

易方达富华纯债债券型证券投资基金  
(原易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金转型)

2020年第4季度报告

2020年12月31日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十一日

## §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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月19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2020年12月28日起原易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金转型为易方达富华纯债债券型证券投资基金。原易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金本报告期自2020年10月1日至2020年12月27日止，易方达富华纯债债券型证券投资基金本报告期自2020年12月28日至2020年12月31日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 易方达富华纯债债券型证券投资基金

基金简称	易方达富华纯债债券
基金主代码	000833
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月28日
报告期末基金份额总额	36,156,883.86份
投资目标	本基金为纯债基金，管理人主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
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

	理。本基金可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上，选择投资价值较高的资产支持证券进行投资。本基金将在对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率和融资成本，判断利差空间，力争通过息差策略提高组合收益。在衍生品投资上，本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。	
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达富华纯债债券 C	易方达富华纯债债券 A
下属分级基金的交易代码	000833	005099
报告期末下属分级基金的份额总额	36,149,166.41 份	7,717.45 份

注：本基金A类基金份额由原易方达掌柜季季盈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掌柜季季盈理财债券型证券投资基金A类基金份额和C类基金份额转型而来。

## 2.2 易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

基金简称	易方达掌柜季季盈理财债券
基金主代码	000833
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 15 日

报告期末基金份额总额	34,395,762.74 份		
投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金将对基金资产组合进行积极管理，在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，力争获得高于业绩比较基准的投资回报，主要投资策略包括银行存款及同业存单投资策略、利率品种的投资策略、信用品种的投资策略、债券回购投资策略、其他金融工具投资策略。		
业绩比较基准	中国人民银行公布的三个月银行定期整存整取存款利率（税后）		
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、混合型基金和投资期限较长的债券型基金。		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	易方达掌柜季季盈理财债券 A	易方达掌柜季季盈理财债券 B	易方达掌柜季季盈理财债券 C
下属分级基金的交易代码	000833	005099	005100
报告期末下属分级基金的份额总额	33,981,299.44 份	125,459.34 份	289,003.96 份

注：自2017年9月5日起，本基金增设B类、C类份额类别，C类份额首次确认日为2017年9月6日，B类份额首次确认日为2017年9月14日。

### §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 易方达富华纯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 (2020 年 12 月 28 日 (基金合同生效日) -2020 年 12 月 31 日)	
	易方达富华纯债债券 C	易方达富华纯债债券 A
1.本期已实现收益	40,031.68	21.23
2.本期利润	45,136.17	136.12
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0013	0.0021
4.期末基金资产净值	36,196,621.66	7,677.29
5.期末基金份额净值	1.0013	0.9948

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 2020 年 12 月 28 日起原易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金转型为易方达富华纯债债券型证券投资基金,易方达富华纯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 易方达掌柜季季盈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 (2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 27 日)		
	易方达掌柜季季盈 理财债券 A	易方达掌柜季季盈 理财债券 B	易方达掌柜季季盈 理财债券 C
1.本期已实现收益	339,683.97	476,278.30	2,821.77
2.本期利润	339,683.97	476,278.30	2,821.77
3.期末基金资产净值	33,981,299.44	125,459.34	289,003.96

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 易方达富华纯债债券型证券投资基金

（报告期：2020年12月28日-2020年12月31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

###### 易方达富华纯债债券 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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.13%	0.05%	0.18%	0.03%	-0.05%	0.02%

###### 易方达富华纯债债券 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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-

自基金合同生效起至今	-0.52%	0.35%	0.18%	0.03%	-0.70%	0.32%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

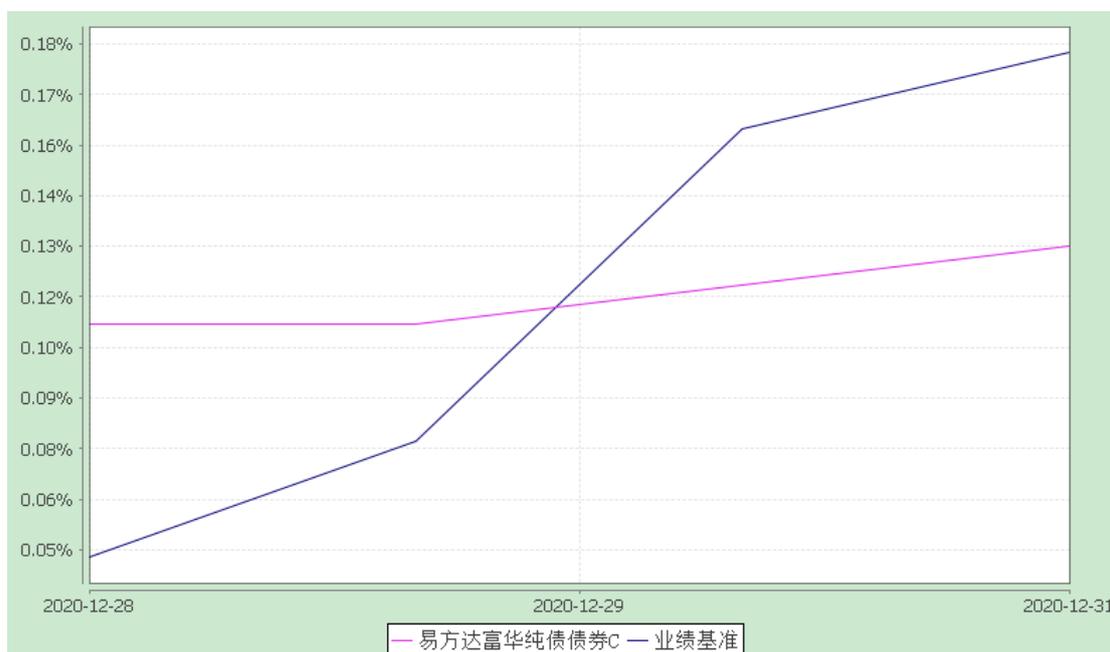
### 3.2.1.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达富华纯债债券型证券投资基金

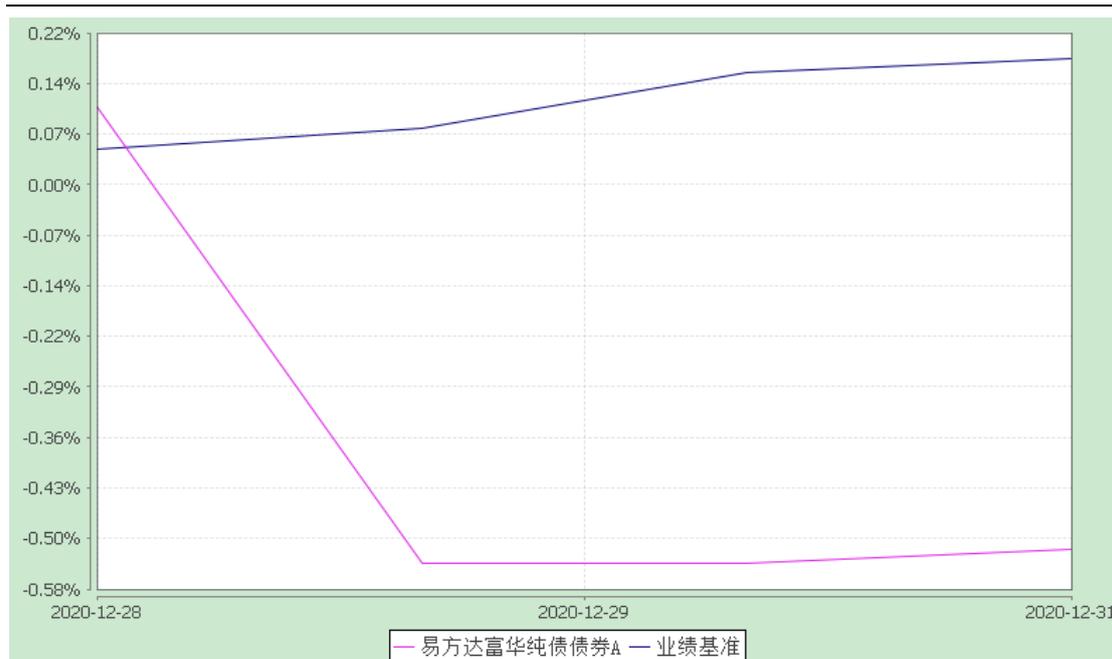
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 12 月 28 日至 2020 年 12 月 31 日)

#### 易方达富华纯债债券 C



#### 易方达富华纯债债券 A



注：1.本基金由原易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金于2020年12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-0.52%，C类基金份额净值增长率为0.13%，同期业绩比较基准收益率为0.18%。

### 3.2.2 易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

（报告期：2020年10月1日-2020年12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

##### 易方达掌柜季季盈理财债券 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	0.9232%	0.0119%	0.2692%	0.0000%	0.6540%	0.0119%
过去六个月	1.8294%	0.0198%	0.5515%	0.0000%	1.2779%	0.0198%
过去一年	3.0759%	0.0141%	1.1122%	0.0000%	1.9637%	0.0141%
过去三年	10.2209%	0.0083%	3.3929%	0.0000%	6.8280%	0.0083%

过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.8980%	0.0077%	4.0267%	0.0000%	8.8713%	0.0077%

### 易方达掌柜季季盈理财债券 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	0.9566%	0.0119%	0.2692%	0.0000%	0.6874%	0.0119%
过去六个月	1.8988%	0.0198%	0.5515%	0.0000%	1.3473%	0.0198%
过去一年	3.2181%	0.0141%	1.1122%	0.0000%	2.1059%	0.0141%
过去三年	10.6827%	0.0083%	3.3929%	0.0000%	7.2898%	0.0083%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.1645%	0.0080%	3.7378%	0.0000%	8.4267%	0.0080%

### 易方达掌柜季季盈理财债券 C

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	0.9476%	0.0119%	0.2692%	0.0000%	0.6784%	0.0119%
过去六个月	1.8797%	0.0198%	0.5515%	0.0000%	1.3282%	0.0198%
过去一年	3.1780%	0.0141%	1.1122%	0.0000%	2.0658%	0.0141%
过去三年	10.5509%	0.0083%	3.3929%	0.0000%	7.1580%	0.0083%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.1312%	0.0080%	3.7632%	0.0000%	8.3680%	0.0080%

注：过去三个月：2020年10月1日-2020年12月27日；

过去六个月：2020年7月1日-2020年12月27日；

过去一年：2020年1月1日-2020年12月27日；

过去三年：2018年1月1日-2020年12月27日；

过去五年：2016年1月1日-2020年12月27日。

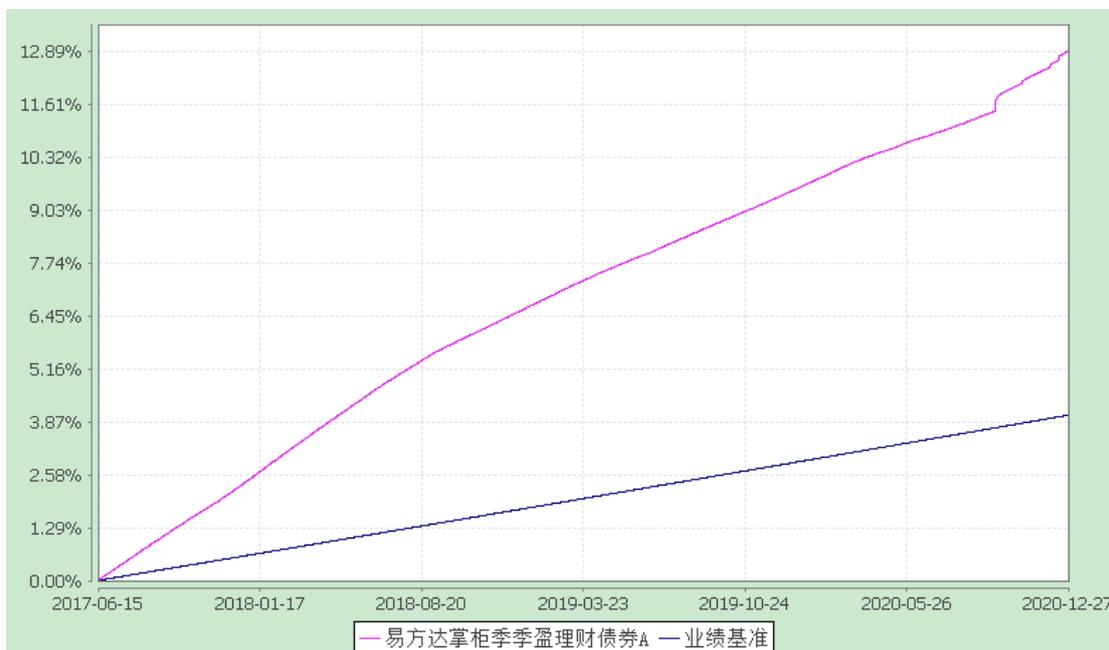
### 3.2.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达掌柜季季盈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

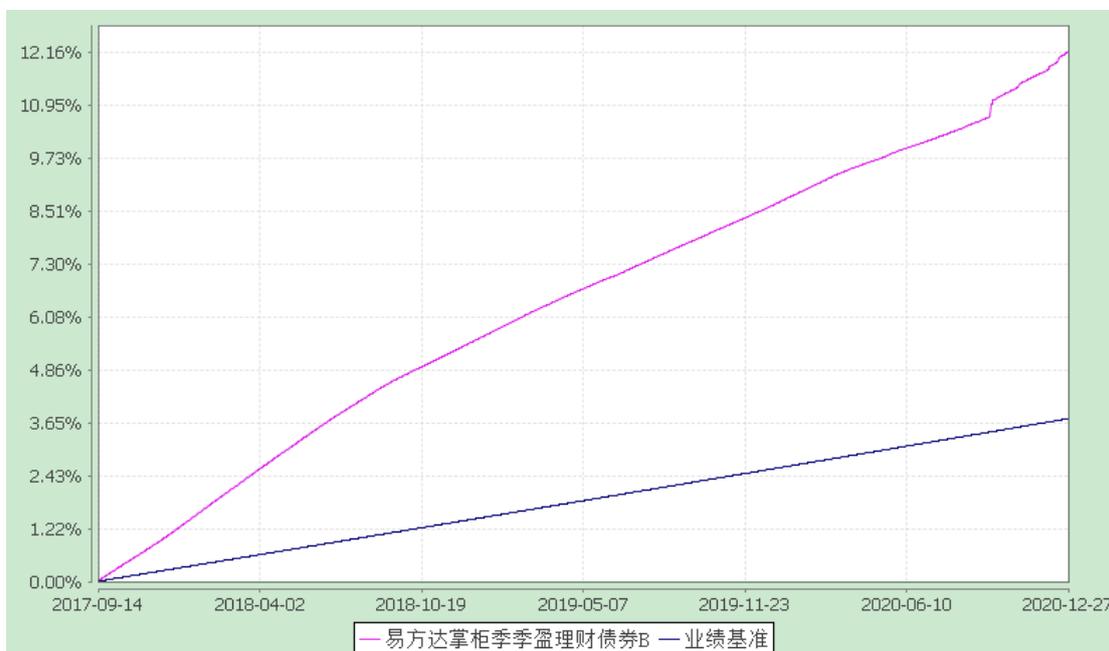
易方达掌柜季季盈理财债券 A

(2017 年 6 月 15 日至 2020 年 12 月 27 日)



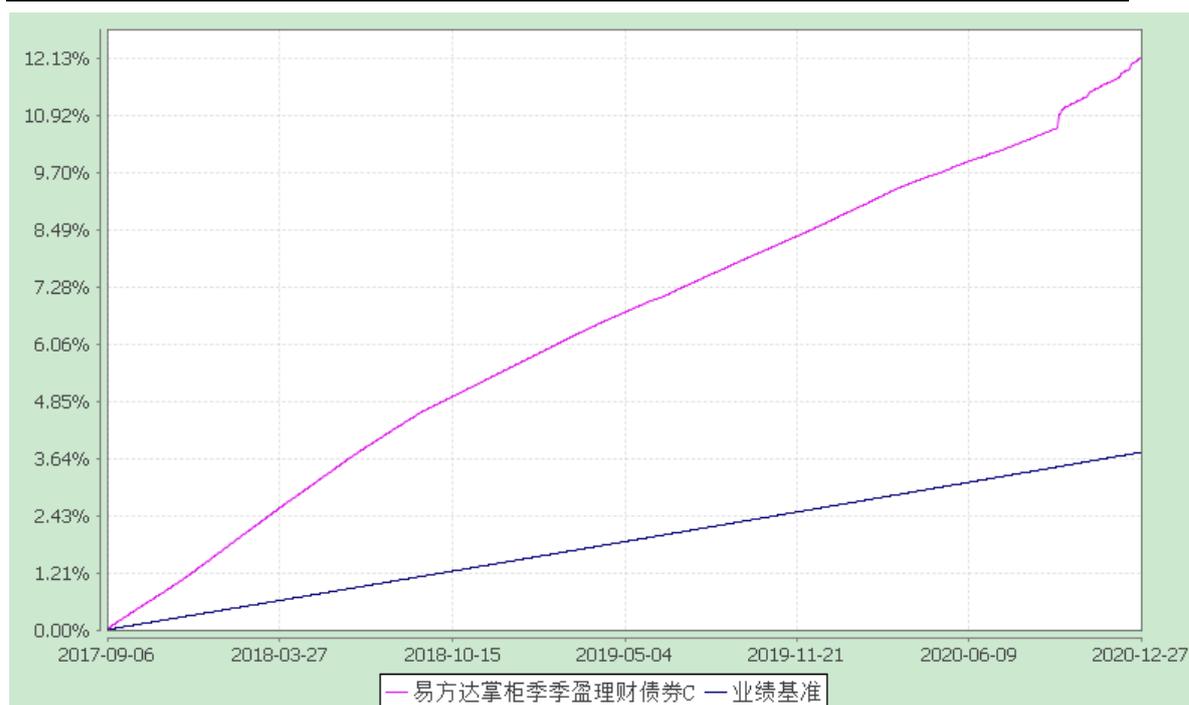
易方达掌柜季季盈理财债券 B

(2017 年 9 月 14 日至 2020 年 12 月 27 日)



易方达掌柜季季盈理财债券 C

(2017 年 9 月 6 日至 2020 年 12 月 27 日)



注：1.自2017年9月5日起，本基金增设B类、C类份额类别，C类份额首次确认为2017年9月6日，B类份额首次确认为2017年9月14日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至2020年12月27日，A类基金份额净值收益率为12.8980%，同期业绩比较基准收益率为4.0267%。B类基金份额净值收益率为12.1645%，同期业绩比较基准收益率为3.7378%。C类基金份额净值收益率为12.1312%，同期业绩比较基准收益率为3.7632%。

## §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		
石大怵	原易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达安瑞短债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（自	2017-06-15	2020-12-28	11年	硕士研究生，具有基金从业资格。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、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理。

	2017年08月29日至2020年12月06日)、易方达天天发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、易方达龙宝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、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、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、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、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				
梁莹	原易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达安和中短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理(自2017年08月29日至2020年12月06日)、易方达保证金收益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、易方达财富快线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、易方达增金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助理、易方达天天理财货	2017-07-11	2020-12-28	10年	硕士研究生,具有基金从业资格。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、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理。

	币市场基金的基金经理助理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理、易方达天天发货币市场基金的基金经理助理、投资经理、易方达资产管理(香港)有限公司基金经理				
藏海涛	本基金的基金经理、易方达恒智63个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒茂39个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒久添利1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固定收益全策略投资部副总经理、投资经理	2020-12-28	-	15年	硕士研究生,具有基金从业资格。曾任中央外汇业务中心投资部投资经理,泰康资产管理有限责任公司固定收益部投资经理,天安财产保险股份有限公司投资部固定收益负责人,易方达基金管理有限公司固定收益投资部总经理助理。

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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。

#### 1.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
藏海涛	公募基金	4	17,353,219,048.26	2020-02-29
	私募资产管理计划	2	805,952,855.92	2018-10-12
	其他组合	0	0.00	-
	合计	6	18,159,171,904.18	-

注:1.“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2.报告期内,藏海涛于2020年12月3日离任1个私募资产管理计划,藏海涛管理的1个私募资产管理计划于2020年12月30日终止。

#### 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 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32次，均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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，伴随着中国经济的继续恢复、超预期的信用风险冲击以及央行公开市场操作的节奏和幅度，债券收益率宽幅震荡调整，季末市场转暖，收益率开始下行。具体来看，10月份债券市场延续了前期市场特征，市场缺乏明确主线，交投清淡；后期因经济数据不及预期，市场解读为经济复苏的进程有所放缓，债市出现了自5月份以来的一波回暖。11月份，受大超市场预期永煤违约事件冲击，市场风险偏好骤降，部分信用债流动性冻结，信用债收益率大幅上行，因流动性紧张，利率短端上行幅度大于长端。至月末，国务院金融委对前期信用冲击的表态，市场情绪得以安抚，叠加12月以来央行超预期、大规模投放MLF，同时通过持续投放逆回购来呵护市场，资金面格局宽松，市场整体收益率转而快速下行，修复了前期跌幅。整个季度来看，10年期国债和国开债收益率分别下行4BP和23BP，信用债有所分化，高评级整体收益率下行，低评级收益率上行。

本基金2020年12月28日转型成立，转型前，基金配置以同业存款、同业存单、短期逆回购为主要配置资产，保持了适中的剩余期限，整体保持了较为稳定的收益率。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2020年12月31日,易方达富华纯债债券型证券投资基金A类基金份额净值为0.9948元,本报告期(2020年12月28日-2020年12月31日)份额净值增长率为-0.52%,同期业绩比较基准收益率为0.18%;C类基金份额净值为1.0013元,本报告期(2020年12月28日-2020年12月31日)份额净值增长率为0.13%,同期业绩比较基准收益率为0.18%。

原易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金本报告期内(2020年10月1日-2020年12月27日)A类基金份额净值收益率为0.9232%,同期业绩比较基准收益率为0.2692%;B类基金份额净值收益率为0.9566%,同期业绩比较基准收益率为0.2692%;C类基金份额净值收益率为0.9476%,同期业绩比较基准收益率为0.2692%。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 易方达富华纯债债券型证券投资基金

(报告期:2020年12月28日-2020年12月31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	29,885,000.00	74.82
	其中:债券	29,885,000.00	74.82
	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	5,000,000.00	12.52
	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	4,657,910.69	11.66

7	其他资产	397,611.50	1.00
8	合计	39,940,522.19	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	19,876,000.00	54.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,009,000.00	27.65
	其中：政策性金融债	10,009,000.00	27.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,885,000.00	82.55

#### 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	209950	20 贴现国债 50	200,000	19,876,000.00	54.90
2	160206	16 国开 06	100,000	10,009,000.00	27.65

#### 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	360,505.27
5	应收申购款	37,106.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	397,611.50

#### 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 易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

(报告期：2020年10月1日-2020年12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	33,893,699.84	97.61
	其中：债券	33,893,699.84	97.61
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	829,698.38	2.39
4	其他资产	50.63	0.00
5	合计	34,723,448.85	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	0.20	
	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	32
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

#### 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	60.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	28.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	11.55	-
	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）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.95	-

#### 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	19,971,004.47	58.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	13,922,695.37	40.48
8	其他	-	-
9	合计	33,893,699.84	98.54
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	209950	20 贴现国债 50	200,000	19,971,004.47	58.06
2	112009039	20 浦发银行 CD039	50,000	4,975,979.78	14.47
3	112006020	20 交通银行 CD020	50,000	4,974,290.16	14.46
4	112004060	20 中国银行 CD060	40,000	3,972,425.43	11.55

#### 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	13次
报告期内偏离度的最高值	0.3366%
报告期内偏离度的最低值	0.0382%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1669%
------------------------	---------

### 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 报告期末按摊余成本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	-
3	应收利息	50.63
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	50.63

## §6 开放式基金份额变动

### 6.1 易方达富华纯债债券型证券投资基金

单位：份

项目	易方达富华纯债债券C	易方达富华纯债债券A
基金合同生效日基金份额总额	34,270,303.40	125,459.34
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,822,340.31	7,215.95
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	943,477.30	124,957.84
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）	-	-
本报告期期末基金份额总额	36,149,166.41	7,717.45

注：本基金A类基金份额由原易方达掌柜季季盈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掌柜季季盈理财债券型证券投资基金A类基金份额和C类基金份额转型而来，基金合同于2020年12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 易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

单位：份

项目	易方达掌柜季季盈理财债券A	易方达掌柜季季盈理财债券B	易方达掌柜季季盈理财债券C
本报告期期初基金份额总额	37,596,269.57	53,703,025.63	302,672.01

报告期基金总申购份 额	339,683.97	88,476,278.30	2,821.77
减：报告期基金总赎回 份额	3,954,654.10	142,053,844.59	16,489.82
本报告期期末基金份 额总额	33,981,299.44	125,459.34	289,003.96

注：自 2020 年 12 月 28 日起原易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金转型为易方达富华纯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 易方达富华纯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 易方达掌柜季季盈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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 易方达富华纯债债券型证券投资基金

#### 8.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

### 8.2 易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

#### 8.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者 类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情 况	
	序号	持有基金份额 比例达到或者 超过20%的时	期初 份额	申购 份额	赎回份 额	持有份额	份额占 比

		间区间					
机构	1	2020年11月12日~2020年12月06日	-	88,124,957.84	88,000,000.00	124,957.84	0.36%
	2	2020年10月01日~2020年12月01日	53,442,826.89	557,224.54	54,000,051.43	-	0.00%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

### 8.2.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金基金合同》约定，易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《资管新规》”）等法律法规规定在《资管新规》规定的过渡期结束前进行整改规范。据此，基金管理人于2020年10月28日发布《易方达基金管理有限公司关于召开易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，并于2020年11月28日发布《易方达掌柜季季盈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》，自2020年12月28日起，“易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金”更名为“易方达富华纯债债券型证券投资基金”，《易方达富华纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金基金合同》同日失效。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金变更注

册的批复;

- 2、《易方达富华纯债债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《易方达富华纯债债券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。

## 9.2 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。

## 9.3 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

二〇二一年一月二十一日