

**易方达丰华债券型证券投资基金**  
**(原易方达保本一号混合型证券投资基金转型)**  
**2019年半年度报告**  
**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：招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。

基金托管人招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。

本报告中财务资料未经审计。

自2019年2月19日起原易方达保本一号混合型证券投资基金转型为易方达丰华债券型证券投资基金。原易方达保本一号混合型证券投资基金本报告期自2019年1月1日至2019年2月18日止，易方达丰华债券型证券投资基金本报告期自2019年2月19日至2019年6月30日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>2 基金简介</b> .....	6
2.1 基金基本情况 .....	6
2.1.1 易方达丰华债券型证券投资基金 .....	6
2.1.2 易方达保本一号混合型证券投资基金 .....	6
2.2 基金产品说明 .....	6
2.2.1 易方达丰华债券型证券投资基金 .....	6
2.2.2 易方达保本一号混合型证券投资基金 .....	7
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	7
2.4 信息披露方式 .....	8
2.5 其他相关资料 .....	8
2.5.1 易方达丰华债券型证券投资基金 .....	8
2.5.2 易方达保本一号混合型证券投资基金 .....	8
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	8
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2 基金净值表现 .....	9
<b>4 管理人报告</b> .....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	13
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验 .....	13
4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介 .....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	18
4.3.1 公平交易制度的执行情况 .....	18
4.3.2 异常交易行为的专项说明 .....	18
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	18
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析 .....	18
4.4.2 报告期内基金的业绩表现 .....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	19
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	20
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	20
<b>5 托管人报告</b> .....	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	20
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 .....	21
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 .....	21
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	21
6.1 易方达丰华债券型证券投资基金 .....	21
6.1.1 资产负债表 .....	21
6.1.2 利润表 .....	23
6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	24
6.1.4 报表附注 .....	25
6.2 易方达保本一号混合型证券投资基金 .....	48
6.2.1 资产负债表 .....	48

6.2.2	利润表.....	49
6.2.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	50
6.2.4	报表附注.....	51
7	<b>投资组合报告</b> .....	68
7.1	易方达丰华债券型证券投资基金.....	68
7.1.1	期末基金资产组合情况.....	68
7.1.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	69
7.1.3	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.....	69
7.1.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
7.1.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
7.1.6	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.....	71
7.1.7	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.....	72
7.1.8	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贵金属投资明细.....	72
7.1.9	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.....	72
7.1.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
7.1.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.1.12	投资组合报告附注.....	72
7.2	易方达保本一号混合型证券投资基金.....	73
7.2.1	期末基金资产组合情况.....	73
7.2.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	73
7.2.3	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.....	74
7.2.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	74
7.2.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
7.2.6	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.....	74
7.2.7	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.....	74
7.2.8	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.....	74
7.2.9	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.....	74
7.2.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	74
7.2.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
7.2.12	投资组合报告附注.....	74
8	<b>基金份额持有人信息</b> .....	75
8.1	易方达丰华债券型证券投资基金.....	75
8.1.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	75
8.1.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
8.1.3	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.....	76
8.2	易方达保本一号混合型证券投资基金.....	76
8.2.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
8.2.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	76
8.2.3	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.....	77
9	<b>开放式基金份额变动</b> .....	77
9.1	易方达丰华债券型证券投资基金.....	77
9.2	易方达保本一号混合型证券投资基金.....	77
10	<b>重大事件揭示</b> .....	78
10.1	基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
10.4 基金投资策略的改变 .....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	79
10.7.1 易方达丰华债券型证券投资基金 .....	79
10.7.2 易方达保本一号混合型证券投资基金 .....	80
10.8 其他重大事件 .....	81
<b>11 备查文件目录</b> .....	<b>83</b>
11.1 备查文件目录 .....	83
11.2 存放地点 .....	84
11.3 查阅方式 .....	84

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 易方达丰华债券型证券投资基金

基金名称	易方达丰华债券型证券投资基金	
基金简称	易方达丰华债券	
基金主代码	000189	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年2月19日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	441,482,239.34份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达丰华债券 A	易方达丰华债券 C
下属分级基金的交易代码	000189	006867
报告期末下属分级基金的份额总额	187,168,251.08 份	254,313,988.26 份

注：本基金 A 类份额由原易方达保本一号混合型证券投资基金转型而来，并增设 C 类份额类别，基金合同于 2019 年 2 月 19 日起生效，C 类份额首次确认日为 2019 年 2 月 20 日。

#### 2.1.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

基金名称	易方达保本一号混合型证券投资基金	
基金简称	易方达保本一号混合	
基金主代码	000189	
交易代码	000189	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年1月13日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	161,291,666.12份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 易方达丰华债券型证券投资基金

投资目标	本基金在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
------	-------------------------------

投资策略	本基金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，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×10%+中债总指数收益率×90%
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。

### 2.2.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

投资目标	本基金通过运用投资组合保险技术控制本金损失的风险，并力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金采用投资组合保险策略，借鉴恒定比例组合保险（CPPI）策略的原理在安全资产与风险资产之间进行动态配置，以确保基金在保本周期到期时，力争实现基金资产在保本基础上增值的目的。债券投资方面，通过分析宏观经济运行趋势及货币财政政策变化，预测未来市场利率趋势及市场信用环境变化，综合考虑各类风险因素，构造债券投资组合；股票投资方面，主要采取“自下而上”的投资策略，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，精选高成长、低估值、盈利稳定提升的上市公司，构建股票投资组合，并持续优化调整，控制风险，保证股票组合的稳定性和收益性。
业绩比较基准	中国人民银行公布的三年期银行整存整取定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，理论上其风险收益水平低于股票型基金。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南
	联系电话	020-85102688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn
客户服务电话	400 881 8088	95555
传真	020-85104666	0755-83195201

注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891(集中办公区)	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	510620	518040
法定代表人	刘晓艳	李建红

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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

### 2.5.1 易方达丰华债券型证券投资基金

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

### 2.5.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

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
基金保证人	北京首创融资担保有限公司	北京市西城区闹市口大街1号院长安兴融中心4号楼3层03B-03G

## 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2月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日)		报告期(2019年1月1日至2019年2月18日)
	易方达丰华债券A	易方达丰华债券C	
本期已实现收益	673,940.52	375,031.24	-289,612.24
本期利润	626,449.93	-3,008,924.57	2,268,133.93
加权平均基金份额本期利	0.0036	-0.0148	0.0017



润			
本期加权平均净值利润率	0.35%	-1.48%	0.17%
本期基金份额净值增长率	0.75%	0.60%	0.19%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2019年6月30日)</b>		<b>报告期末(2019年2月18日)</b>
	易方达丰华债券 A	易方达丰华债券 C	
期末可供分配利润	6,803,922.41	684,099.96	5,224,777.63
期末可供分配基金份额利润	0.0364	0.0027	0.0324
期末基金资产净值	188,564,648.40	255,870,823.60	161,291,666.96
期末基金份额净值	1.0075	1.0061	1.000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2019年6月30日)</b>		<b>报告期末(2019年2月18日)</b>
	易方达丰华债券 A	易方达丰华债券 C	
基金份额累计净值增长率	0.75%	0.60%	9.47%

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.原易方达保本一号混合型证券投资基金已于2019年2月18日进行了基金份额折算，折算比例为1.033927978，折算后基金份额净值为1.000人民币元。

5.自2019年2月19日起原易方达保本一号混合型证券投资基金转型为易方达丰华债券型证券投资基金，易方达丰华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。

6.自2019年2月19日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2019年2月20日，增设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 易方达丰华债券型证券投资基金

##### 3.2.1.1 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

易方达丰华债券 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	1.43%	0.23%	0.96%	0.10%	0.47%	0.13%
过去三个月	-0.06%	0.33%	-0.60%	0.14%	0.54%	0.19%
过去六个月	-	-	-	-	-	-

过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.75%	0.29%	0.51%	0.15%	0.24%	0.14%

易方达丰华债券 C

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	1.39%	0.23%	0.96%	0.10%	0.43%	0.13%
过去三个月	-0.17%	0.33%	-0.60%	0.14%	0.43%	0.19%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.60%	0.30%	0.54%	0.15%	0.06%	0.15%

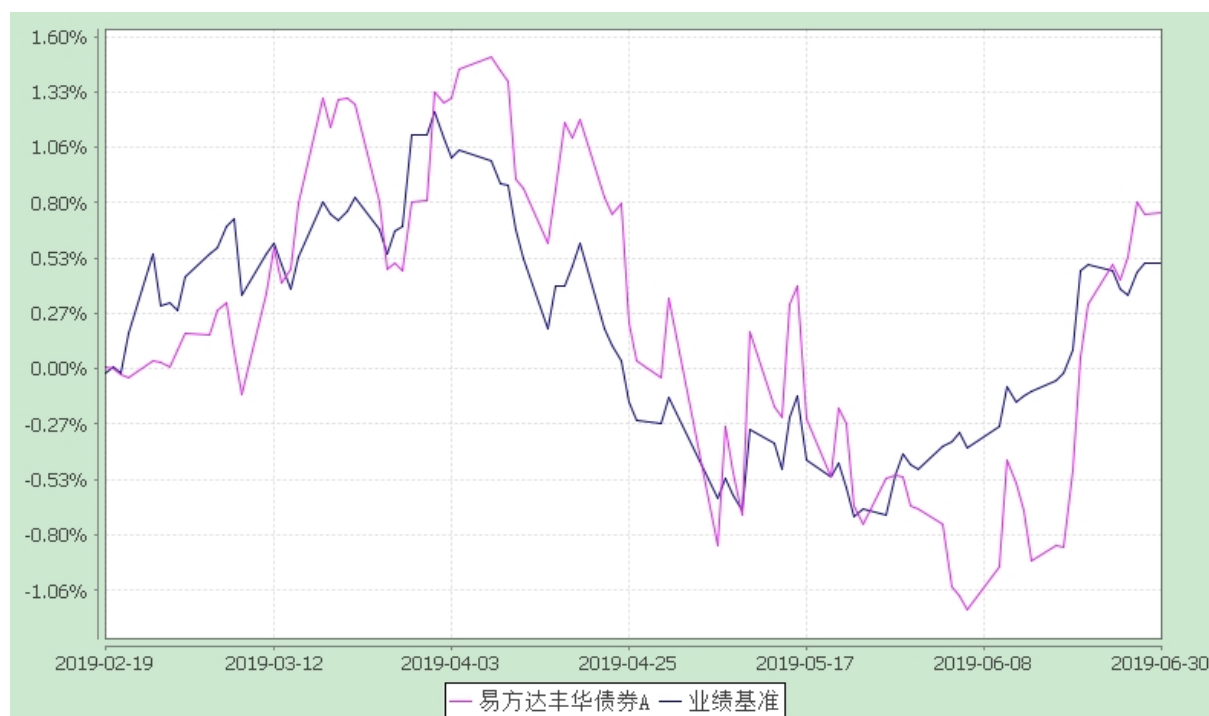
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达丰华债券型证券投资基金

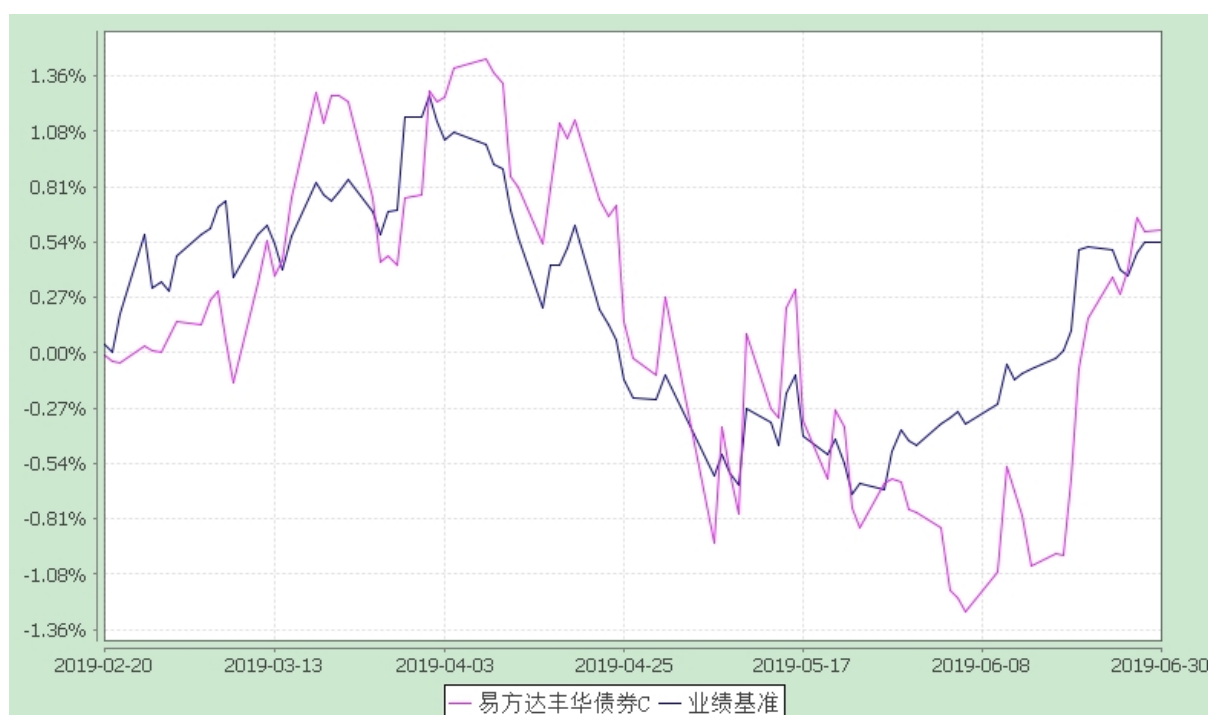
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年2月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日)

易方达丰华债券 A



## 易方达丰华债券 C



注：1.本基金由原易方达保本一号混合型证券投资基金于2019年2月19日转型而来，截至报告期末，本基金合同生效未满一年。

2.自2019年2月19日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2019年2月20日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.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。

4.自基金转型至报告期末，A类基金份额净值增长率为0.75%，同期业绩比较基准收益率为0.51%。C类基金份额净值增长率为0.60%，同期业绩比较基准收益率为0.54%。

### 3.2.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

#### 3.2.2.1 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
2019年2月1日-2019年2月18日	-0.01%	0.00%	0.14%	0.03%	-0.15%	-0.03%
2019年1月1日-2019年	0.19%	0.03%	0.37%	0.01%	-0.18%	0.02%

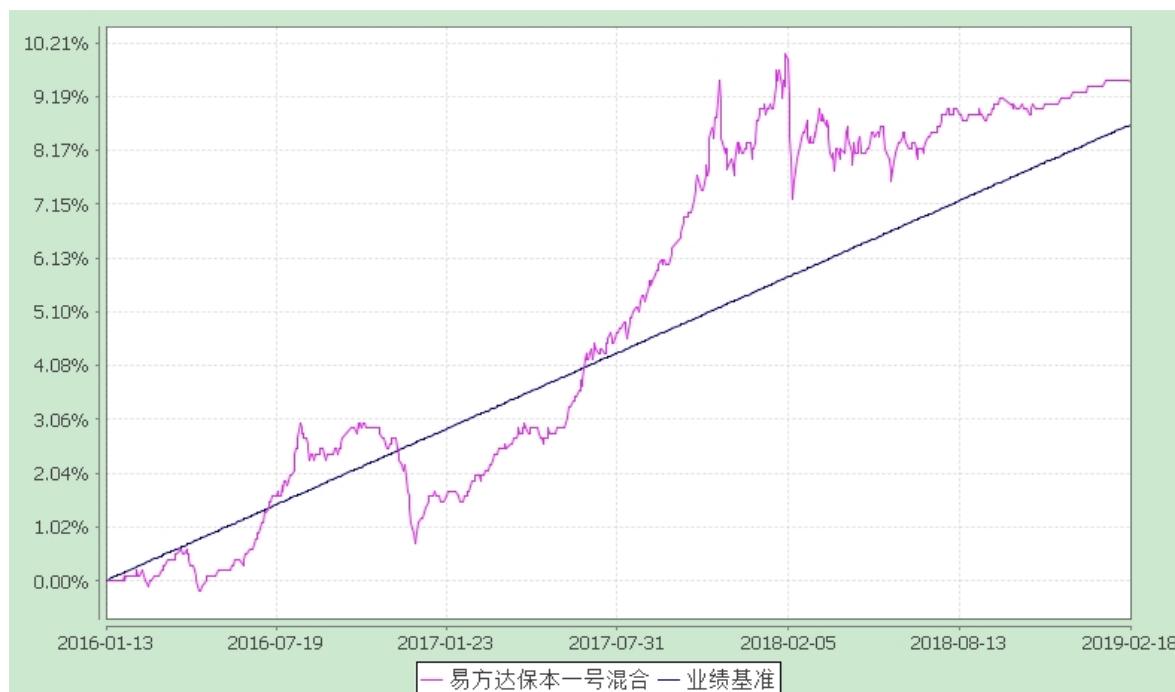
2月18日						
2018年10月1日-2019年2月18日	0.28%	0.04%	1.08%	0.01%	-0.80%	0.03%
2018年4月1日-2019年2月18日	1.17%	0.08%	2.48%	0.01%	-1.31%	0.07%
2016年4月1日-2019年2月18日	8.92%	0.12%	8.05%	0.01%	0.87%	0.11%
2016年1月13日-2019年2月18日	9.47%	0.12%	8.65%	0.01%	0.82%	0.11%

### 3.2.2.2 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

易方达保本一号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

(2016年1月13日至2019年2月18日)



注：自基金合同生效至2019年2月18日，基金份额净值增长率为9.47%，同期业绩比较基准收益率为8.65%。

## 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王晓晨	易方达保本一号混合型证券投资基金的基金经理、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、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、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合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、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达富财纯债债券型证券投资基金的基金经	2016-01-13	2019-02-19	16年	硕士研究生，曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管、固定收益总部总经理助理、固定收益基金投资部副总经理、易方达货币市场基金基金经理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理。

	理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益投资部副总经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员(RO)、提供资产管理负责人员(RO)、易方达资产管理(香港)有限公司固定收益投资决策委员会委员				
张清华	易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理、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、易方达瑞和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、易方达丰和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、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、混合资产投资部总经理	2019-02-19	-	12年	硕士研究生，曾任晨星资讯(深圳)有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，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、易方达瑞选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	易方达丰华债券型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、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	2019-03-06	-	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

	<p>年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达增强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、易方达恒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、易方达富财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助理（自 2015 年 02 月 17 日至 2018 年 12 月 31 日）、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、易方达安盈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、易方达安心回报债券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、易方达鑫转招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（自 2015 年 06 月 11 日至 2018 年 12 月 31 日）、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）、混合资产投资部总经理助理</p>				<p>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。</p>
林	易方达保本一号混合型证券投资	2016-01-	2019-01-	7 年	博士研究生，曾任宏源证券

虎	资基金的基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理助理	19	19		研究所固定收益分析师，国信证券研究所宏观分析师。
张凯岷	易方达保本一号混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理助理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理助理	2018-11-16	2019-01-19	8年	硕士研究生，曾任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债券交易员。
田宇	易方达丰华债券型证券投资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）、易方达安盈回报混合型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、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达富财纯债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	2019-03-06	-	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。



	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、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理				
杨康	易方达丰华债券型证券投资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、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、易方达安心回报债券型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、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助理、易方达瑞景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.此处王晓晨的“任职日期”为原易方达保本一号混合型证券投资基金基金合同生效之日，林虎、张凯頔的“任职日期”为原易方达保本一号混合型证券投资基金基金经理助理变更公告确定的聘任之日，张清华的“任职日期”为易方达丰华债券型证券投资基金基金合同生效之日，张雅君、田宇、杨康的“任职日期”为易方达丰华债券型证券投资基金基金经理助理变更公告确定的聘任之日；“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

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。

3.为加强基金流动性管理，易方达丰华债券型证券投资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 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。

一季度本基金债券部分卖出同业存单和短融，买入中短久期信用债，获取票息收益为主。权益部分加仓股票和转债。二季度组合杠杆水平大幅提升，主要是增加了债券的仓位，在转债市场调整过程中，也精选个券，小幅提升了转债仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019年6月30日，易方达丰华债券型证券投资基金A类基金份额净值为1.0075元，本报告期(2019年2月19日—2019年6月30日)份额净值增长率为0.75%，同期业绩比较基准收益率为0.51%；C类基金份额净值为1.0061元，本报告期(2019年2月20日—2019年6月30日)份额净值增长率为0.60%，同期业绩比较基准收益率为0.54%。

2019年2月18日，原易方达保本一号混合型证券投资基金份额净值为1.000元，本报告期(2019年1月1日—2019年2月18日)份额净值增长率为0.19%，同期业绩比较基准收益率为0.37%。

#### 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重大风险。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。

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信用等级信用债为主，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。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

##### 4.7.1 易方达丰华债券型证券投资基金

易方达丰华债券 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达丰华债券 C:本报告期内未实施利润分配。

##### 4.7.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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 易方达丰华债券型证券投资基金

#### 6.1.1 资产负债表

会计主体：易方达丰华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	附注号	本期末 2019年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.1.4.7.1	7,042,753.40
结算备付金		6,543,054.76
存出保证金		109,701.71
交易性金融资产	6.1.4.7.2	595,198,145.41
其中：股票投资		64,959,627.45
基金投资		-
债券投资		530,238,517.96

资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.1.4.7.5	9,871,076.06
应收股利		-
应收申购款		25,167.64
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>618,789,898.98</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		167,494,500.01
应付证券清算款		5,533,774.92
应付赎回款		486,347.07
应付管理人报酬		310,058.33
应付托管费		77,514.57
应付销售服务费		93,170.20
应付交易费用	6.1.4.7.7	74,627.50
应交税费		55,455.79
应付利息		19,126.62
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.1.4.7.8	209,851.97
<b>负债合计</b>		<b>174,354,426.98</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.1.4.7.9	435,338,780.88
未分配利润	6.1.4.7.10	9,096,691.12
<b>所有者权益合计</b>		<b>444,435,472.00</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>618,789,898.98</b>

注：1.本基金由原易方达保本一号混合型证券投资基金于2019年2月19日转型而来，2019年半年度实际报告期间为2019年2月19日至2019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 2019 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0075 元，C 类基金份额净值 1.0061 元；基金份额总额 441,482,239.34 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 187,168,251.08 份，C 类基金份额总额 254,313,988.26 份。

### 6.1.2 利润表

会计主体：易方达丰华债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 2 月 19 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 2 月 19 日（基金合同生效 日）至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>326,891.91</b>
1.利息收入		6,171,700.61
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	57,257.11
债券利息收入		6,010,568.45
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		103,875.05
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,455,541.33
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	-1,700,185.37
基金投资收益		-
债券投资收益	6.1.4.7.13	-1,253,066.26
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.1.4.7.14	-
股利收益	6.1.4.7.15	497,710.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.16	-3,431,446.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.17	42,179.03
<b>减：二、费用</b>		<b>2,709,366.55</b>
1. 管理人报酬		1,120,769.05
2. 托管费		280,192.29
3. 销售服务费		302,976.58
4. 交易费用	6.1.4.7.18	117,692.35

5. 利息支出		763,201.32
其中：卖出回购金融资产支出		763,201.32
6. 税金及附加		19,843.55
7. 其他费用	6.1.4.7.19	104,691.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,382,474.64</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,382,474.64</b>

注：本基金由原易方达保本一号混合型证券投资基金于2019年2月19日转型而来，2019年半年度实际报告期间为2019年2月19日至2019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。

### 6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达丰华债券型证券投资基金

本报告期：2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019年2月19日（基金合同生效日）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）	155,998,938.41	5,292,728.55	161,291,666.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,382,474.64	-2,382,474.64
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）	279,339,842.47	6,186,437.21	285,526,279.68
其中：1.基金申购款	437,035,877.28	7,903,131.88	444,939,009.16
2.基金赎回款	-157,696,034.81	-1,716,694.67	-159,412,729.48
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）	435,338,780.88	9,096,691.12	444,435,472.00

注：本基金由原易方达保本一号混合型证券投资基金于2019年2月19日转型而来，2019年



半年度实际报告期间为 2019 年 2 月 19 日至 2019 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 6.1.1 至 6.1.4，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

## 6.1.4 报表附注

### 6.1.4.1 基金基本情况

易方达丰华债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由易方达保本一号混合型证券投资基金转型而来。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[2018]1904号《关于准予易方达保本一号混合型证券投资基金变更注册的批复》和基金管理人于 2019 年 1 月 3 日发布的《易方达保本一号混合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》，易方达保本一号混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型为易方达丰华债券型证券投资基金，并相应删除保本机制，调整基金合同中投资目标、投资范围、投资策略、风险收益特征、基金费率、基金资产估值、收益分配政策等条款，基金名称相应变更为“易方达丰华债券型证券投资基金”。原易方达保本一号混合型证券投资基金基金份额转为易方达丰华债券型证券投资基金 A 类基金份额。基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。依据基金份额持有人大会决议，2019 年 2 月 19 日起，原《易方达保本一号混合型证券投资基金基金合同》失效，《易方达丰华债券型证券投资基金基金合同》生效。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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

自 2019 年 2 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 2 月 20 日。

### 6.1.4.2 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达丰华债券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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.1.4.3 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。

#### 6.1.4.4 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。

##### 6.1.4.4.1 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2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年12月31日。

##### 6.1.4.4.2 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。

##### 6.1.4.4.3 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。

##### 6.1.4.4.4 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。

#### 6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，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。

#### 6.1.4.4.6 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。

#### 6.1.4.4.7 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。

#### 6.1.4.4.8 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)。

#### 6.1.4.4.9 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及由基金管理人缴纳的增值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，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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。

#### 6.1.4.4.10 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。

#### 6.1.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响且符合法律法规要求的前提下，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；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.1.4.4.12 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[2017]13号《中国证监会关于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) 于2017年12月15日前，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。自2017年12月15日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.1.4.5.1 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。

##### **6.1.4.5.2 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。

##### **6.1.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无会计差错。

#### **6.1.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。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。

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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	活期存款	7,042,753.40
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计	7,042,753.40	

##### 6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	64,550,197.44	64,959,627.45	409,430.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	324,059,719.06	319,749,517.96
	银行间市场	210,019,675.31	210,489,000.00

	合计	534,079,394.37	530,238,517.96	-3,840,876.41
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	598,629,591.81	595,198,145.41	-3,431,446.40

#### 6.1.4.7.3 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。

#### 6.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.1.4.7.4.2 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。

#### 6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	908.42
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	2,944.40
应收债券利息	9,867,173.84
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	49.40
合计	9,871,076.06

#### 6.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----



	2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	59,729.56
银行间市场应付交易费用	14,897.94
合计	74,627.50

#### 6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	74.83
预提费用	209,777.14
合计	209,851.97

#### 6.1.4.7.9 实收基金

易方达丰华债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	161,291,666.12	155,998,938.41
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	83,161,848.69	80,431,235.60
本期赎回（以“-”号填列）	-57,285,263.73	-55,405,381.39
本期末	187,168,251.08	181,024,792.62

易方达丰华债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整（若有）	-	-

-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	356,604,641.68	356,604,641.68
本期赎回(以“-”号填列)	-102,290,653.42	-102,290,653.42
本期末	254,313,988.26	254,313,988.26

注: 1.本基金由原易方达保本一号混合型证券投资基金于2019年2月19日转型而来。

2.申购含红利再投、转换入份额, 赎回含转换出份额。

#### 6.1.4.7.10 未分配利润

易方达丰华债券 A

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	5,224,777.63	67,950.92	5,292,728.55
本期利润	673,940.52	-47,490.59	626,449.93
本期基金份额交易产生的变动数	905,204.26	715,473.04	1,620,677.30
其中: 基金申购款	2,845,270.66	829,338.48	3,674,609.14
基金赎回款	-1,940,066.40	-113,865.44	-2,053,931.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,803,922.41	735,933.37	7,539,855.78

易方达丰华债券 C

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	375,031.24	-3,383,955.81	-3,008,924.57
本期基金份额交易产生的变动数	309,068.72	4,256,691.19	4,565,759.91
其中: 基金申购款	513,103.64	3,715,419.10	4,228,522.74
基金赎回款	-204,034.92	541,272.09	337,237.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	684,099.96	872,735.38	1,556,835.34

#### 6.1.4.7.11 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 2019年2月19日(基金合同生效日)至2019年6月30日

活期存款利息收入	24,859.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	31,812.30
其他	585.78
合计	57,257.11

#### 6.1.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出股票成交总额	17,733,659.71
减：卖出股票成本总额	19,433,845.08
买卖股票差价收入	-1,700,185.37

#### 6.1.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	235,868,296.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	231,820,287.37
减：应收利息总额	5,301,075.29
买卖债券差价收入	-1,253,066.26

#### 6.1.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.1.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	497,710.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	497,710.30

#### 6.1.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日
1.交易性金融资产	-3,431,446.40
——股票投资	409,430.01
——债券投资	-3,840,876.41
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-3,431,446.40

#### 6.1.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日
基金赎回费收入	42,179.03
其他	-
合计	42,179.03

#### 6.1.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日
交易所市场交易费用	110,254.85
银行间市场交易费用	7,437.50
合计	117,692.35

#### 6.1.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日

审计费用	37,249.08
信息披露费	43,974.48
银行汇划费	14,167.85
银行间账户维护费	9,000.00
其他	300.00
合计	104,691.41

#### 6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.1.4.8.1 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。

##### 6.1.4.8.2 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。

#### 6.1.4.9 关联方关系

##### 6.1.4.9.1 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。

##### 6.1.4.9.2 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
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。

##### 6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.1.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	101,440,702.35	100.00%

##### 6.1.4.10.1.2 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。

##### 6.1.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

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			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	81,152.55	100.00%	59,729.56	100.00%

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。

#### 6.1.4.10.2 关联方报酬

##### 6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	453,657.93

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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。

##### 6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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取。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 6.1.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达丰华债券 A	易方达丰华债券 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	786.30	786.30
招商银行	-	295,763.18	295,763.18
合计	-	296,549.48	296,549.48

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 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.1.4.10.4.1 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。

#### 6.1.4.10.4 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。

#### 6.1.4.10.5 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 2019年2月19日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	7,042,753.40	24,859.03

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。

#### 6.1.4.10.6 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。

#### 6.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.1.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.1.4.11 利润分配情况

易方达丰华债券 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达丰华债券 C

本报告期内未发生利润分配。

#### 6.1.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.1.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注



				型						
601236	红塔证券	2019-06-27	2019-07-05	新股流通受限	3.46	3.46	1,000	3,460.00	3,460.00	-
<b>6.1.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113027	华钰转债	2019-06-18	2019-07-10	新发流通受限	100.00	100.00	3,390	338,991.08	338,991.08	-
113028	环境转债	2019-06-20	2019-07-08	新发流通受限	100.00	100.00	1,440	143,998.74	143,998.74	-

**6.1.4.12.2 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。

**6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.1.4.12.3.1 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
101801107	18 淮南矿 MTN004	2019-07-02	102.65	100,000	10,265,000.00
101900349	19 中交房产 MTN001	2019-07-02	100.64	100,000	10,064,000.00
170215	17 国开 15	2019-07-02	102.76	21,000	2,157,960.00
190201	19 国开 01	2019-07-02	99.96	200,000	19,992,000.00
合计				421,000	42,478,960.00

**6.1.4.12.3.2 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（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的

比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 6.1.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.1.4.13.1 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。

本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。理论上其预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。

#### 6.1.4.13.2 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2019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109.11%。

#### 6.1.4.13.2.1 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 2019年6月30日
A-1	10,078,612.02
A-1 以下	0.00
未评级	23,288,129.59
合计	33,366,741.61

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。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.1.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

#### 6.1.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

#### 6.1.4.13.2.4 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 2019年6月30日
AAA	292,467,217.10
AAA 以下	182,359,919.39
未评级	31,911,813.70
合计	506,738,950.19

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。

#### 6.1.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

#### 6.1.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

#### 6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于2019年6月30日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所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。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.1.4.13.4 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。

##### 6.1.4.13.4.1 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。

###### 6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	7,042,753.40	-	-	-	7,042,753.40
结算备付金	6,543,054.76	-	-	-	6,543,054.76
存出保证金	109,701.71	-	-	-	109,701.71
交易性金融资产	73,147,300.00	339,990,042.00	117,101,175.96	64,959,627.45	595,198,145.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,871,076.06	9,871,076.06
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	25,167.64	25,167.64
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	86,842,809.87	339,990,042.00	117,101,175.96	74,855,871.15	618,789,898.98
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	167,494,500.01	-	-	-	167,494,500.01
应付证券清算款	-	-	-	5,533,774.92	5,533,774.92
应付赎回款	-	-	-	486,347.07	486,347.07
应付管理人报酬	-	-	-	310,058.33	310,058.33
应付托管费	-	-	-	77,514.57	77,514.57
应付销售服务费	-	-	-	93,170.20	93,170.20
应付交易费用	-	-	-	74,627.50	74,627.50
应交税费	-	-	-	55,455.79	55,455.79
应付利息	-	-	-	19,126.62	19,126.62
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	209,851.97	209,851.97
负债总计	167,494,500.01	-	-	6,859,926.97	174,354,426.98

					8
利率敏感度缺口	-80,651,690.14	339,990,042.00	117,101,175.96	67,995,944.18	444,435,472.00

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。

#### 6.1.4.13.4.1.2 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 2019年6月30日
	1.市场利率下降 25 个基点	2,596,628.99
	2.市场利率上升 25 个基点	-2,567,931.95

#### 6.1.4.13.4.2 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。

#### 6.1.4.13.4.3 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。

#### 6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019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	64,959,627.45	14.62
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	64,959,627.45	14.62

#### 6.1.4.13.4.3.2 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 2019年6月30日
	1.业绩比较基准上升5%	54,754,869.90
	2.业绩比较基准下降5%	-54,754,869.90

#### 6.1.4.14 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2019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130,987,803.41元,属于第二层次的余额为464,210,342.00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2019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。

## 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

报告截止日：2019年2月18日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年2月18日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.2.4.7.1	147,464,258.25	600,961,483.81
结算备付金		21,687,729.75	28,849,084.96
存出保证金		71,908.61	82,183.63
交易性金融资产	6.2.4.7.2	-	1,935,071,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	1,935,071,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-	844,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.2.4.7.5	479,704.05	66,178,580.25
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>169,703,600.66</b>	<b>3,475,142,332.65</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年2月18日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		8,079,805.12	300,481.30



应付管理人报酬		-	3,539,283.13
应付托管费		-	589,880.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.2.4.7.7	575.00	96,806.17
应交税费		-	156,803.34
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.8	331,553.58	304,517.57
<b>负债合计</b>		<b>8,411,933.70</b>	<b>4,987,772.01</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.2.4.7.9	155,998,938.41	3,361,275,371.77
未分配利润	6.2.4.7.10	5,292,728.55	108,879,188.87
<b>所有者权益合计</b>		<b>161,291,666.96</b>	<b>3,470,154,560.64</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>169,703,600.66</b>	<b>3,475,142,332.65</b>

注：报告截止日 2019 年 2 月 18 日，基金份额净值 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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 18 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>4,210,416.22</b>	<b>39,764,886.99</b>
1.利息收入		7,719,503.19	79,587,479.02
其中：存款利息收入	6.2.4.7.11	1,185,649.58	330,238.16
债券利息收入		5,235,386.78	78,602,459.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,298,466.83	654,781.16
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,114,628.64	-30,786,591.16
其中：股票投资收益	6.2.4.7.12	-	-25,946,057.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.2.4.7.13	-6,114,628.64	-7,631,363.61
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.2.4.7.14	-	-
股利收益	6.2.4.7.15	-	2,790,829.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.16	2,557,746.17	-10,849,160.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.17	47,795.50	1,813,159.78
<b>减：二、费用</b>		<b>1,942,282.29</b>	<b>40,883,472.69</b>
1. 管理人报酬		1,595,823.27	21,887,251.80
2. 托管费		265,970.54	3,647,875.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.2.4.7.18	575.00	2,542,996.86
5. 利息支出		544.85	12,452,244.46
其中：卖出回购金融资产支出		544.85	12,452,244.46
6. 税金及附加		13,524.76	119,766.16
7. 其他费用	6.2.4.7.19	65,843.87	233,338.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>2,268,133.93</b>	<b>-1,118,585.70</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>2,268,133.93</b>	<b>-1,118,585.70</b>

### 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

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月18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）	3,361,275,371.77	108,879,188.87	3,470,154,560.64
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	-3,205,276,433.36	-105,854,594.25	-3,311,131,027.61

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-3,205,276,433.36	-105,854,594.25	-3,311,131,027.61
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)	155,998,938.41	5,292,728.55	161,291,666.96
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)	3,775,987,585.93	85,242,473.97	3,861,230,059.90
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)	-352,172,009.29	-8,079,499.66	-360,251,508.95
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-352,172,009.29	-8,079,499.66	-360,251,508.95
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)	3,423,815,576.64	76,044,388.61	3,499,859,965.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，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

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

易方达保本一号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[2013]657号《关于核准易方达保本一号混合型证券投资基金募集的批复》和证监许可[2015]1988号《关于准予易方达保本一号混合型证券投资基金变更注册的批复》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《易方达保本一号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,《易方达保本一号混合型证券投资基金基金合同》于2016年1月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,634,146,239.58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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

#### 6.2.4.2 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达保本一号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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.2.4.3 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。

#### 6.2.4.4 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。

#### 6.2.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号

《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年2月18日
活期存款	147,464,258.25
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-

存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	147,464,258.25

#### 6.2.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产。

#### 6.2.4.7.3 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。

#### 6.2.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.2.4.7.4.2 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。

#### 6.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年2月18日
应收活期存款利息	447,360.98
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	32,125.53
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	217.54
合计	479,704.05

#### 6.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年2月18日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	575.00
合计	575.00

#### 6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年2月18日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	331,553.58
合计	331,553.58

#### 6.2.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月18日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,361,275,371.77	3,361,275,371.77
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,205,276,433.36	-3,205,276,433.36
2019年2月18日基金拆分/份额折算前	155,998,938.41	155,998,938.41
基金拆分/份额折算调整	5,292,727.71	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	161,291,666.12	155,998,938.41

注：1.原易方达保本一号混合型证券投资基金已于2019年2月18日进行了基金份额折算，折算比例为1.033927978，折算后基金份额净值为1.000人民币元。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.2.4.7.10 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
上年度末	109,978,646.80	-1,099,457.93	108,879,188.87
本期利润	-289,612.24	2,557,746.17	2,268,133.93
本期基金份额交易产生的变动数	-104,464,256.93	-1,390,337.32	-105,854,594.25
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-104,464,256.93	-1,390,337.32	-105,854,594.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,224,777.63	67,950.92	5,292,728.55

**6.2.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月18日
活期存款利息收入	440,044.18
定期存款利息收入	727,583.34
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,845.22
其他	176.84
合计	1,185,649.58

**6.2.4.7.12 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。

**6.2.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月18日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,017,594,917.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,957,631,186.17
减：应收利息总额	66,078,360.00
买卖债券差价收入	-6,114,628.64

**6.2.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。



**6.2.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.2.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年2月18日
1.交易性金融资产	2,557,746.17
——股票投资	-
——债券投资	2,557,746.17
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,557,746.17

**6.2.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月18日
基金赎回费收入	47,795.50
其他	-
合计	47,795.50

**6.2.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月18日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	575.00
合计	575.00

**6.2.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月18日	
	审计费用	13,827.31
信息披露费	14,726.27	
银行汇划费	7,990.29	
银行间账户维护费	9,000.00	
其他	20,300.00	
合计	65,843.87	

**6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.2.4.8.1 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。

**6.2.4.8.2 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。

**6.2.4.9 关联方关系****6.2.4.9.1 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。

**6.2.4.9.2 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
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

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。

**6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.2.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年2月18日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股

		票成交总 额的比例		票成交总 额的比例
广发证券	-	-	1,725,040,717.42	100.00%

#### 6.2.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.2.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年2月18日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	1,380,033.04	100.00%	563,289.81	100.00%

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。

#### 6.2.4.10.2 关联方报酬

##### 6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年2月 18日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,595,823.27	21,887,251.80
其中：支付销售机构的客户维护费	88,679.39	1,394,221.81

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月

末, 按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后, 由基金托管人于次月前3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、公休假或不可抗力等, 支付日期顺延。到期操作期间(保本周期到期日除外)及过渡期内本基金不计提管理费。

#### 6.2.4.10.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年2月18日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	265,970.54	3,647,875.33

注: 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后, 由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等, 支付日期顺延。到期操作期间(保本周期到期日除外)及过渡期内本基金不计提托管费。

#### 6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

#### 6.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.2.4.10.4.2 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。

#### 6.2.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年2月18日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	147,464,258.25	440,044.18	1,007,271.66	46,093.31

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。

#### 6.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2019年1月1日至2019年2月18日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	002927	泰永长征	新股网下发行	961	14,203.58

#### 6.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.2.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.2.4.11 利润分配情况

本报告期内未发生利润分配。

#### 6.2.4.12 期末（2019年2月18日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.2.4.12.1 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。

##### 6.2.4.12.2 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股票。

##### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年2月18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为0，无抵押债券。

###### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 2 月 18 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。

#### 6.2.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.2.4.13.1 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。

本基金通过运用投资组合保险技术控制本金损失的风险，并力争实现基金资产的稳健增值。

##### 6.2.4.13.2 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 2019 年 2 月 18 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 0.00%(2018 年 12 月 31 日：52.33%)。

##### 6.2.4.13.2.1 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 2019年2月18日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	637,103,061.75
合计	0.00	637,103,061.75

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。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.2.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.2.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.2.4.13.2.4 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 2019年2月18日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	62,210,827.95
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	62,210,827.95

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。

#### 6.2.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**6.2.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	1,299,119,903.25
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	1,299,119,903.25

**6.2.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于2019年2月18日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**6.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所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。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

**6.2.4.13.4 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。

**6.2.4.13.4.1 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。



## 6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年2月18日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	147,464,258.25	-	-	-	147,464,258.25
结算备付金	21,687,729.75	-	-	-	21,687,729.75
存出保证金	71,908.61	-	-	-	71,908.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	479,704.05	479,704.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	169,223,896.61	-	-	479,704.05	169,703,600.66
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,079,805.12	8,079,805.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	575.00	575.00
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	331,553.58	331,553.58

负债总计	-	-	-	8,411,933.70	8,411,933.70
利率敏感度缺口	169,223,896.61	-	-	-7,932,229.65	161,291,666.96
<b>上年度末 2018年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	600,961,483.81	-	-	-	600,961,483.81
结算备付金	28,849,084.96	-	-	-	28,849,084.96
存出保证金	82,183.63	-	-	-	82,183.63
交易性金融资产	1,935,071,000.00	-	-	-	1,935,071,000.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	844,000,000.00	-	-	-	844,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	66,178,580.25	66,178,580.25
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,408,963,752.40	-	-	66,178,580.25	3,475,142,332.65
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	300,481.30	300,481.30
应付管理人报酬	-	-	-	3,539,283.13	3,539,283.13
应付托管费	-	-	-	589,880.50	589,880.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	96,806.17	96,806.17
应交税费	-	-	-	156,803.34	156,803.34
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	304,517.57	304,517.57
负债总计	-	-	-	4,987,772.01	4,987,772.01
利率敏感度缺口	3,408,963,752.40	-	-	61,190,808.24	3,470,154,560.64

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。

#### 6.2.4.13.4.1.2 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 2019年2月18日	上年度末 2018年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	0.00	117,801.35
2.市场利率上升25个基点	0.00	-117,784.49	

#### 6.2.4.13.4.2 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。

#### 6.2.4.13.4.3 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。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投资股票、权证等其他交易性金融资产。

于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

#### 6.2.4.14 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2019年2月18日,本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(2018年12月31日:无属于第一层次的余额,第二层次1,935,071,000.00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2019年2月18日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018年12月31日:同)。

(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 易方达丰华债券型证券投资基金

(报告期:2019年2月19日(基金合同生效日)-2019年6月30日)

#### 7.1.1 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	64,959,627.45	10.50
	其中:股票	64,959,627.45	10.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	530,238,517.96	85.69
	其中:债券	530,238,517.96	85.69
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,585,808.16	2.20
8	其他各项资产	10,005,945.41	1.62
9	合计	618,789,898.98	100.00

## 7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.1.2.1 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	10,650.00	0.00
C	制造业	59,987,837.45	13.50
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	4,957,680.00	1.12
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	3,460.00	0.00
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	64,959,627.45	14.62

### 7.1.3 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	002250	联化科技	697,200	7,731,948.00	1.74
2	600486	扬农化工	140,580	7,689,726.00	1.73
3	603806	福斯特	179,760	6,602,584.80	1.49
4	000786	北新建材	300,900	5,455,317.00	1.23
5	600741	华域汽车	242,700	5,242,320.00	1.18
6	000895	双汇发展	208,700	5,194,543.00	1.17
7	600004	白云机场	272,400	4,957,680.00	1.12
8	600332	白云山	116,852	4,787,426.44	1.08
9	300628	亿联网络	40,260	4,310,638.20	0.97
10	600703	三安光电	366,500	4,134,120.00	0.93
11	002202	金风科技	238,587	2,965,636.41	0.67
12	000860	顺鑫农业	46,020	2,146,833.00	0.48
13	002007	华兰生物	57,900	1,765,371.00	0.40
14	600104	上汽集团	54,400	1,387,200.00	0.31
15	002179	中航光电	17,160	574,173.60	0.13
16	600968	海油发展	3,000	10,650.00	0.00
17	601236	红塔证券	1,000	3,460.00	0.00

#### 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.1.4.1 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	000786	北新建材	10,790,038.00	2.43
2	600486	扬农化工	8,163,658.00	1.84
3	002250	联化科技	6,980,323.32	1.57
4	600933	爱柯迪	6,683,414.00	1.50
5	600741	华域汽车	6,143,345.00	1.38
6	603806	福斯特	6,041,920.65	1.36
7	600332	白云山	5,945,794.60	1.34
8	000895	双汇发展	5,494,880.00	1.24
9	601398	工商银行	5,447,625.00	1.23
10	600703	三安光电	5,373,460.00	1.21
11	600004	白云机场	3,987,002.00	0.90
12	300628	亿联网络	3,880,224.00	0.87
13	002202	金风科技	3,254,823.45	0.73
14	002007	华兰生物	1,483,976.00	0.33
15	000860	顺鑫农业	1,481,165.00	0.33
16	600104	上汽集团	1,396,773.00	0.31

17	601688	华泰证券	711,489.00	0.16
18	002179	中航光电	583,132.50	0.13
19	601877	正泰电器	131,419.00	0.03
20	600968	海油发展	6,120.00	0.00

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。

#### 7.1.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600933	爱柯迪	5,218,593.00	1.17
2	601398	工商银行	5,110,000.00	1.15
3	000786	北新建材	4,979,628.71	1.12
4	600332	白云山	1,603,641.00	0.36
5	601688	华泰证券	703,269.00	0.16
6	601877	正泰电器	118,528.00	0.03

注：卖出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。

#### 7.1.4.3 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	83,984,042.52
卖出股票收入（成交）总额	17,733,659.71

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。

#### 7.1.5 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	53,850,300.00	12.12
	其中：政策性金融债	53,850,300.00	12.12
4	企业债券	281,064,450.00	63.24
5	企业短期融资券	10,010,000.00	2.25
6	中期票据	112,131,000.00	25.23
7	可转债（可交换债）	73,182,767.96	16.47
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	530,238,517.96	119.31

### 7.1.6 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	122497	15 远洋 04	300,000	30,849,000.00	6.94
2	170215	17 国开 15	300,000	30,828,000.00	6.94
3	143771	18 诚通 03	300,000	30,597,000.00	6.88
4	101801316	18 普洛斯 MTN005	200,000	20,320,000.00	4.57
5	101900482	19 中航租赁 MTN001	200,000	20,232,000.00	4.55

### 7.1.7 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。

### 7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.1.9 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。

### 7.1.10 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。

### 7.1.11 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。

### 7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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。

7.1.12.2 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。

### 7.1.12.3 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	109,701.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,871,076.06
5	应收申购款	25,167.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,005,945.41

#### 7.1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110046	圆通转债	3,471,900.00	0.78
2	113519	长久转债	36,655.40	0.01

#### 7.1.12.5 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。

### 7.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年2月18日)

#### 7.2.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	169,151,988.00	99.67
8	其他各项资产	551,612.66	0.33
9	合计	169,703,600.66	100.00

## 7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.2.1 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。

### 7.2.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.2.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

### 7.2.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

### 7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

## 7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.2.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.2.7 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。

## 7.2.8 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。

## 7.2.9 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。

### 7.2.10 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。

### 7.2.11 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。

### 7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 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。

7.2.12.2 本基金本报告期末未持有股票，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。

### 7.2.12.3 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	71,908.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	479,704.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	551,612.66

### 7.2.12.4 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。

### 7.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 易方达丰华债券型证券投资基金

(报告期：2019年2月19日(基金合同生效日)-2019年6月30日)

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
易方达丰华债券 A	2,257	82,927.89	6,152,020.62	3.29%	181,016,230.46	96.71%
易方达丰华债券 C	1,076	236,351.29	0.00	0.00%	254,313,988.26	100.00%
合计	3,333	132,457.92	6,152,020.62	1.39%	435,330,218.72	98.61%

### 8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达丰华债券 A	1,123.49	0.0006%
	易方达丰华债券 C	495,268.49	0.1947%
	合计	496,391.98	0.1124%

### 8.1.3 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	份额级别	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	易方达丰华债券 A	0
	易方达丰华债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达丰华债券 A	0
	易方达丰华债券 C	0
	合计	0

## 8.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

(报告期: 2019年1月1日-2019年2月18日)

### 8.2.1 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

2,043	78,948.44	6,142,146 .40	3.81%	155,149,5 19.72	96.19%
-------	-----------	------------------	-------	--------------------	--------

### 8.2.2 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	1,086.61	0.0007%

### 8.2.3 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

### 9.1 易方达丰华债券型证券投资基金

（报告期：2019年2月19日（基金合同生效日）-2019年6月30日）

单位：份

项目	易方达丰华债券 A	易方达丰华债券 C
基金合同生效日（2019年2月19日）基金份额总额	161,291,666.12	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	83,161,848.69	356,604,641.68
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	57,285,263.73	102,290,653.42
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	187,168,251.08	254,313,988.26

注：本基金 A 类份额由易方达保本一号混合型证券投资基金转型而来，并增设 C 类份额类别，基金合同于 2019 年 2 月 19 日起生效，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

### 9.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

（报告期：2019年1月1日-2019年2月18日）

单位：份

基金合同生效日（2016年1月13日）基金份	4,634,146,239.58
------------------------	------------------

额总额	
本报告期期初基金份额总额	3,361,275,371.77
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	3,205,276,433.36
本报告期基金拆分变动份额	5,292,727.71
本报告期期末基金份额总额	161,291,666.12

注：自 2019 年 2 月 19 日起，“易方达保本一号混合型证券投资基金”更名为“易方达丰华债券型证券投资基金”。本基金拆分变动份额含因期间内折算导致的强制调增份额，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金由易方达保本一号混合型证券投资基金转型而来，易方达保本一号混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，自 2018 年 11 月 28 日起，至 2018 年 12 月 28 日 17:00 点止（投票表决时间以本次大会公证机关收到表决票时间为准）进行了投票表决。会议审议通过了《关于易方达保本一号混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型有关事项的议案》，同意易方达保本一号混合型证券投资基金在第一个保本周期到期后转型为本基金，并对《易方达保本一号混合型证券投资基金基金合同》中基金名称、基金的类别、保本机制、投资目标、投资范围、投资策略、风险收益特征、基金费率、基金资产估值、收益分配条款等内容进行修改。根据上述表决，基金份额持有人大会决定的事项自 2019 年 1 月 2 日起正式生效。

### 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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

自 2019 年 2 月 19 日起原易方达保本一号混合型证券投资基金转型为易方达丰华债券型证券投资基金。本基金从投资组合保险策略、借鉴恒定比例组合保险（CPPI）策略的原理在安全资产与风险资产之间进行动态配置变更为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后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的投资

策略。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。本基金在股票投资上主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。

### 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会广东监管局《关于对易方达基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，对公司个别未按规定进行备案报告的事项提出了整改要求。公司已及时完成了整改。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 易方达丰华债券型证券投资基金

（报告期：2019年2月19日（基金合同生效日）-2019年6月30日）

##### 10.7.1.1 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	
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	101,440,702.35	100.00%	81,152.55	100.00%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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。

#### 10.7.1.2 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
广发证券	441,240,919.94	100.00%	5,085,300,000.00	100.00%	-	-

#### 10.7.2 易方达保本一号混合型证券投资基金

(报告期: 2019年1月1日-2019年2月18日)

##### 10.7.2.1 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	
东方证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-

注: a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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。

#### 10.7.2.2 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
广发证券	-	-	4,771,300,000.00	100.00%	-	-

#### 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	易方达保本一号混合型证券投资基金第一个保本周期到期安排及转型为易方达丰华债券型证券投资基金相关业务规则的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-03
2	易方达保本一号混合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	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-03
3	易方达保本一号混合型证券投资基金第一个保本周期到期安排及转型为易方达丰华债券型证券投资基金相关业务规则的第一次提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-09
4	易方达基金管理有限公司关于易方达保本一号混合型证券投资基金在选择期开放转换转出业务的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-11
5	易方达保本一号混合型证券投资基金第一个保本周期到期安排及转型为易方达丰华债券型证券投资基金相关业务规则的第二提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-14
6	易方达基金管理有限公司关于易方达保本一号混合型证券投资基金基金份额折算方案的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-01-30

7	易方达基金管理有限公司关于易方达丰华债券型证券投资基金基金合同生效的提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-01-30
8	易方达基金管理有限公司关于易方达丰华债券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	中国证券报及基金管理人网站	2019-02-15
9	易方达保本一号混合型证券投资基金转型后基金经理变更公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-02-19
10	易方达基金管理有限公司关于易方达保本一号混合型证券投资基金基金份额折算结果的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-02-20
11	易方达基金管理有限公司关于易方达丰华债券型证券投资基金增加肯特瑞基金为销售机构、参加肯特瑞基金费率优惠活动的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-03-01
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国信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、证券日报及基金管理人网站	2019-03-05
13	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报及基金管理人网站	2019-03-06
14	易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-13
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加利得基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-13
16	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-19
17	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-27
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加昆仑银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-03-29
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及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、证券日报及基金管理人网站	2019-03-30

20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加泉州银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-04-01
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加国盛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、证券日报及基金管理人网站	2019-04-12
22	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加四川天府银行手机银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-04-30
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加齐商银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-05-07
24	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民生银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-05-16
25	易方达基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-05-28
26	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、上海证券报及基金管理人网站	2019-06-19
27	易方达基金管理有限公司关于调整转换业务货币市场基金未付收益支付规则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-06-20
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于科创板股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2019-06-22
29	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加德邦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、证券日报及基金管理人网站	2019-06-24

## 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保本一号混合型证

券投资基金变更注册为易方达丰华债券型证券投资基金的文件；

2. 易方达保本一号混合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. 《易方达丰华债券型证券投资基金基金合同》；
4. 《易方达丰华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。

## 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

二〇一九年八月二十四日