易方达安心回报债券型证券投资基金 2019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:二〇一九年八月二十四日

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2019年8月22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2019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	5,367,312,533.96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	3,318,162,704.36份	2,049,149,829.60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,努力为投资者实现有吸引力的回报,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	010-66105799
	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	010-66105798

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(2019年1月1日至2019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	228,390,123.75	210,150,862.17
本期利润	516,774,988.08	560,691,548.04
加权平均基金份额本期利润	0.1556	0.1837
本期基金份额净值增长率	11.25%	10.99%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019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	0.0434	0.0325
期末基金资产净值	5,375,226,416.45	3,286,669,744.15
期末基金份额净值	1.620	1.604

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	1.82%	0.48%	0.31%	0.01%	1.51%	0.47%
过去三个月	-1.06%	0.63%	0.93%	0.01%	-1.99%	0.62%
过去六个月	11.25%	0.69%	1.86%	0.01%	9.39%	0.68%
过去一年	9.27%	0.63%	3.75%	0.01%	5.52%	0.62%
过去三年	17.73%	0.55%	11.24%	0.01%	6.49%	0.54%
自基金合同生效起至今	183.93%	0.79%	37.67%	0.01%	146.26%	0.78%

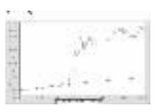
易方达安心回报债券B

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	1.78%	0.48%	0.31%	0.01%	1.47%	0.47%
过去三个月	-1.19%	0.63%	0.93%	0.01%	-2.12%	0.62%
过去六个月	10.99%	0.69%	1.86%	0.01%	9.13%	0.68%
过去一年	9.07%	0.63%	3.75%	0.01%	5.32%	0.62%
过去三年	16.57%	0.55%	11.24%	0.01%	5.33%	0.54%
自基金合同生效起至今	176.69%	0.79%	37.67%	0.01%	139.02%	0.78%

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2019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183.93%,B类基金份额净值增长率为176.69%,同期业绩比较基准收益率为37.67%。

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、广州、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。易方达始终专注于资产管理业务,通过市场化、专业化的运作,为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案,成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格,是国内基金行业为数不多的"全牌照"公司之一,在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局。

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、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理、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、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理、易方达丰利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、混合资产投资部总经理	2013-12-23	-	12年	硕士研究生,曾任晨星资讯(深圳)有限公司数量分析师,中信证券投份有限公司研究员,易方达基金管理有限公司投资经理、固定收益基金投资部总经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张雅君	本基金的基金经理助理、易方达纯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、易方达增强国开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、易方达安益回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安盛回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕利债券型证券投资基金的基金经理、易方达短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、易方达富利纯债债券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、易方达短益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利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、易方达裕惠回报定期开放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(自2016年01月19日至2018年12月31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助理(自2015年06月11日至2018年12月31日)、混合资产投资部总经理助理	2015-02-17	-	10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固定收益基金投资部总经理助理、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、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理(自2018年02月06日至2018年12月31日)、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利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、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券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、易方达丰利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、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理	2017-02-24	-	8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。
杨康	本基金的基金经理助理、易方达新享灵活配置混合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助理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2019-06-19	-	4年	硕士研究生,曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部研究员、投资经理助理。

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理/基金经理助理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定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。

3.为加强基金流动性管理,本基金安排了相关人员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62次,其中61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 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

2019年上半年债券市场跟随经济基本面和政策变化,整体震荡较大。年初在较差的经济增长预期和货币政策宽松影响下,债券收益率延续了18年的下行趋势并创出新低。此后虽然资金面仍处于宽松格局,但社融大幅增长和PMI数据超预期回升使得市场风险偏好提升,股票市场出现系统性上涨。中长端债券收益率震荡上行,收益率曲线陡峭化。受益于实体经济流动性改善以及化解地方政府债务措施出台,行业龙头企业发行的产业债和城投债信用利差出现明显压缩。二季度债券收益率波动明显加大。经济方面,4月公布的一季度经济数据较好,3月份各项经济数据超预期好转,尤其是工业增加值和地产投资上行明显,叠加通胀预期升温,打破了前期市场对经济下半年才会见底的一致预期。政策方面,货币政策重新强调"把好货币总闸门",4月中央政治局会议强调"结构性去杠杆"和"房住不炒",市场对货币收紧担忧上升,不仅是长端利率持续上行,连一季度并未明显上行的短端利率也出现了明显的抬升。进入5月后,中美贸易摩擦超预期恶化,推动避险情绪上升,央行加大货币投放,宣布定向降准稳定市场预期,加上4月份主要经济指标开始回落,债券收益率重回下行通道。5月下旬以来,包商事件打破同业刚兑信仰,持续发酵下央行加大了流动性投放力度,但流动性分层现象显现,市场风险偏好快速下降,推动长端收益率进一步下行。

权益市场方面,波动同样比较大,但整体上半年上涨明显。股票市场在开年短暂调整之后,展开了以白马蓝筹为主的强劲估值修复行情。春节后,在成长股年报业绩预告结束之后,创业板在科创板推出预期下迎来了较为明显的上涨行情,并带动各类主题出现了板块轮动下的普涨。4月初各项经济数据超预期好转,在经济见底的乐观预期下,股票市场开始出现明显上涨。但是随后的政治局会议定调和货币政策边际收紧的预期,市场开始弱势调整。5月份中美贸易谈判出现反复,市场出现进一步大幅下挫。 5月底之后,内外部环境出现一些积极的因素,包括美联储降息预期提升、人民币汇率止跌、专项债可以做资本金、中美元首互通电话以及资本市场改革等,带动市场情绪和风险偏好有所提升,市场出现小幅反弹,最终上证综指回到接近3000点,接近一季度末的位置。

一季度组合规模大幅增加,转债仓位被动有所降低,但股票仓位相较上季度有所提升。二季度组合股票仓位变化不大,杠杆水平大幅提升主要是增加了债券仓位和久期,转债仓位也有所提升。

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1.620元,本报告期份额净值增长率为11.25%;B类基金份额净值为1.604元,本报告期份额净值增长率为10.99%;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

5月贸易形势恶化之前,实体经济已经出现一定的企稳。但是贸易战以来,国内经济形势出现了一定程度的走弱。地产投资下行方向相对确定,但短期不会快速下滑,基建投资有上升空间,考虑到可选消费品的回升,经济仍然存在支撑。但是贸易形势的不确定性的确会影响相关制造业投资,同时包商事件对信用扩张也会有所影响。海外债券市场反应了较强的衰退预期,如果美国经济放缓加剧,这依然是我们面临的最大风险。经济下行压力是客观存在的,但下半年失速的风险也很低,长债收益率继续向下突破需要看到经济和社融大幅度下滑、价格大幅下滑和风险偏好的急剧下降。债券市场方向没问题,但是估值对经济悲观和货币宽松预期的反应也比较充分,估值的安全边际并不高。低利率环境下,保持中性久期,货币宽松确定,杠杆可适度偏高,避免过于激进的操作。

权益市场整体估值处于相对低位,已经较为充分地反映了对于贸易摩擦的悲观预期;但企业盈利压力依然较大,分子端不足以支撑权益市场趋势性上行。在流动性较为充裕的环境中,通过行业配置寻找价值错配的机会,通过自下而上精选个股,集中持仓获得超额收益。

本基金债券部分仍将以中高等级信用债为主,保持一定的杠杆水平;权益部分将继续根据市场情况,优化个股持仓并保持相对较高的转债仓位。同时保持组合灵活性,根据市场变化及时调仓,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、指数量化板块、投资风险管理部、监察与合规管理总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,具备投资、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,参与估值程序各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议,由中债金融估值中心有限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132,897,785.81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135,907,532.41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268,805,318.22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2019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:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	1,244,778.86	3,131,965.78
结算备付金	226,593,608.02	216,811,576.68
存出保证金	1,132,531.24	473,331.82
交易性金融资产	11,208,944,123.86	8,851,536,979.37
其中:股票投资	1,577,935,879.38	980,939,447.29
基金投资	-	-
债券投资	9,620,996,244.48	7,860,614,532.08
资产支持证券投资	10,012,000.00	9,983,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	19,800,149.70
应收证券清算款	16,576,980.23	22,020,225.00
应收利息	97,570,118.92	65,477,829.10
应收股利	-	-
应收申购款	4,117,909.23	1,422,296.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	11,556,180,050.36	9,180,674,353.87
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	2,833,507,428.74	2,542,000,000.00
应付证券清算款	52,762.96	19,137,209.10
应付赎回款	51,143,963.36	41,732,828.85
应付管理人报酬	4,945,850.29	3,959,602.24
应付托管费	1,413,100.06	1,131,314.91
应付销售服务费	1,105,675.77	1,083,744.36
应付交易费用	1,046,458.19	687,392.57
应交税费	578,914.74	405,421.80
应付利息	255,595.36	981,566.75
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	234,140.29	321,903.87
负债合计	2,894,283,889.76	2,611,440,984.45
所有者权益:		
实收基金	5,367,312,533.96	4,433,016,041.62
未分配利润	3,294,583,626.64	2,136,217,327.80
所有者权益合计	8,661,896,160.60	6,569,233,369.42
负债和所有者权益总计	11,556,180,050.36	9,180,674,353.87

注:报告截止日2019年6月30日,A类基金份额净值1.620元,B类基金份额净值1.604元;基金份额总额5,367,312,533.96份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额3,318,162,704.36份,B类基金份额总额2,049,149,829.60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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	1,162,425,472.37	-357,340,691.44
1.利息收入	115,621,108.62	81,011,015.09
其中:存款利息收入	1,592,579.94	914,015.60
债券利息收入	113,408,664.27	79,523,141.38
资产支持证券利息收入	294,262.50	-
买入返售金融资产收入	325,601.91	573,858.11
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	401,108,963.37	53,135,774.89
其中:股票投资收益	142,259,508.14	73,357,120.61
基金投资收益	-	-
债券投资收益	247,092,861.27	-34,768,810.06
资产支持证券投资收益	83,432.87	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	11,673,161.09	14,547,464.34
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	638,925,550.20	-493,809,137.65
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,769,850.18	2,321,656.23
减:二、费用	84,958,936.25	83,221,375.62
1. 管理人报酬	35,455,208.87	27,770,660.25
2. 托管费	10,130,059.65	7,934,474.37
3. 销售服务费	9,667,052.58	6,273,949.20
4. 交易费用	5,269,223.05	2,612,288.26
5. 利息支出	23,938,614.67	38,148,967.93
其中:卖出回购金融资产支出	23,938,614.67	38,148,967.93
6. 税金及附加	332,661.85	235,900.73
7. 其他费用	166,115.58	245,134.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,077,466,536.12	-440,562,067.06
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,077,466,536.12	-440,562,067.06

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:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	4,433,016,041.62	2,136,217,327.80	6,569,233,369.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,077,466,536.12	1,077,466,536.12
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)	934,296,492.34	349,705,080.94	1,284,001,573.28
其中:1.基金申购款	8,053,814,030.42	4,774,283,170.14	12,828,097,200.56
2.基金赎回款	-7,119,517,538.08	-4,424,578,089.20	-11,544,095,627.28
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)	-	-268,805,318.22	-268,805,318.22
五、期末所有者权益(基金净值)	5,367,312,533.96	3,294,583,626.64	8,661,896,160.60
项目	上年度可比期间 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

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