历任友邦保险集团中国区证券投资部副经理，现任友邦资产管理(中国)有限公司公募事业部权益投资部的基金经理	2018-10-24 — 1-24	— — 9年	硕士研究生，曾任招商基金管理有限责任公司研究员及基金经理助理，从事公募基金行业多年，具有扎实的基金理论基础和丰富的投资管理实践经验，具备证券投资基金从业资格。

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.证券从业人员的定义遵从《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约定，以公允价值进行市场，恪守社会公义为宗旨，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、规范化的投资决策和决策流程、交易流程，以强化事后监控手段来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人严格执行了公平交易制度，对公平交易的检查情况如下：

5.1 报告期末基金资产持仓情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	354,079,746.21	89.47
1.1	股票	354,079,746.21	89.47
2	固定收益投资	973,997.48	0.15
2.1	债券	973,997.48	0.15
2.2	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	—	—
6	其他资产	—	—
7	合计	355,053,743.69	100.00

易方达港股通红利灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

	<div> <div>5.2.1公平交易制度的执行情况</div> <p>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、交易所系统及强化事后监控手段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股票权益管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并实施跨行业的中台平衡机制，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则。通过投资交易系统对公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。</p> <div>5.2.2异常交易行为的专项说明</div> <p>本报告期内，公司旗下所有与投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日买入或卖出成交的单边市值超过该证券当日成交量的5%的交易次数共2次，其中2次数量占投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，1次为不同基金经理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，无不公平合理利益输送行为。经审慎核查，未发现本基金有可能导致不公平合理利益输送的异常情况。</p> <div>5.4.1报告期内基金的投资策略和业绩表现说明</div> <p>4.1报告期末基金投资策略和运作分析</p> <p>二季度以来，贸易战重新成为市场关注的焦点，从即将达成协议停止谈判重新谈判，市场也在其中反复摇摆。外部环境方面，美国经济开始出现放缓迹象，美联储的加息预期导致了市场对下半年降息的预期。中国大型经济，尤其是有效投资在流动性充裕的前提下，已有逐步企稳的趋势。</p> <p>本基金二季度的投资仓位基本稳定，并对结构进行了调整。行业方面，增加食品饮料、纺织服装的配置，降低了非银金融等行业配置。个股方面，增加了望盈高估值水平合理的个股的投资比例。</p> <div>4.2报告期内基金的业绩表现</div> <p>截至报告期末，本基金份额净值为0.8019元，本报告期份额净值增长率为0.0%，同期比较基准收益率为-1.27%。</p> <div>5 投资组合报告</div> <div>5.1 报告期末基金资产组合情况</div> <table> <tr> <th>序号</th><th>项目</th><th>金额(元)</th><th>占基金总资产的比例 (%)</th></tr> <tr> <td>1</td><td>权益投资</td><td>1,720,714,423.30</td><td>68.84</td></tr> <tr> <td></td><td>其中：股票</td><td>1,720,714,423.30</td><td>--</td></tr> <tr> <td>2</td><td>固定收益投资</td><td>--</td><td>--</td></tr> <tr> <td></td><td>其中：债券</td><td>--</td><td>--</td></tr> <tr> <td>3</td><td>贵金属投资</td><td>--</td><td>--</td></tr> <tr> <td>4</td><td>金融衍生品投资</td><td>--</td><td>--</td></tr> <tr> <td>5</td><td>买入返售金融资产</td><td>--</td><td>--</td></tr> <tr> <td></td><td>其中：应收款项类金融资产</td><td>--</td><td>--</td></tr> <tr> <td>6</td><td>其他资产</td><td>503,027,040.31</td><td>5.60</td></tr> <tr> <td>7</td><td>合计</td><td>1,087,689,628.68</td><td>100.00</td></tr> </table> <p>注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为1,564,539,858.0元，占净值比例为86.50%。</p> <div>5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合</div> <div>5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合</div> </div>	序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)	1	权益投资	1,720,714,423.30	68.84		其中：股票	1,720,714,423.30	--	2	固定收益投资	--	--		其中：债券	--	--	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：应收款项类金融资产	--	--	6	其他资产	503,027,040.31	5.60	7	合计	1,087,689,628.68	100.00
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)																																										
1	权益投资	1,720,714,423.30	68.84																																										
	其中：股票	1,720,714,423.30	--																																										
2	固定收益投资	--	--																																										
	其中：债券	--	--																																										
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：应收款项类金融资产	--	--																																										
6	其他资产	503,027,040.31	5.60																																										
7	合计	1,087,689,628.68	100.00																																										

| 注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。 2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时投资组合资产配置比例符合基金合同(第十二部分-投资组合、投资策略)和投资资产范围的有关约定。 3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-1.981%，同期业绩比较基准收益率为-2.15%。 | 4.4 基金业绩(或基金净值)小 4.4 管理人报告 | 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理任期起始 | 任本基金的基金经理任期截止 | 证券从业年限 | 说明 | |-----|---------|---------------|---------------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------| | 唐建忠 | 本基金基金经理 | 2019-03-07 | 2019-05-07 | 10年 | 硕士研究生，曾任中晋资产管理股份有限公司研究策略研究员，南京证券资产管理公司专户投资副经理，财信证券资产管理分公司国际业务部副经理，现任基金管理人公司权益投资部副经理、权益投资。 | | | | 2019-04-30 | - | 4年 | 硕士研究生，曾任德邦证券有限公司资产管理部，南方基金(香港)有限公司香港分公司权益投资副经理，现任基金管理人公司国际权益投资部副经理。 | | | | | | | 加拿大、硕士研究生，曾任PinePoint Investment Limited金融分析师，上海实业(集团)有限公司投资经理，Salomon-Changshu Industrial Greater China Asset Management Co. 基金助理，2019 Investment Management 基金助理，Citron Asset Management Limited研究员，中泰资管资产管理部权益投资副经理，现任基金管理人公司权益投资部副经理。 | | | | 2019-04-30 | - | 2年 | 硕士研究生，曾任德邦证券有限公司资产管理部，南方基金(香港)有限公司香港分公司权益投资副经理，现任基金管理人公司国际权益投资部副经理。 | |
| 注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，唐建忠的“任职日期”为基金合同生效之日，毕仲凯、陈宏初的“任职日期”为公告确定的聘任日期。 2.证券从业的含义遵从《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。 | 4.2 管理人对于报告期内本基金运作偏离度情况的说明 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，以公允价值定价，恪守诚信、客观、公平，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，为基金份额持有人寻求最大利益。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。 |

三、券投资基金	§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况				
	项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例

资金	10,000,000.00	0.1675%	10,000,000.00	0.1675%	年
基金管理人高级 管理人员	—	—	—	—	—
基金投资管理人员	—	—	—	—	—

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	111907111	19国开债 G2111	2,000,000	193,500,000.00	3.25
2	136966	国盛02	1,800,000	167,061,788.40	2.93
3	143364	17农发债	1,500,000	156,130,000.00	2.64
4	143000	19博时01	1,500,000	154,715,000.00	2.64
5	101603208	55级央行票 MTN001	1,500,000	150,350,000.00	2.49

6.6 报告期内按公允价值计量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
本基金本报告期末持有基金资产支持证券。

6.7 报告期末按公允价值计量基金资产净值比例大小排序的前五名金融负债投资明细
本基金本报告期末未持有金融负债。

6.8 报告期末按公允价值计量基金资产净值比例大小排序的前五名股权投资明细
本基金本报告期末未持有股权。

6.9 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。

6.10 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。

6.11 投资组合报告附注

6.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门公开处罚且没有出现其他任何影响其支付能力或偿债能力的负面新闻的情况。

6.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有被列于中国证监会上市公司监管处罚“重大违法失信投资者名单”中的公司，也没有被列入违规披露情形下监管关注的企业。

6.11.3 其他事项披露说明

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	997,393.60
2	应收利息/股利	520,047,113.06
3	应收账款	-
4	应收手续费	106,007,086.61
5	预付账款	-
6	其他应收款	-
7	债权投资	-
8	其他	-
9	合计	(66,422,300.40)

6.11.4 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。

6.11.5 报告期末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。

6.12 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额	5,969,015,140.51
报告期基金申购总份额	-
报告期基金赎回总份额	-
报告期基金净申购份额	-
报告期期末基金份额总额	5,969,015,140.51

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基金份额变动情况

基金管理人持有本基金基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有基金份额	-
报告期期间买入/卖出基金份额	-
报告期期末持有/卖出基金份额	-
基金管理人持有本基金基金份额	10,000,000.00
基金管理人持有本基金基金份额占基金资产净值比例(%)	0.17

基金管理人	名称	-	-	-	-
其他资产	公允价值	10,000,000.00	10,000,000.00	0.167%	-
合计		10,000,000.00	10,000,000.00	0.167%	-

9.1 报告期内前十大投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期末持有基金份额比例达到或超过20%的情况						
投资者名称	持有基金份额比例达到或超过20%的情况	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比	
机构	1	2019年04月01日至2019年06月30日	5,969,015,140.51	-	5,969,015,140.51	99.92%

产品风险提示

报告期内，本基金存在前十大投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致导致的风险主要包括：当该等持有人大额赎回时，个别投资者可能会面临赎回款项到账时间较长的问题；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，进而导致基金资产净值波动；当该等持有人大额赎回时，本基金管理人可能无法及时变现投资组合资产以应对投资者的赎回要求，

型证券投资基金

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。

4.1 报告期末按行业分类的境内股权投资投资组合				
序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
A	农、林、牧、渔业	10,389,067.00	2.68	
B	采矿业	7,082,027.26	2.03	
C	制造业	142,068,469.49	36.33	
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,532,066.00	3.06	
E	建筑业	7,005,060.00	1.80	
F	批发和零售业	32,009,064.00	8.31	
G	交通运输、仓储和邮政业	12,443,073.36	3.18	
H	住宿和餐饮业	-	-	
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,882,033.16	2.28	
J	金融业	71,236,810.54	18.10	
K	房地产业	20,108,963.08	5.23	
L	租赁和商务服务业	5,306,284.00	1.40	
M	科学研究和技术服务业	-	-	
N	水利、环境和公共设施管理业	4,300,060.00	1.09	
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-	
P	教育	-	-	
Q	卫生和社公工作	-	-	
R	文化、体育和娱乐业	10,676,070.00	2.71	
S	综合	3,339,062.00	0.90	
合计		364,079,746.31	89.88	

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组合				
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	600699	长江证券	743,500	12,722,580.00
2	601056	华友证券	1,238,700	12,461,670.00
3	002550	汇川科技	10,161,000	307,740,000.00
4	002826	欧陆科技	644,000	7,340,414.00
5	001318	中国平安	78,600	6,964,740.00
6	000803	华联发展	238,000	6,102,070.00
7	600271	航天信息	265,200	5,908,410.00
8	001928	凤凰传媒	600,300	5,608,020.00
9	600567	康缘药业	371,000	5,433,000.00
10	002076	四川路桥	606,300	5,409,320.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合				
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	国债债券	-	-	
2	央行票据	-	-	
3	金融债券	-	-	
4	企业债券	-	-	
5	企业短期融资券	-	-	
6	中期票据	-	-	
7	可转换(可交换)债券	573,997.48	0.15	
8	同业存单	-	-	
9	其他	573,997.48	0.15	
10	合计	-	-	

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组合				
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)
1	113003	环境转债	5,783	573,997.48

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				
序号	证券代码	证券名称	数量(个)	公允价值(元)
1	113003	环境转债	5,783	573,997.48

易方达港股通红利灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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		-	-
B 制造业		127,624,764.62	-
C 金融业		162,714,520.04	80.97
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		-	-
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 医药制造业		-	-
P 医药批发和零售业		-	-
Q 其他		-	-
合计		162,714,520.04	80.97

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	181,677,061.83	9.56
工业	127,624,764.62	-
必需消费品	220,280,506.50	12.11
必需消费品	166,661,111.59	9.12
金融	39,406,321.06	2.16
金融	40,076,226.41	22.16
信息技术	170,406,912.80	9.23
电信服务	137,791,824.87	7.54
公用事业	-	-
房地产	114,103,563.88	6.24
合计	1,564,520,886.16	85.00

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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	代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	03686	招商银行	3,461,000	118,063,912.28	6.64
2	00052	ASIM Pacific Technology Limited	1,360,300	96,024,391.04	5.39
3	03280	安泰体育	1,876,000	89,626,879.69	4.98
4	00709	腾讯控股	284,000	82,162,532.80	4.49
5	02216	中国神华	994,143	82,028,374.68	4.49
6	02882	舜宇光学科技	1,066,700	76,361,520.00	4.13
7	000809	华信化学	1,736,700	74,173,300.00	4.07
8	01299	友邦保险	929,000	69,560,562.36	3.91
9	04080	华润置地	9,075,000	68,469,968.88	3.83
10	000015	三一重工	4,360,113	64,883,510.04	3.65

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有债券投资。

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有债券投资。

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有资产支持证券投资。