

易方达安源中短债债券型证券投资基金
(原易方达双月利理财债券型证券投资基金转型)

2019年第2季度报告

2019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

报告送出日期：二〇一九年七月十九日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2019年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

自2019年5月28日起原易方达双月利理财债券型证券投资基金转型为易方达安源中短债债券型证券投资基金。原易方达双月利理财债券型证券投资基金本报告期自2019年4月1日至2019年5月27日止，易方达安源中短债债券型证券投资基金本报告期自2019年5月28日至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

基金简称	易方达安源中短债债券
基金主代码	110052
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年5月28日
报告期末基金份额总额	141,152,669.65份
投资目标	本基金主要投资中短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资中短期债券，在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。久期策略方面，基金管理人将在深入研究国内外的宏

	<p>观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，预测未来收益率曲线变动趋势，积极调整本基金的组合久期。期限结构配置方面，本基金对债券市场收益率期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，预测收益率期限结构的变化方式，确定期限结构配置策略以及各期限固定收益品种的配置比例，以达到预期投资收益最大化的目的。类属配置方面，本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、短期融资券、中期票据等投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。个券策略方面，本基金对于信用类固定收益品种的投资，将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。</p>	
业绩比较基准	中债综合财富（1-3年）指数收益率	
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理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	易方达安源中短债债券 A	易方达安源中短债债券 C
下属分级基金的交易代码	110053	110052
报告期末下属分级基金的份额总额	50,862,656.94 份	90,290,012.71 份

注：本基金A类基金份额由原易方达双月利理财债券型证券投资基金B类基金份额转型而来，C类基金份额由原易方达双月利理财债券型证券投资基金A类基金份额转型而来。

2.2 易方达双月利理财债券型证券投资基金

基金简称	易方达双月利理财债券
------	------------

基金主代码	110052	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月15日	
报告期末基金份额总额	141,979,654.63份	
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性的基础上，追求基金资产的稳定增值。	
投资策略	本基金通过分析影响债券市场和货币市场的各类要素，对固定收益产品的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置。具体来看，本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作。在充分考虑组合流动性管理需要的前提下，配置协议存款。对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。	
业绩比较基准	基金托管人公布的七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	易方达双月利理财债券 A	易方达双月利理财债券 B
下属分级基金的交易代码	110052	110053
报告期末下属分级基金的份额总额	96,787,364.06份	45,192,290.57份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019年5月28日(基金合同生效日)-2019年6月30日)	
	易方达安源中短债债券 A	易方达安源中短债债券 C
1.本期已实现收益	166,027.38	292,984.99
2.本期利润	153,021.83	237,888.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0032	0.0026
4.期末基金资产净值	51,016,820.18	90,538,289.71
5.期末基金份额净值	1.0030	1.0027

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.自2019年5月28日起原易方达双月利理财债券型证券投资基金转型为易方达安源中短债债券型证券投资基金,易方达安源中短债债券型证券投资基金合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.1.2 易方达双月利理财债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日-2019年5月27日)	
	易方达双月利理财债券 A	易方达双月利理财债券 B
1.本期已实现收益	462,390.46	983,131.40
2.本期利润	462,390.46	983,131.40

3.期末基金资产净值	96,787,364.06	45,192,290.57
------------	---------------	---------------

注：1.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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按运作期结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

（报告期：2019年5月28日-2019年6月30日）

3.2.1.1 本报告期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

易方达安源中短债债券 A

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	0.30%	0.05%	0.44%	0.02%	-0.14%	0.03%

易方达安源中短债债券 C

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	0.27%	0.05%	0.44%	0.02%	-0.17%	0.03%

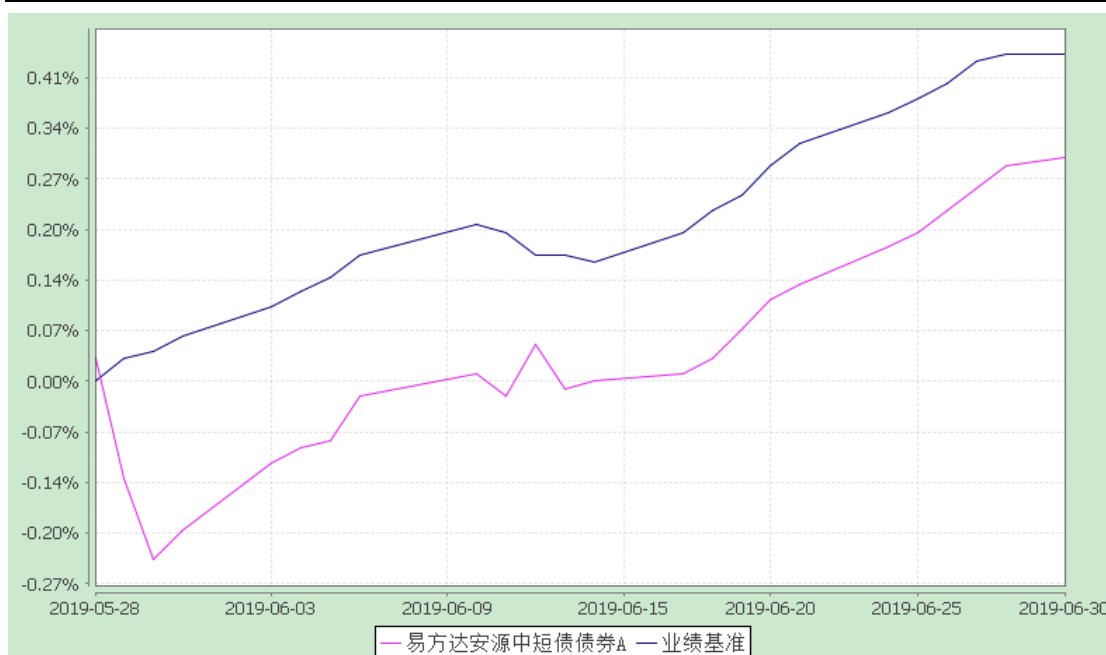
3.2.1.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达安源中短债债券型证券投资基金

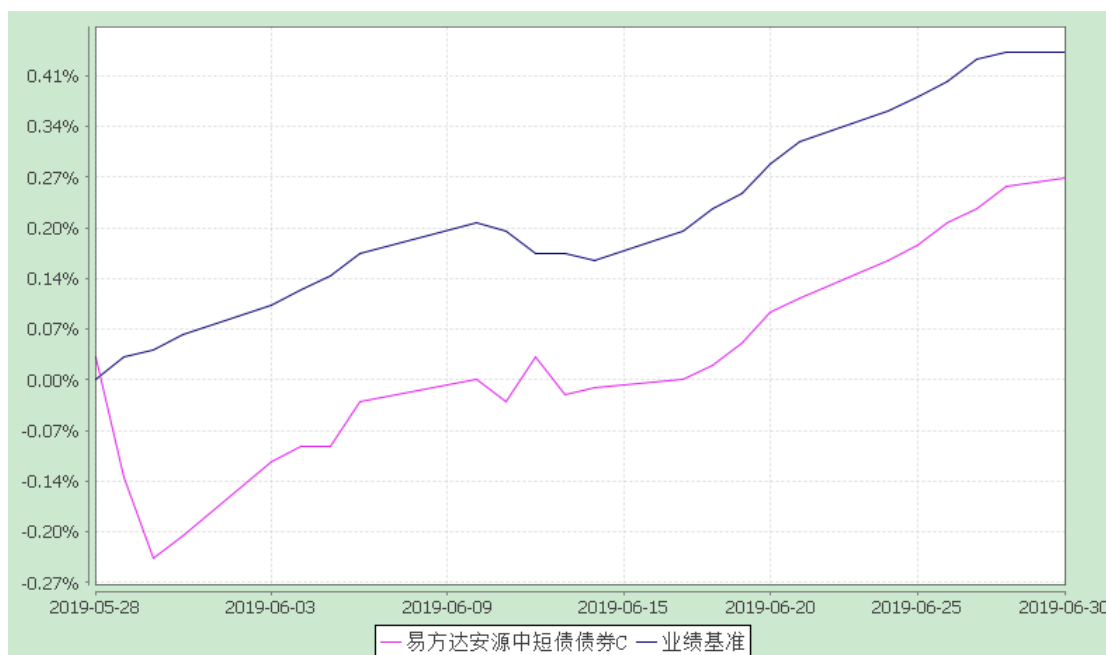
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019年5月28日至2019年6月30日)

易方达安源中短债债券 A



易方达安源中短债债券 C



注:1.本基金由原易方达双月利理财债券型证券投资基金于2019年5月28日转型而来,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(第十一部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.自基金转型至报告期末,A类基金份额净值增长率为0.30%,C类基金份额净值增长率为0.27%,同期业绩比较基准收益率为0.44%。

3.2.2 易方达双月利理财债券型证券投资基金

(报告期: 2019年4月1日-2019年5月27日)

3.2.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达双月利理财债券 A

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 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
过去三个月	0.3995%	0.0083%	0.2138%	0.0000%	0.1857%	0.0083%

易方达双月利理财债券 B

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 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
过去三个月	0.4451%	0.0083%	0.2138%	0.0000%	0.2313%	0.0083%

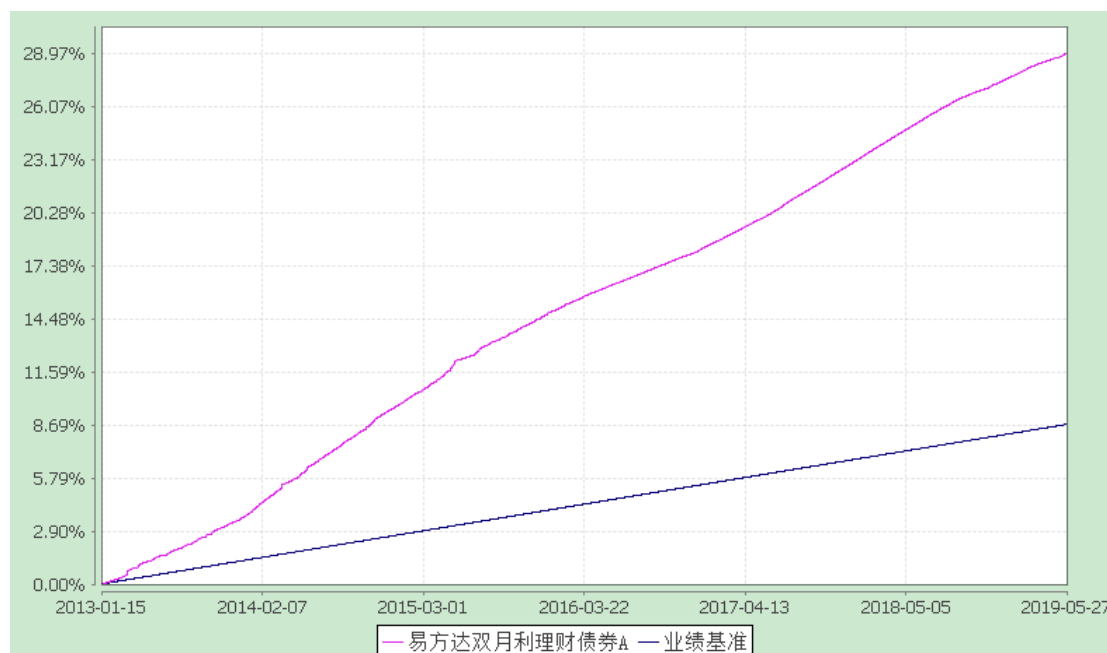
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达双月利理财债券型证券投资基金

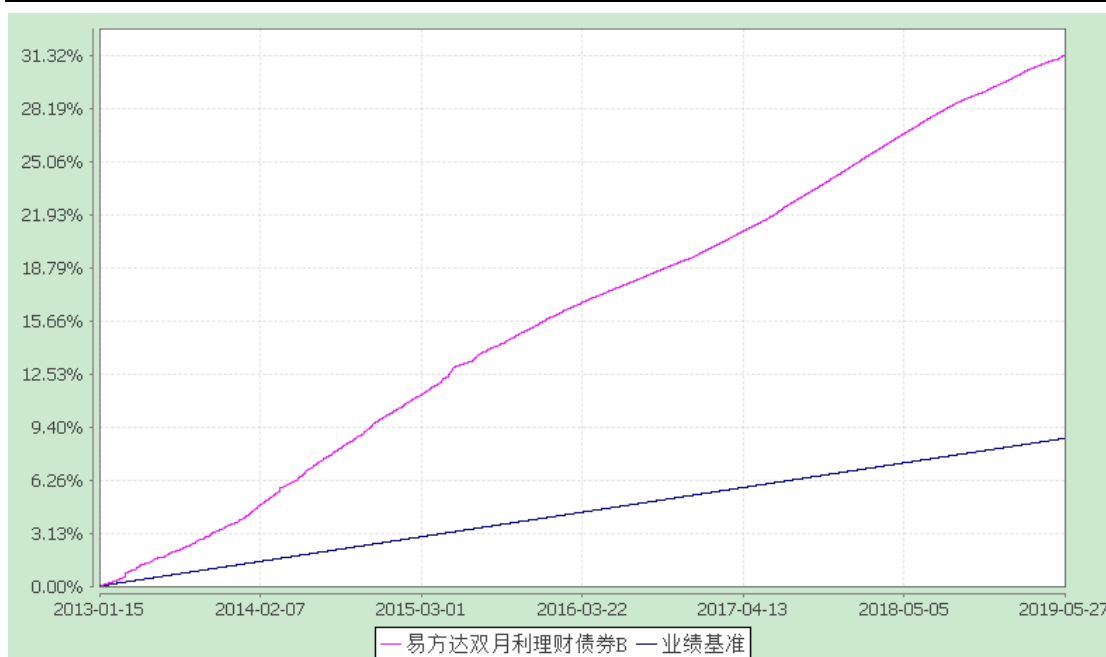
累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年1月15日至2019年5月27日)

易方达双月利理财债券 A



易方达双月利理财债券 B



注：自基金合同生效至2019年5月27日，A类基金份额净值收益率为28.9713%，B类基金份额净值收益率为31.3273%，同期业绩比较基准收益率为8.7150%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石大恽	本基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达天天发货币市场基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达财富快线货币市	2013-01-15	2019-05-28	10年	硕士研究生，曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。

	场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自2016年06月02日至2019年06月27日）				
梁莹	本基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理、易方达货币市场基金的基金经理助理	2014-09-24	2019-05-28	9年	硕士研究生，曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员，易方达基金管理有限公司固定收益交易员、易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理。
李一硕	本基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达聚盈分级债券型发起式	2019-05-28	-	11年	硕士研究生，曾任瑞银证券有限公司研究员，中国国际金融有限公司研究员，易方达基金管理有限公司研究员、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

	证券投资基金的基金经理、易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒惠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、易方达纯债1年定期开放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助理、易方达丰惠混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祺灵活配置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式混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)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 (自2018年03月01日至2019年06月27日)、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(自2018年03月01日至2019年06月27日)、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理(自2018年03月01日至2019年06月27日)				
--	--	--	--	--	--

注：1. 此处石大恽的“任职日期”为原易方达双月利理财债券型证券投资基金合同生效之日，梁莹的“任职日期”为原易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理变更公告确定的聘任之日，李一硕的“任职日期”为易方达安源中短债债券型证券投资基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从《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合规守信情况的说明

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 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28次，其中27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 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

二季度宏观经济的下行压力相对一季度有所加大。5月工业增加值同比增长5.0%，较4月份的5.4%进一步走低。固定资产投资方面，5月增速单月同比也由此前的5.7%降至4.4%，季调后连续两个月下滑，其回落速度有所加快。具体分项来看，制造业投资在今年以来连续4个月持续回落后虽略有反弹，但尚未扭转弱势。在目前中美贸易纠纷尚未完全解决以及工业企业利润疲弱的背景下，制造业投资仍承受压力。二季度基建投资同样维持在相对偏低水平，对冲经济回落的效果并不显著，主要是由于地方政府债务水平仍然面临较为严格的约束。虽然保持基建投资增速稳定的政策导向仍然延续，例如明确“允许将专项债券作为符合条件的重大项目资本金”，但对基建投资的实际拉动效果或许比较有限。房地产投资是今年经济

增速平稳的重要支撑，但5月份同比增速数据降低至9.5%，在经历了1-4月的高速增长阶段后有所回落。此外，5月商品房销售面积单月同比增速明显放缓至-5.5%，较此前数据也出现了明显的下滑。融资方面，二季度表内信贷和社融数据低于预期，其中企业中长期贷款相对偏弱，反映实体融资需求可能仍然不足。

在上述经济增速回落的情况下，央行保持了相对较为宽松的货币政策，同时强调降低风险溢价，债券市场整体面临较好的投资环境。虽然3月份较为正面的经济数据带动债市收益率在4月一度走高，但随后呈现下行态势。值得注意的是，受质押回购难度增大的影响，6月份以来中低评级信用债收益率走高，评级利差开始出现扩大。

二季度，本基金由短期理财基金转型为中短债基金。操作上，转型之前，作为类货币产品，产品的资产配置以同业存单、同业存款、短期逆回购为主，组合保持了较好的流动性和稳定的收益。转型为中短债基金之后，配置结构发生了变化。考虑到目前中短端收益率曲线形态较为陡峭，我们主要增加了1-3年期高评级信用债品种的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019年6月30日，易方达安源中短债债券型证券投资基金A类基金份额净值为1.0030元，本报告期(2019年5月28日—2019年6月30日)份额净值增长率为0.30%；C类基金份额净值为1.0027元，本报告期(2019年5月28日—2019年6月30日)份额净值增长率为0.27%；同期业绩比较基准收益率为0.44%。

原易方达双月利理财债券型证券投资基金本报告期内(2019年4月1日—2019年5月27日)A类基金份额净值收益率为0.3995%；B类基金份额净值收益率为0.4451%；同期业绩比较基准收益率为0.2138%。

§5 投资组合报告

5.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

(报告期：2019年5月28日-2019年6月30日)

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-

2	固定收益投资	132,704,200.00	93.53
	其中：债券	132,704,200.00	93.53
	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	-	-
	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	6,234,329.80	4.39
7	其他资产	2,938,910.76	2.07
8	合计	141,877,440.56	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.1.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,884,000.00	28.18
	其中：政策性金融债	39,884,000.00	28.18
4	企业债券	80,663,000.00	56.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	12,157,200.00	8.59
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	132,704,200.00	93.75

5.1.5 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

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	190202	19 国开 02	300,000	29,901,000.00	21.12
2	101473013	14 中航航电 MTN001	120,000	12,157,200.00	8.59
3	112672	18 深建 01	100,000	10,302,000.00	7.28
4	143273	17 两江 01	100,000	10,143,000.00	7.17
5	122486	15 旭辉 01	100,000	10,108,000.00	7.14

5.1.6 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持有资产支持证券。

5.1.7 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。

5.1.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,256.70
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	1,968,436.05
5	应收申购款	964,218.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,938,910.76

5.1.11.4 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。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.2 易方达双月利理财债券型证券投资基金

(报告期：2019年4月1日-2019年5月27日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	10,002,864.73	7.01
	其中：债券	10,002,864.73	7.01
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	55,460,147.73	38.85
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	36,651,348.74	25.68
4	其他资产	40,635,407.36	28.47
5	合计	142,749,768.56	100.00

5.2.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.70

	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金合同约定“本基金在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”，本报告期内本基金未发生超标情况。

5.2.3 基金投资组合平均剩余期限

5.2.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	13
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	128
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	13

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金合同约定“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天”，本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

5.2.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产 净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产 净值的比例 (%)
1	30 天以内	92.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天 的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天	-	-

	的浮动利率债		
5	120天(含)—397天(含)	7.05	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.00	-

5.2.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金属于理财债券型基金, 不适用本项目。

5.2.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,002,864.73	7.05
	其中: 政策性金融债	10,002,864.73	7.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	10,002,864.73	7.05
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.2.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180410	18农发10	100,000	10,002,864.73	7.05

5.2.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次

报告期内偏离度的最高值	0.0920%
报告期内偏离度的最低值	0.0008%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0504%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25% 的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5% 的情况。

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的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。

5.2.9 投资组合报告附注

5.2.9.1 基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

(1) 基金持有的债券（包括票据）购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入，每日计提收益；

(2) 基金持有的回购以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；

(3) 基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

5.2.9.2 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。

5.2.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	39,863,071.62
3	应收利息	772,335.74
4	应收申购款	-

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	40,635,407.36

§6 开放式基金份额变动

6.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

单位：份

项目	易方达安源中短债债券 A	易方达安源中短债债券 C
基金合同生效日基金份额总额	45,192,290.57	96,787,364.06
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,898,756.16	7,285,072.57
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	228,389.79	13,782,423.92
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	50,862,656.94	90,290,012.71

注：本基金A类基金份额由原易方达双月利理财债券型证券投资基金B类基金份额转型而来，C类基金份额由原易方达双月利理财债券型证券投资基金A类基金份额转型而来，基金合同于2019年5月28日起生效，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

6.2 易方达双月利理财债券型证券投资基金

单位：份

项目	易方达双月利理财债券 A	易方达双月利理财债券 B
本报告期期初基金份额总额	149,673,529.93	375,111,923.03
报告期基金总申购份额	451,809.43	1,080,013.66
减：报告期基金总赎回份额	53,337,975.30	330,999,646.12

本报告期末基金份额总额	96,787,364.06	45,192,290.57
-------------	---------------	---------------

注：自 2019 年 5 月 28 日起原易方达双月利理财债券型证券投资基金转型为易方达安源中短债债券型证券投资基金，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 易方达安源中短债债券型证券投资基金

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

7.2 易方达双月利理财债券型证券投资基金

7.2.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达双月利理财债券型证券投资基金变更注册为易方达安源中短债债券型证券投资基金的文件；

2.《易方达双月利理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》；

3.《易方达安源中短债债券型证券投资基金基金合同》；

4.《易方达安源中短债债券型证券投资基金托管协议》；

5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

6.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 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。

8.3 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

二〇一九年七月十九日