

(上接B265版)

报告截止日:2019年2月18日

单位:人民币元

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司(以下简称“招商基金”)	基金管理人、注册销售机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	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。

6.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.1.4.8.1.1 股票交易

关联方名称	本期 2019年2月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日	上期 2018年12月31日
成交金额	101,440,702.28	100,000
广发证券	101,440,702.28	100,000

6.1.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期末未发生过关联方交易单元进行的权证交易。

6.1.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2019年2月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日	上期 2018年12月31日
佣金	81,112.26	100,000
广发证券	81,112.26	100,000

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限

责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风

险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券

投资研究成果和市场信息服务等。

6.1.4.8.2 关联方报酬

6.1.4.8.2.1 基金管理费

项目	本期 2019年2月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日	上期 2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,120,769.06	453,673.93
其中:支付销售机构的客户维护费	66,673.93	—

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计算。管

理费的计算方法如下:

H = E × 0.80% × 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人

与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一

致的方式于次月前5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、公休日或不可抗力等,支付日期顺延。

6.1.4.8.2.2 基金托管费

项目	本期 2019年2月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日	上期 2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	289,102.29	—

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计算。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,经基金管理人

与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一

致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节

假日、公休日或不可抗力等,支付日期顺延。

6.1.4.8.2.3 销售服务费

项目	本期 2019年2月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日	上期 2018年12月31日
当期发生的基金应支付的销售服务费	289,102.29	—

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服

务费年费率为0.40%,按前一日基金资产净值的0.40%年费率计算。

销售服务费的计算方法如下:

H = E × 0.40% × 当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额净值

销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人

与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一

致的方式于次月前5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、公休日或不可抗力等,支付日期顺延。

6.1.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交

易。

6.1.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.1.4.8.4.2 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

易方达丰华债券A

无。

易方达丰华债券C

无。

6.1.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2019年2月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日	上期 2018年12月31日
招商银行—招商银行	7,042,763.40	24,599.03

注:本基金的上述银行存款由基金托管人招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。

6.1.4.8.6 本基金在承销期间参与与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期间参与关联方承销证券。

6.1.4.8.7 其他关联方交易事项的说明

6.1.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.1.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.1.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

证券代码	证券名称	认购/增发日期	期末公允价值(元)	期末公允价值占基金资产净值比例(%)
601233	工商银行	2019-07-05	3,446,346	1,000

6.1.4.9.1.2 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	认购/增发日期	期末公允价值(元)	期末公允价值占基金资产净值比例(%)
113002	华钰转债	2019-06-18	100,000	100,000

6.1.4.9.2 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。

6.1.4.9.3 期末债券正回购及作为抵押的债券

6.1.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019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39,994,500.01元,是以下债券

作为质押:

债券代码	债券名称	回购到期日	期末公允价值(元)	数量(张)	期末公允价值占基金资产净值比例(%)
101001307	16国债07	2019-07-02	102,625	100,000	100,000

债券代码	债券名称	回购到期日	期末公允价值(元)	数量(张)	期末公允价值占基金资产净值比例(%)
101003490	17国债01	2019-07-02	100,694	100,000	100,000

债券代码	债券名称	回购到期日	期末公允价值(元)	数量(张)	期末公允价值占基金资产净值比例(%)
170215	17国债15	2019-07-02	102,765	21,000	2,157,980.00

债券代码	债券名称	回购到期日	期末公允价值(元)	数量(张)	期末公允价值占基金资产净值比例(%)
170216	17国债16	2019-07-02	98,996	20,000	19,592,000.00

合计 421,000 42,479,980.00

6.1.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019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127,500,000.00元,于2019年7月

1(日)后到期。该类交易要求本基金在回购期间内持有的证券交易所

的债券和/或质押在新质押回购下转入质押库的债券,按证券交易所规

定的比例折算为质押券后,不低于债券回购交易的余额。

6.1.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(i)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。

(ii)持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年6月30日,本基金未持有非持续的公允价值计量的金融

资产。

(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。

(e)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。

6.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

6.2.1 资产负债表

会计主体:易方达保本一号混合型证券投资基金

资产	本期 2019年2月18日	上期 2018年12月31日
货币资金	147,464,268.25	600,961,493.81
结算备付金	21,697,729.75	28,849,084.06
应收利息	71,369.63	62,103.63
应收股利	—	—
应收证券清算款	—	—
其中:应收股票清算款	—	—
应收款项	—	—
其中:应收股利	—	—
其他应收款	—	—
资产支持证券	—	—
买入返售金融资产	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付利息	4,779,794.05	66,178,580.25
应付股利	—	—
应付赎回款	—	—
应付赎回费	—	—
其他应付款	—	—
其他资产	—	—
负债和所有者权益	本期 2019年2月18日	上期 2018年12月31日
负债:	—	—
短期借款	—	—
应付短期融资款	—	—
应付账款	—	—
预收账款	—	—
应付职工薪酬	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
其他应付款	—	—
其他负债	—	—
所有者权益合计	169,703,000.00	3,476,142,332.66
其中:实收资本	169,703,000.00	3,476,142,332.66
未分配利润	—	—
所有者权益合计	169,703,000.00	3,476,142,332.66
负债和所有者权益合计	169,703,000.00	3,476,142,332.66

注:报告截止日2019年2月18日,基金净值总额1,000元,基金份额总

额161,291,666.12份。

6.2.2 利润表

会计主体:易方达保本一号混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年2月18日

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月18日	上期 2018年1月1日至2018年2月18日
一、收入	4,210,416.22	35,764,886.96
1.利息收入	7,719,563.19	79,587,476.92
其中:存款利息收入	1,185,639.69	230,236.16
债券利息收入	5,236,396.79	76,602,400.70
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	1,288,466.63	654,781.16
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-6,114,626.64	-30,786,501.16
其中:股票投资收益	—	-29,949,097.11
基金投资收益	-6,114,626.64	-7,631,303.61
债券投资收益	—	—
其他投资收益	—	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	2,587,796.17	-10,849,160.95
4.其他收入(损失以“-”填列)	47,785.60	1,813,349.78
二、费用	1,942,262.29	40,893,472.69
1.管理人报酬	1,596,622.29	21,897,261.80
2.托管费	265,970.54	3,647,875.33
3.销售服务费	—	—
4.交易费用	57,000	2,542,996.69
5.利息支出	54,645	12,642,244.46
6.其他费用	54,645	12,642,244.46
其中:卖出回购金融资产支出	—	—
7.其他费用	65,943.67	233,338.08
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	2,268,133.93	-1,118,585.70
减:所得税费用	—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	2,268,133.93	-1,118,585.70

6.2.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达保本一号混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年2月18日

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月18日		所有者权益合计
	实收基金	未分配利润	
一、期初所有者权益(基金净值)	3,361,276,371.77	108,379,188.97	3,470,156,560.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		2,268,133.93	2,268,133.93
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)	-3,205,276,433.36	-105,854,594.25	-3,311,131,027.61
其中:1.基金申购款			
2.基金赎回款	-3,206,276,433.36	-106,854,594.25	-3,313,131,027.61
四、本期向基金持有人持有分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	165,988,938.41	5,292,725.65	161,291,664.06

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年2月30日		所有者权益合计
	实收基金	未分配利润	
一、期初所有者权益(基金净值)	3,777,987,580.93	85,242,473.97	3,863,230,054.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-1,118,585.70	-1,118,585.70
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)	-352,172,000.29	-8,079,416.66	-360,251,508.95
其中:1.基金申购款			
2.基金赎回款	-352,172,000.29	-8,079,416.66	-360,251,508.95
四、本期向基金持有人持有分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	3,423,815,578.64	76,044,381.61	3,499,859,960.25

报表附注为财务报表的组成部分。