

易方达丰惠混合型证券投资基金

2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

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

送出日期：二〇一七年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 24 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	15
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
7.6 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	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	35
7.8 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贵金属投资明细	35
7.9 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	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	35

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	35
7.12	投资组合报告附注	36
8	基金份额持有人信息	36
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	36
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	37
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	37
9	开放式基金份额变动	37
10	重大事件揭示	37
10.1	基金份额持有人大会决议	37
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	37
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
10.4	基金投资策略的改变	38
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	38
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	38
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	38
10.8	其他重大事件	40
11	备查文件目录	41
11.1	备查文件目录	41
11.2	存放地点	41
11.3	查阅方式	41

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达丰惠混合型证券投资基金
基金简称	易方达丰惠混合
基金主代码	002602
交易代码	002602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 24 日
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
报告期末基金份额总额	431,043,500.03 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。本基金将结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，追求股票投资组合的长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	田青

负责人	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	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

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（2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日）
本期已实现收益	4,489,314.34
本期利润	4,603,673.90
加权平均基金份额本期利润	0.0100
本期加权平均净值利润率	1.00%
本期基金份额净值增长率	1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	4,203,893.06
期末可供分配基金份额利润	0.0098

期末基金资产净值	435,586,068.30
期末基金份额净值	1.011
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.10%

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.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4.本基金合同于 2017 年 3 月 24 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

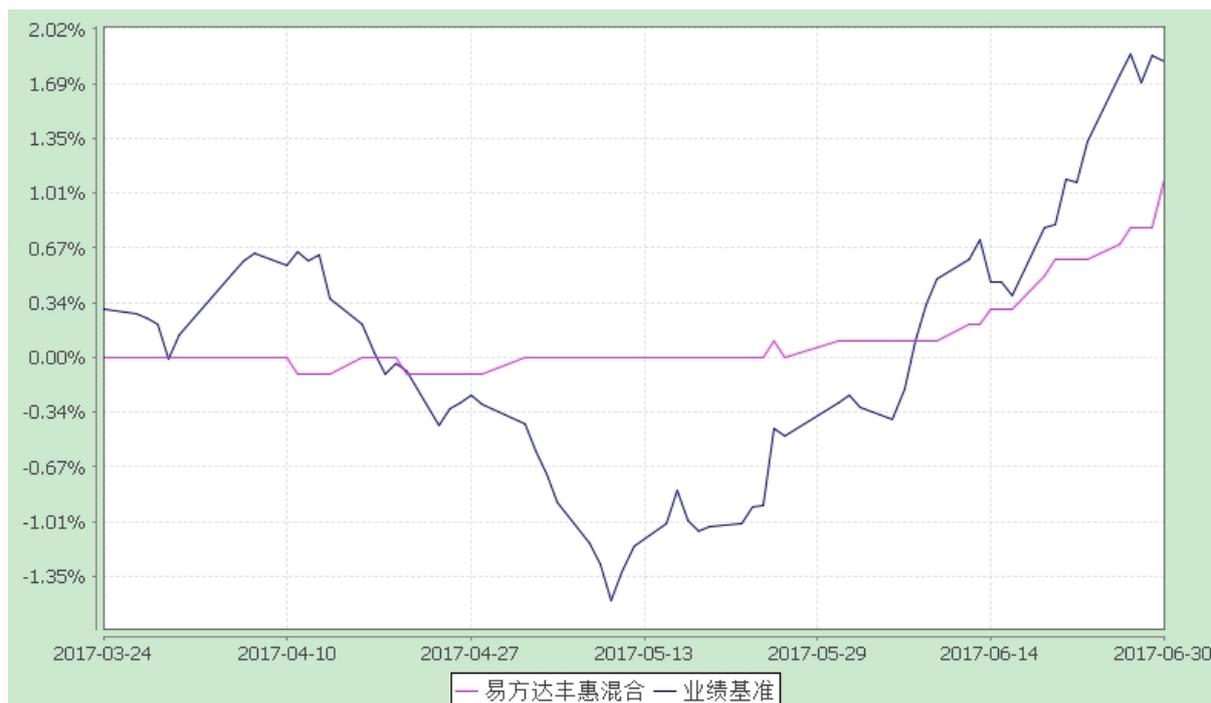
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.00%	0.08%	2.11%	0.18%	-1.11%	-0.10%
过去三个月	1.10%	0.06%	1.68%	0.18%	-0.58%	-0.12%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.10%	0.06%	1.82%	0.18%	-0.72%	-0.12%

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

易方达丰惠混合型证券投资基金

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

(2017年3月24日至2017年6月30日)



注：1.本基金合同于 2017 年 3 月 24 日生效，截至报告期末，本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（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。本报告期末本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 1.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.82%。

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，旗下设有北京、广州、上海、成都、大连等分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持在“诚信规范”的前提下，通过“专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004 年 10 月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005 年 8 月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007 年 12 月，易方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008 年 2 月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。2012 年 10 月，易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016 年 12 月，易方达获得基本养老保险基金证券投资管理机构资格。截至 2017 年 6 月 30 日，易方达的总资产管理规模达到 11000 亿元，其中公募基金管理规模 4842 亿元。

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		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
胡剑	本基金的基金经理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理、易方达睿智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益研究部总经理	2017-03-24	-	11 年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理。

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行业协会《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 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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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% 的交易共有 16 次，其中 14 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；2 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

从经济基本面的角度看，一季度我国经济走势平稳。其中 1-2 月工业增加值同比增长 6.3%，基本符合市场预期，不过发电量、钢铁、水泥产量相比于去年 12 月均有不同幅度的回升。一季度央行货币政策的态度进一步收紧，一方面是为了应对美联储加息带来的汇率贬值压力；另一方面也是为了抑制金融资产泡沫进一步膨胀。尤其是央行连续两次上调公开市场操作利率，使得市场机构对全年后续货币政策继续紧缩的担忧不断提升。

二季度我国宏观经济基本面走势仍然保持平稳态势。其中 4 月工业增加值同比增长 6.5%，月度环比与季度环比均明显下降；同时 4 月投资数据单月同比也出现下滑，民间投资走低的幅度更大一些。5 月的数据则呈现出不同迹象。一方面，5 月工业增加值同比增长 6.5%，略高于市场预期且环比明显回升。另一方面，当月房地产销售面积和销售金额均有所下滑，而投资增速则在一季度持续走强后连续两个月回落。此外，虽然 5 月信贷规模略超出预期，但社融规模略低于预期，且 M2 同比增速大幅低于市场预期。6 月工业增加值增速走高，投资需求也有所恢复，但制造业投资仍然没有明显复苏，房地产投资继续回落。

二级市场方面，进入 2017 年以来，债券收益率自去年四季度的高点持续回落，1 月中旬收益率达到阶段性低点后开始震荡上行。出于对 3 月资金面紧张的预期，收益率一度突破新高；但进入中下旬后长端收益率出现一定回落迹象。二季度债券市场波动性依然较大。4-5 月市场在经济仍然稳健的背景下，金融体系去杠杆预期加强以及银行间市场资金利率居高不下，带动收益率持续大幅上升，中短端上行幅度更大，收益率曲线异常平坦化。6 月资金面意外宽松，同时部分经济数据有放缓迹象，共同导致收益率大幅下行。6 月信用债的需求明显增加，当月信用利差整体呈现收窄趋势。

操作上，组合成立进入建仓期后我们不断增加债券配置。6 月我们判断债市配置价值上升，组合有效久期有所上调。考虑到近期股票市场波动性较大，目前权益仓位配置比例较低。

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 1.011 元，本报告期份额净值增长率为 1.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年中国经济增速边际上回落的可能性更大。首先，随着近年来基建投资在经济整体投资增长中的占比持续攀升，下半年存在一定的下滑风险。最近一段时间以来规范地方政府融资的相关政策频出，可能从实质上收紧地方政府的融资能力。在最近几年政府隐形债务规模增速较快的背景下，我们认为前期出台政策被严格执行的可能性较大。此外，上半年我国表内财政预算支出力度较大，下半年也存在一定压力。

其次，虽然上半年我国表内信贷规模增速总体平稳，但广义社融的季度环比增速持续回落，尤其是 M2 季度环比由去年 10 月的 15% 降至今年 6 月 5% 的水平，下滑趋势较为明显。我们认为在金融去杠杆政策的影响下，上半年融资规模的实际收缩程度可能在广义社融和 M2 口径之间，融资萎缩对实体经济的影响将在下半年逐渐体现。

中长期来看，企业部门高债务仍是当前中国经济的主要风险之一，短期内依靠债务堆积推动的经济回暖将加剧未来经济的下滑压力。在高债务问题解决前，经济上行的空间将受到抑制。过高的私人部门债务水平使得实体经济对利率非常敏感，企业难以承受持续过高的利率水平。

上半年债券市场收益率在波动中上升，其中 10 年期国开债收益率回到历史 60% 分位数左右的水平。基于上述分析，我们认为下半年中国经济增速面临一定压力，在通胀平稳的背景下，我们认为目前债券收益率已经进入配置区间，组合整体将保持中性的久期与配置比例水平，根据市场情况灵活调整。当然，我们也观察到近期微观经济基本面依然平稳，且地产投资在三季度存在向上的可能，短期内债券市场收益率显著下行的动力也比较有限。股票市场波动性较大，未来趋势性行情出现的机会可能还需要持续观察。

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，公司常务副总裁担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、投资风险管理部、监察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，具备行业研究、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，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：易方达丰惠混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	1,017,838.45
结算备付金		417,026.59
存出保证金		6,797.40
交易性金融资产	6.4.7.2	438,519,774.00
其中：股票投资		2,894,974.00
基金投资		-
债券投资		435,624,800.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,000,000.00
应收证券清算款		501,760.55
应收利息	6.4.7.5	6,468,757.80
应收股利		-
应收申购款		22,384.42
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		449,954,339.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		12,999,860.50
应付证券清算款		-
应付赎回款		861,802.58
应付管理人报酬		290,223.63
应付托管费		90,694.88
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	17,500.75

应交税费		-
应付利息		4,600.89
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	103,587.68
负债合计		14,368,270.91
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	431,043,500.03
未分配利润	6.4.7.10	4,542,568.27
所有者权益合计		435,586,068.30
负债和所有者权益总计		449,954,339.21

注：1.本基金合同生效日为 2017 年 3 月 24 日，2017 年半年度实际报告期间为 2017 年 3 月 24 日至 2017 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.011 元，基金份额总额 431,043,500.03 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达丰惠混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 3 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		6,070,768.19
1.利息收入		6,864,301.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,209,445.21
债券利息收入		3,918,912.88
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		735,943.58
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,094,660.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-847,710.14
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-246,950.00
股利收益	6.4.7.15	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	114,359.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	186,767.10
减：二、费用		1,467,094.29
1. 管理人报酬		989,488.41
2. 托管费		309,215.16
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	13,409.14
5. 利息支出		47,262.19
其中：卖出回购金融资产支出		47,262.19
6. 其他费用	6.4.7.19	107,719.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,603,673.90
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,603,673.90

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 24 日，2017 年半年度实际报告期间为 2017 年 3 月 24 日至 2017 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达丰惠混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 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）	480,008,347.68	-	480,008,347.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,603,673.90	4,603,673.90
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）	-48,964,847.65	-61,105.63	-49,025,953.28
其中：1.基金申购款	1,722,371.89	3,393.72	1,725,765.61
2.基金赎回款	-50,687,219.54	-64,499.35	-50,751,718.89
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	431,043,500.03	4,542,568.27	435,586,068.30

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 24 日，2017 年半年度实际报告期间为 2017 年 3 月 24

日至 2017 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：张优造，会计机构负责人：陈荣

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达丰惠混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]625 号《关于准予易方达丰惠混合型证券投资基金注册的批复》和证券投资基金机构监管部函[2016]3039 号《关于易方达丰惠混合型证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集，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《易方达丰惠混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达丰惠混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 480,008,347.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 52,526.55 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2017 年 3 月 2 日至 2017 年 3 月 22 日，募集金额总额为人民币 480,008,347.68 元，其中：有效净认购金额为人民币 479,955,821.13 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 52,526.55 元，经安永华明 (2017) 验字第 60468000_G06 号验资报告予以审验。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达丰惠混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2017 年 3 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在

申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活

跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操

作，主要税项列示如下：

(1)于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,017,838.45
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计	1,017,838.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,993,278.85	2,894,974.00	-98,304.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	142,939,294.02	143,586,800.00	647,505.98
	银行间市场	292,472,841.57	292,038,000.00	-434,841.57
	合计	435,412,135.59	435,624,800.00	212,664.41
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		438,405,414.44	438,519,774.00	114,359.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	828.19
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,525.72
应收债券利息	6,467,574.80
应收买入返售证券利息	-1,173.70
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.79
合计	6,468,757.80

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,656.49
银行间市场应付交易费用	14,844.26
合计	17,500.75

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,888.74
预提费用	99,698.94
合计	103,587.68

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	480,008,347.68	480,008,347.68
本期申购	1,722,371.89	1,722,371.89
本期赎回（以“-”号填列）	-50,687,219.54	-50,687,219.54
本期末	431,043,500.03	431,043,500.03

注：1.本基金合同于 2017 年 3 月 24 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 480,008,347.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 52,526.55 份基金份额。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,489,314.34	114,359.56	4,603,673.90
本期基金份额交易产生的变动数	-285,421.28	224,315.65	-61,105.63
其中：基金申购款	11,758.31	-8,364.59	3,393.72
基金赎回款	-297,179.59	232,680.24	-64,499.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,203,893.06	338,675.21	4,542,568.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	45,426.99
定期存款利息收入	2,148,472.22
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	15,525.29
其他	20.71
合计	2,209,445.21

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	71,721,005.82
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	67,590,501.44
减：应收利息总额	4,978,214.52
买卖债券差价收入	-847,710.14

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日
国债期货投资收益	-246,950.00

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日
1.交易性金融资产	114,359.56
——股票投资	-98,304.85
——债券投资	212,664.41
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	114,359.56

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日
基金赎回费收入	186,751.36
其他	15.74
合计	186,767.10

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日
交易所市场交易费用	4,351.54
银行间市场交易费用	8,100.00
国债期货交易费用	957.60
合计	13,409.14

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日
审计费用	20,988.99
信息披露费	78,709.95
银行汇划费	7,620.45
其他	400.00
合计	107,719.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	989,488.41
其中：支付销售机构的客户维护费	477,806.94

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	309,215.16

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年3月24日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	1,017,838.45	45,426.99

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 12,999,860.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
170401	17 农发 01	2017-07-05	99.62	130,000	12,950,600.00
合计				130,000	12,950,600.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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为 0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度、对交易对手（包括存款银行）、证券发行人的信用评级进行跟踪，和分散化投资方式防范信用风险。于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 78.27%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日
A-1	20,389,151.78
A-1 以下	0.00
未评级	120,837,917.81
合计	141,227,069.59

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日
AAA	40,628,592.87
AAA 以下	189,412,838.37
未评级	70,823,873.97
合计	300,865,305.21

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、期权、债券(包括国债、央行票据、金融债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可转换债券、证券公司短期公司债、资产支持证券等)、银行存款、债券回购、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,017,838.45	-	-	-	1,017,838.45
结算备付金	417,026.59	-	-	-	417,026.59
存出保证金	6,797.40	-	-	-	6,797.40
交易性金融资产	193,473,000.00	151,223,800.00	90,928,000.00	2,894,974.00	438,519,774.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00

产					
应收证券清算款	-	-	-	501,760.55	501,760.55
应收利息	-	-	-	6,468,757.80	6,468,757.80
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	22,384.42	22,384.42
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	197,914,662.44	151,223,800.00	90,928,000.00	9,887,876.77	449,954,339.21
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	12,999,860.50	-	-	-	12,999,860.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	861,802.58	861,802.58
应付管理人报酬	-	-	-	290,223.63	290,223.63
应付托管费	-	-	-	90,694.88	90,694.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	17,500.75	17,500.75
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	4,600.89	4,600.89
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	103,587.68	103,587.68
负债总计	12,999,860.50	-	-	1,368,410.41	14,368,270.91
利率敏感度缺口	184,914,801.94	151,223,800.00	90,928,000.00	8,519,466.36	435,586,068.30

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2017年6月30日
	1.市场利率下降25个基	2,572,162.35

点	
2.市场利率上升 25 个基点	-2,531,343.69

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,894,974.00	0.66
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	2,894,974.00	0.66

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2017 年 6 月 30 日
	1.业绩比较基准上升 5%	200,057.22
	2.业绩比较基准下降 5%	-200,057.22

注：股票投资业绩基准取上证 A 指。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具**(i) 各层次金融工具公允价值**

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,894,974.00 元，属于第二层次的余额为 435,624,800.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以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。

(2) 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。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,894,974.00	0.64
	其中：股票	2,894,974.00	0.64
2	固定收益投资	435,624,800.00	96.82
	其中：债券	435,624,800.00	96.82
	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	3,000,000.00	0.67
	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	1,434,865.04	0.32
7	其他各项资产	6,999,700.17	1.56
8	合计	449,954,339.21	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	-	-
C	制造业	1,921,444.00	0.44
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	973,530.00	0.22
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	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	2,894,974.00	0.66

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净 值比例(%)
1	300068	南都电源	114,100	1,921,444.00	0.44
2	600029	南方航空	111,900	973,530.00	0.22

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资 产净值比例 (%)
1	300068	南都电源	1,994,011.85	0.46
2	600029	南方航空	999,267.00	0.23

注：买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票卖出交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,993,278.85
卖出股票收入(成交)总额	-

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比 例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,886,000.00	6.86
	其中：政策性金融债	29,886,000.00	6.86

4	企业债券	166,239,800.00	38.16
5	企业短期融资券	110,152,000.00	25.29
6	中期票据	58,801,000.00	13.50
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	70,546,000.00	16.20
10	合计	435,624,800.00	100.01

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	140924	17 四川 20	300,000	30,654,000.00	7.04
2	011754102	17 川投能源 SCP001	300,000	30,018,000.00	6.89
3	170401	17 农发 01	300,000	29,886,000.00	6.86
4	124638	PR 信阳债	300,000	25,218,000.00	5.79
5	1480570	14 融国投债	200,000	20,382,000.00	4.68

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的利率风险、有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					-246,950.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货根据风险管理的原则，以套期保值及套利策略为目的，主要关注国债期货与债券现货之间的价差以及不同那期货品种之间的价差交易机会,并没有增加组合的整体久期风险暴露。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,797.40
2	应收证券清算款	501,760.55
3	应收股利	-
4	应收利息	6,468,757.80
5	应收申购款	22,384.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,999,700.17

7.12.4 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。

7.12.5 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。

8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
4,772	90,327.64	198,416.70	0.05%	430,845,083.33	99.95%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,830.00	0.0007%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）基金份额总额	480,008,347.68
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,722,371.89
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	50,687,219.54
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	431,043,500.03

注：本基金合同生效日为 2017 年 03 月 24 日。

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2017 年 3 月 10 日发布公告，自 2017 年 3 月 10 日起聘任关秀霞女士担任公司首席国际业务官（副总经理级）；于 2017 年 4 月 19 日发布公告，自 2017 年 4 月 19 日起聘任高松凡先生担任公司首席养老金业务官（副总经理级）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	1,994,011.85	66.62%	1,857.08	69.91%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	999,267.00	33.38%	799.41	30.09%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、华西证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、天风证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司各一个交易单元；新增安信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司各两个交易单元；新增广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司各三个交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	284,325.00	0.25%	-	-	-	-
国信证券	-	-	33,500,000.00	2.75%	-	-

天风证券	-	-	7,000,000.00	0.57%	-	-
安信证券	114,051,417.68	99.75%	1,179,000,000.00	96.68%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达丰惠混合型证券投资基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-25
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加济安财富费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-27
3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-30
4	易方达基金管理有限公司关于增加中国农业银行为易方达丰惠混合型证券投资基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-03-31
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加泛华普益费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-05
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞安农商银行为销售机构、参加瑞安农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-13
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-04-19
8	易方达基金管理有限公司关于易方达丰惠混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-03
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中证金牛费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-05
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加川财证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-05-15
11	关于易方达基金管理有限公司上海直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2017-06-23

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达丰惠混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达丰惠混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达丰惠混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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

二〇一七年八月二十九日