

易方达恒久添利1年定期开放债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

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7次,均为指数化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

2017年三季度债券市场整体处于震荡格局。基本方面,七月经济数据下行幅度超出市场预期,固定资产投资和工业增加值增速均出现明显下行。八月经济数据有所反弹,但力度不及预期,导致市场对于经济下滑担忧加剧,另一方面融资数据仍然保持强势,表内贷款特别是居民部门贷款增速持续超预期,社会融资总量也持续处于较高水平。经济数据和融资数据的背离使得市场对债券市场短期走势的分歧有所加剧,但对于中长期利率下行的看法却相对一致,这使得收益率的上行空间相对有限。货币政策方面,央行货币政策维持稳健中性,非银行金融机构融资压力较大,短端收益率持续处于高位,并制约长端收益率的下行空间。

报告期内,组合债券部分维持中短期偏短久期,保持适度的杠杆比例和组合流动性,继续优化信用债的资质结构。

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1.123元,本报告期份额净值增长率为0.63%;C类基金份额净值为1.109元,本报告期份额净值增长率为0.45%;同期业绩比较基准收益率为0.69%。

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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	3,355,622,188.00	96.65
3	货币资金	3,769,822,188.00	106.65
4	买入返售金融资产	-	-
5	银行存款	-	-
6	其他资产	-	-
7	其他负债	60,323,267.00	1.71
8	合计	3,394,344,000.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	1,000,000.00	0.03
2	食品饮料	1,000,000.00	0.03
3	其他行业	1,000,000.00	0.03
4	合计	3,000,000.00	0.09

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	001788.SZ	广汇能源	1,000,000	300,000,000.00	0.91
2	002648.SZ	华信新材	1,000,000	300,000,000.00	0.91
3	001771.SZ	广汇集团	1,000,000	300,000,000.00	0.91
4	001789.SZ	广汇能源	1,000,000	300,000,000.00	0.91
5	001788.SZ	广汇能源	1,000,000	300,000,000.00	0.91

5.4 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

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11171326	17广发银行CD126	30,000,000	300,000,000.00	0.91
2	11171327	17广发银行CD127	30,000,000	300,000,000.00	0.91
3	11171328	17广发银行CD128	30,000,000	300,000,000.00	0.91
4	11171329	17广发银行CD129	30,000,000	300,000,000.00	0.91
5	11171330	17广发银行CD130	30,000,000	300,000,000.00	0.91

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贵金属投资明细

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	999999	黄金	100	100	0.003
2	999999	白银	100	100	0.003
3	999999	铂金	100	100	0.003
4	999999	钯金	100	100	0.003
5	999999	铑金	100	100	0.003

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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003
2	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003
3	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003
4	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003
5	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-
2	股指期货	-	-	-
3	股指期货	-	-	-
4	股指期货	-	-	-
5	股指期货	-	-	-

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-	-
2	国债期货	-	-	-
3	国债期货	-	-	-
4	国债期货	-	-	-
5	国债期货	-	-	-

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.2 本基金投资的前十名资产支持证券

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11171326	17广发银行CD126	30,000,000	300,000,000.00	0.91
2	11171327	17广发银行CD127	30,000,000	300,000,000.00	0.91
3	11171328	17广发银行CD128	30,000,000	300,000,000.00	0.91
4	11171329	17广发银行CD129	30,000,000	300,000,000.00	0.91
5	11171330	17广发银行CD130	30,000,000	300,000,000.00	0.91

5.9.3 本基金投资的前十名权证

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003
2	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003
3	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003
4	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003
5	001788.SZ	广汇能源	100	100	0.003

5.9.4 其他资产构成

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收利息	11.23	0.0003
2	应收股利	-	-
3	应收申购款	-	-
4	其他应收款	-	-
5	其他	-	-
6	合计	11.23	0.0003

5.9.5 报告期末本基金持有的国债期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-	-
2	国债期货	-	-	-
3	国债期货	-	-	-
4	国债期货	-	-	-
5	国债期货	-	-	-

5.9.6 报告期末本基金持有的股指期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-
2	股指期货	-	-	-
3	股指期货	-	-	-
4	股指期货	-	-	-
5	股指期货	-	-	-

5.9.7 报告期末本基金持有的国债期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-	-
2	国债期货	-	-	-
3	国债期货	-	-	-
4	国债期货	-	-	-
5	国债期货	-	-	-

5.9.8 报告期末本基金持有的股指期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-
2	股指期货	-	-	-
3	股指期货	-	-	-
4	股指期货	-	-	-
5	股指期货	-	-	-

5.9.9 报告期末本基金持有的国债期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-	-
2	国债期货	-	-	-
3	国债期货	-	-	-
4	国债期货	-	-	-
5	国债期货	-	-	-

5.9.10 报告期末本基金持有的股指期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-
2	股指期货	-	-	-
3	股指期货	-	-	-
4	股指期货	-	-	-
5	股指期货	-	-	-

5.9.11 报告期末本基金持有的国债期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-	-
2	国债期货	-	-	-
3	国债期货	-	-	-
4	国债期货	-	-	-
5	国债期货	-	-	-

5.9.12 报告期末本基金持有的股指期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-
2	股指期货	-	-	-
3	股指期货	-	-	-
4	股指期货	-	-	-
5	股指期货	-	-	-

5.9.13 报告期末本基金持有的国债期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-	-
2	国债期货	-	-	-
3	国债期货	-	-	-
4	国债期货	-	-	-
5	国债期货	-	-	-

5.9.14 报告期末本基金持有的股指期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-
2	股指期货	-	-	-
3	股指期货	-	-	-
4	股指期货	-	-	-
5	股指期货	-	-	-

5.9.15 报告期末本基金持有的国债期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-	-
2	国债期货	-	-	-
3	国债期货	-	-	-
4	国债期货	-	-	-
5	国债期货	-	-	-

5.9.16 报告期末本基金持有的股指期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-
2	股指期货	-	-	-
3	股指期货	-	-	-
4	股指期货	-	-	-
5	股指期货	-	-	-

5.9.17 报告期末本基金持有的国债期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-	-
2	国债期货	-	-	-
3	国债期货	-	-	-
4	国债期货	-	-	-
5	国债期货	-	-	-

5.9.18 报告期末本基金持有的股指期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-
2	股指期货	-	-	-
3	股指期货	-	-	-
4	股指期货	-	-	-
5	股指期货	-	-	-

5.9.19 报告期末本基金持有的国债期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-	-
2	国债期货	-	-	-
3	国债期货	-	-	-
4	国债期货	-	-	-
5	国债期货	-	-	-

5.9.20 报告期末本基金持有的股指期货合约

序号	品种	持仓量(合约)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-
2	股指期货	-	-	-
3	股指期货	-	-	-
4	股指期货	-	-	-
5	股指期货	-	-	-