

# 易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金

## 2021 年第 2 季度报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 16 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。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 易方达磐固六个月持有混合  |
| 基金主代码      | 009900  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2020 年 9 月 3 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 5,705,864,511.61 份  |
| 投资目标       | 本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。   |
| 投资策略       | 1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的配置比例。2、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；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资；本基金投资资产支持证券将采 |

|                 |   |                  |
|-----------------|---|------------------|
|                 | 取自上而下和自下而上相结合的投资策略；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。3、本基金将在行业分析、公司基本面分析及估值水平分析的基础上，进行股票组合的构建。4、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。5、本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货、股票期权合约进行交易,以对冲投资组合的风险等。 |                  |
| 业绩比较基准          | 中债新综合指数（财富）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%   |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。  |                  |
| 基金管理人           | 易方达基金管理有限公司   |                  |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司  |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 易方达磐固六个月持有混合 A  | 易方达磐固六个月持有混合 C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 009900  | 009901           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,988,657,941.34 份  | 717,206,570.27 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

|        |   |
|--------|---|
| 主要财务指标 | 报告期<br>(2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |
|--------|---|

|                | 易方达磐固六个月持有混合 A   | 易方达磐固六个月持有混合 C |
|----------------|------------------|----------------|
| 1.本期已实现收益      | 62,855,307.80    | 7,869,079.18   |
| 2.本期利润         | 147,981,907.54   | 20,145,045.05  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0267           | 0.0247         |
| 4.期末基金资产净值     | 5,231,940,655.31 | 748,447,753.90 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0488           | 1.0436         |

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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

##### 易方达磐固六个月持有混合 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      | 2.63%  | 0.17%     | 1.45%      | 0.10%         | 1.18% | 0.07% |
| 过去六个月      | 4.39%  | 0.28%     | 1.95%      | 0.14%         | 2.44% | 0.14% |
| 过去一年       | -      | -         | -          | -             | -     | -     |
| 过去三年       | -      | -         | -          | -             | -     | -     |
| 过去五年       | -      | -         | -          | -             | -     | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 6.92%  | 0.22%     | 3.93%      | 0.13%         | 2.99% | 0.09% |

##### 易方达磐固六个月持有混合 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

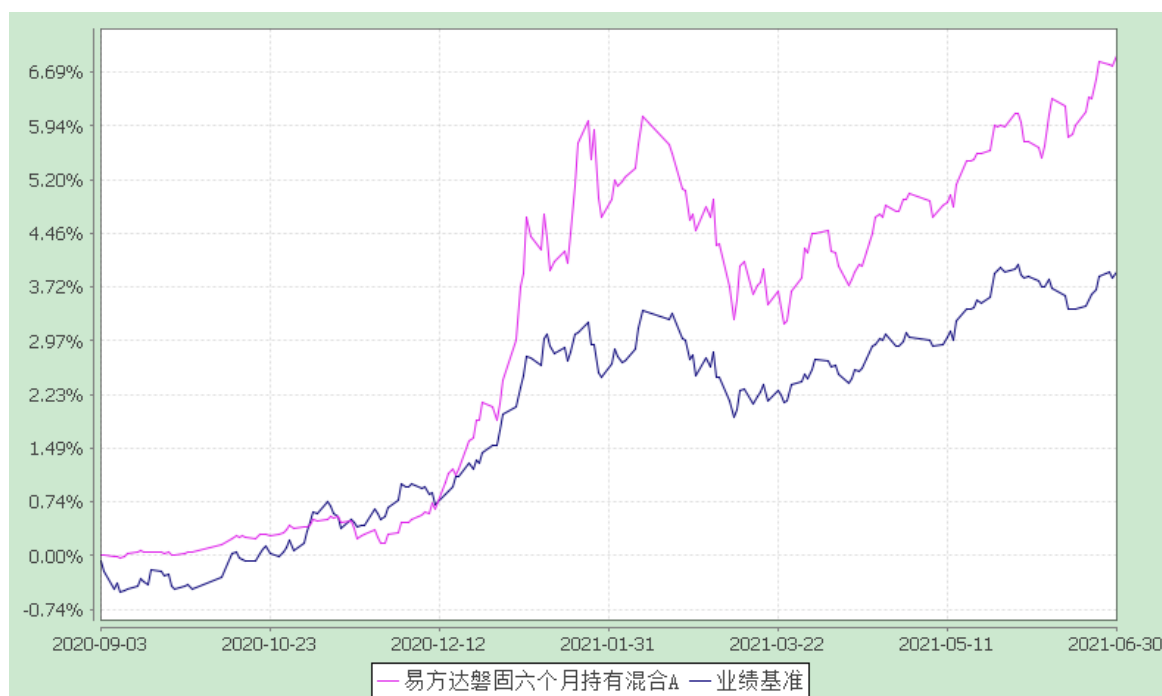
|            |       |       |       |       |       |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去三个月      | 2.48% | 0.17% | 1.45% | 0.10% | 1.03% | 0.07% |
| 过去六个月      | 4.08% | 0.28% | 1.95% | 0.14% | 2.13% | 0.14% |
| 过去一年       | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| 过去三年       | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| 过去五年       | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 6.40% | 0.22% | 3.93% | 0.13% | 2.47% | 0.09% |

### 3.2.2 自基金合同生效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

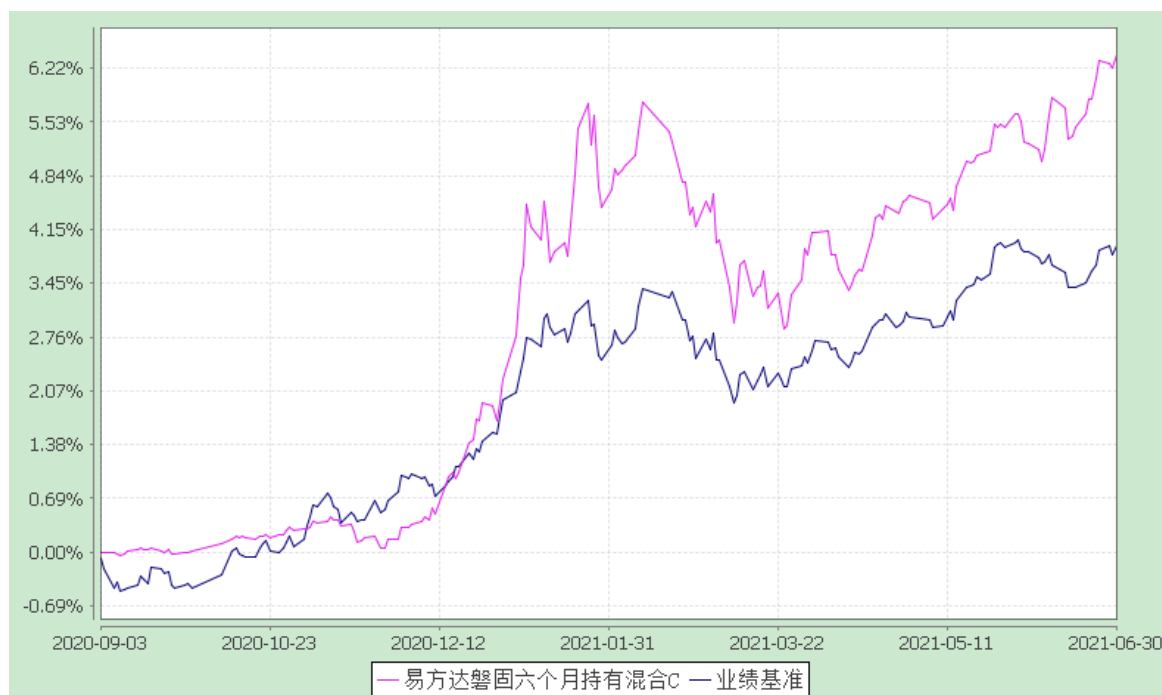
易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 9 月 3 日至 2021 年 6 月 30 日)

易方达磐固六个月持有混合 A



易方达磐固六个月持有混合 C



注：1.本基金合同于 2020 年 9 月 3 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 6.92%，C 类基金份额净值增长率为 6.40%，同期业绩比较基准收益率为 3.93%。

## § 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 |        |  |
| 张清华 | 本基金的基金经理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经 | 2020-09-03  | -    | 14 年   | 硕士研究生，具有基金从业资格。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 |

|     |   |            |   |     |  |
|-----|---|------------|---|-----|--|
|     | 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、易方达安盈回报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、易方达裕祥回报债券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、易方达裕丰回报债券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、副总经理级高级管理人员、多资产投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员 |            |   |     | 投资经理、固定收益基金投资部总经理、混合资产投资部总经理、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、易方达瑞选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、易方达瑞通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、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金基金经理。 |
| 李中阳 | 本基金的基金经理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、研究员   | 2021-05-19 | - | 6 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中信证券股份有限公司研究部研究员。   |

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。

## 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 12 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

债券市场方面，二季度收益率呈现震荡下行的走势。4-5 月流动性环境相对宽松，市场担忧的地方债供给加速迟迟没有出现，同时信用市场的一级供给也弱于往年同期水平。在机构杠杆与久期水平普遍偏低的情况下，“资产荒”使得机构的配置需求较为旺盛。6 月初开始，地方债供给开始增多，资金价格上行，引发市场对流动性的担忧，同时债券在经历前期上涨后赔率有所下降，收益率小幅回调。但在央行持续表态维持流动性稳定的背景下，叠加 5 月经济数据表现偏弱，债券收益率再次下行，并持续到季末。整个季度来看，经济修复进程中内外需分化明显，内需修复高度不及预期，市场对后续基本面走势出现较大分歧，流动性成为短期债券市场的重要主导因素。流动性持续宽松推动收益率曲线陡峭化下行，1Y 和 10Y 国开债分别较一季度末下行 25bp



和 8bp，高等级信用债走势基本跟随无风险利率，而机构的配置需求推动流动性溢价品种利差持续压缩。

权益市场方面，二季度指数震荡上行，但结构分化明显。4 月流动性超预期宽松推动前期调整幅度较大的机构重仓股走出了一轮估值修复行情。5 月初开始，市场关注点逐步从流动性切换到企业盈利，基本面高增长板块取得了显著的超额收益。市场风格从周期向成长切换，并持续至半年末。

报告期内，本基金规模保持稳定。股票方面，随市场反弹逐步止盈涨幅较多的个股，仓位回归中性，行业配置较为均衡。债券方面，久期和杠杆水平提升至中性，持仓同业存单与高等级信用债以获取票息收益，同时择机参与利率债波段操作。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0488 元，本报告期份额净值增长率为 2.63%，同期业绩比较基准收益率为 1.45%；C 类基金份额净值为 1.0436 元，本报告期份额净值增长率为 2.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.45%。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 760,224,502.20   | 10.29        |
|    | 其中：股票             | 760,224,502.20   | 10.29        |
| 2  | 固定收益投资            | 6,368,896,413.26 | 86.17        |
|    | 其中：债券             | 6,102,080,613.26 | 82.56        |
|    | 资产支持证券            | 266,815,800.00   | 3.61         |
| 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 | 88,189,401.67    | 1.19   |
| 7 | 其他资产         | 173,674,901.96   | 2.35   |
| 8 | 合计           | 7,390,985,219.09 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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         | 5,439.50       | 0.00         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 642,261,824.28 | 10.74        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,151,678.21   | 0.09         |
| E  | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 82,472.34      | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 12,230.40      | 0.00         |
| J  | 金融业              | 87,850,095.30  | 1.47         |
| 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       | 21,833,813.47  | 0.37         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 36,272.33      | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 2,965,305.00   | 0.05         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 760,224,502.20 | 12.71        |

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）        | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|----------------------|
| 1  | 002415 | 海康威视 | 1,969,500 | 127,032,750.00 | 2.12                 |
| 2  | 603806 | 福斯特  | 1,007,394 | 105,907,331.22 | 1.77                 |
| 3  | 601012 | 隆基股份 | 1,050,932 | 93,364,798.88  | 1.56                 |
| 4  | 000858 | 五粮液  | 171,000   | 50,939,190.00  | 0.85                 |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 840,180   | 45,529,354.20  | 0.76                 |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 20,700    | 42,573,690.00  | 0.71                 |
| 7  | 300014 | 亿纬锂能 | 400,000   | 41,572,000.00  | 0.70                 |
| 8  | 000661 | 长春高新 | 85,244    | 32,989,428.00  | 0.55                 |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 447,100   | 31,909,527.00  | 0.53                 |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 1,325,000 | 29,971,500.00  | 0.50                 |

#### 5.4 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<br>净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|------------------|
| 1  | 国家债券      | 79,608,000.00    | 1.33             |
| 2  | 央行票据      | -                | -                |
| 3  | 金融债券      | 937,942,000.00   | 15.68            |
|    | 其中：政策性金融债 | 937,942,000.00   | 15.68            |
| 4  | 企业债券      | 1,430,525,000.00 | 23.92            |
| 5  | 企业短期融资券   | 601,833,000.00   | 10.06            |
| 6  | 中期票据      | 1,949,019,000.00 | 32.59            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 34,783,613.26    | 0.58             |
| 8  | 同业存单      | 1,068,370,000.00 | 17.86            |
| 9  | 其他        | -                | -                |
| 10 | 合计        | 6,102,080,613.26 | 102.03           |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金<br>资产净<br>值比例 |
|----|------|------|-------|---------|-------------------|
|----|------|------|-------|---------|-------------------|

|   |           |                  |           |                | (%)   |
|---|-----------|------------------|-----------|----------------|-------|
| 1 | 210205    | 21 国开 05         | 6,200,000 | 627,750,000.00 | 10.50 |
| 2 | 210201    | 21 国开 01         | 3,000,000 | 300,180,000.00 | 5.02  |
| 3 | 112108078 | 21 中信银行<br>CD078 | 2,000,000 | 194,260,000.00 | 3.25  |
| 4 | 112103022 | 21 农业银行<br>CD022 | 2,000,000 | 194,240,000.00 | 3.25  |
| 5 | 112107047 | 21 招商银行<br>CD047 | 2,000,000 | 194,220,000.00 | 3.25  |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

| 序号 | 证券代码   | 证券名称      | 数量(份)   | 公允价值(元)       | 占基金资产净<br>值比例 (%) |
|----|--------|-----------|---------|---------------|-------------------|
| 1  | 169448 | 弘德 01A    | 680,000 | 68,074,800.00 | 1.14              |
| 2  | 169422 | 霄驰 01A    | 480,000 | 48,072,000.00 | 0.80              |
| 3  | 169310 | 兴辰 02A    | 400,000 | 40,040,000.00 | 0.67              |
| 4  | 169909 | 弘德 04A    | 300,000 | 30,111,000.00 | 0.50              |
| 5  | 169382 | 长治 02A    | 200,000 | 20,176,000.00 | 0.34              |
| 6  | 169736 | 玺悦 01 优   | 200,000 | 20,092,000.00 | 0.34              |
| 7  | 169889 | 蚁借 03A    | 100,000 | 10,106,000.00 | 0.17              |
| 8  | 169795 | 20 借 02A1 | 100,000 | 10,065,000.00 | 0.17              |
| 9  | 169272 | 博雅 1A     | 100,000 | 10,056,000.00 | 0.17              |
| 10 | 169646 | 天信 10A    | 100,000 | 10,023,000.00 | 0.17              |

#### 5.7 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。

#### 5.8 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。

#### 5.9 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。

#### 5.10 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。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2020 年 8 月 25 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中信银行的如下违法违规行为作出“给予警告，没收违法所得 14857527.66 元人民币，并处 1177.04 万元人民币罚款”的行政处罚决定：违规办理内保外贷业务；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金

收付；违反规定办理售汇业务；违反外汇账户管理规定。2020 年 11 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中信银行违反规定办理售汇业务的行为，没收违法所得 661782.53 元人民币，并处 40 万元人民币罚款。2021 年 2 月 5 日，中国人民银行对中信银行的如下违法违规行为罚款 2890 万元：1.未按规定履行客户身份识别义务；2.未按规定保存客户身份资料和交易记录；3.未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4.与身份不明的客户进行交易。2021 年 3 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对中信银行的如下违法违规行为罚款 450 万元：一、客户信息保护体制机制不健全；柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务操作流程与必要的内部控制措施，乱象整治自查不力；二、客户信息收集环节管理不规范；客户数据访问控制管理不符合业务“必须知道”和“最小授权”原则；查询客户账户明细事由不真实；未经客户本人授权查询并向第三方提供其个人银行账户交易信息；三、对客户敏感信息管理不善，致其流出至互联网；违规存储客户敏感信息；四、系统权限管理存在漏洞，重要岗位及外包机构管理存在缺陷。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元”的行政处罚决定：（一）向关系人发放信用贷款；（二）批量处置不良资产未公告；（三）批量处置不良资产未向监管部门报告；（四）违规转让正常类贷款；（五）个人住房贷款首付比例违规；（六）流动资金贷款被用于固定资产投资；（七）超过实际需求发放流动资金贷款；（八）贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发；（九）贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；（十）承兑业务贸易背景审查不严；（十一）保理业务授权管理不到位；（十二）贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人；（十三）贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金；（十四）信贷资金用于兑付到期理财资产；（十五）信贷资金用于承接承销债券；（十六）销售非保本理财产品违规出具承诺函；（十七）提供与事实不符的报告；（十八）理财产品相互交易、相互调节收益；（十九）面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资；（二十）将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款；（二十一）开立同业银行结算账户不合规；（二十二）个别人员未经核准即履行高管人员职责；（二十三）对小微企业不当收费；（二十四）未按规定报送案件。2020 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万

元，罚没金额合计 198.36 万元”的行政处罚决定：农业银行收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）。2021 年 1 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行的如下违法违规行为罚款 420 万元：（一）发生重要信息系统突发事件未报告；（二）制卡数据违规明文留存；（三）生产网络、分行无线互联网络保护不当；（四）数据安全较粗放，存在数据泄露风险；（五）网络信息系统存在较多漏洞；（六）互联网门户网站泄露敏感信息。

2020 年 7 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对招商银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款共计 100 万元”的行政处罚决定：1.2019 年 7 月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2.2014 年 12 月至 2019 年 5 月，该中心对某信用卡申请人资信水平调查严重不审慎。2020 年 9 月 29 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司涉嫌违反法律法规的行为处以责令整改，并处以罚款人民币 120 万元。2020 年 11 月 27 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司违反规定办理结汇、售汇的行为，作出“责令改正、罚款人民币 55 万元，没收违法所得 128.82 万元人民币”的行政处罚决定。2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对招商银行股份有限公司的如下违法违规行为罚款 7170 万元：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、

理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对中国建设银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款合计 3920 万元”的行政处罚决定：（一）内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件；（二）理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；（三）逆流程开展业务操作；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）未做到理财业务与自营业务风险隔离；（六）个人理财资金违规投资；（七）违规为理财产品提供隐性担保；（八）同业投资违规接受担保。

2020 年 8 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司资金营运中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：2017 年 7 月至 2019 年 6 月，该中心黄金租赁业务严重违反审慎经营规则。2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元”的行政处罚决定：同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款”的行政处罚决定：1.为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2.为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3.违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4.违反银行卡收单外包管理规定；5.未按规定履行客户身份识别义务。2020 年 10 月 22 日，中国银行保险监督

管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：信用卡授信审批严重违反审慎经营规则。

本基金投资 21 中信银行 CD078、21 农业银行 CD022、21 招商银行 CD047、21 建设银行 CD063、21 兴业银行 CD138 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 21 中信银行 CD078、21 农业银行 CD022、21 招商银行 CD047、21 建设银行 CD063、21 兴业银行 CD138 外，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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 475,188.75     |
| 2  | 应收证券清算款 | 85,142,135.13  |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 88,057,578.08  |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 173,674,901.96 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1  | 132018 | G 三峡 EB1 | 20,437,216.80 | 0.34         |
| 2  | 110061 | 川投转债     | 7,555,503.20  | 0.13         |
| 3  | 110075 | 南航转债     | 2,023,998.30  | 0.03         |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。



## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 易方达磐固六个月<br>持有混合A | 易方达磐固六个月<br>持有混合C |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 4,789,928,995.09  | 852,608,206.18    |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 1,566,425,210.84  | 77,989,377.64     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 1,367,696,264.59  | 213,391,013.55    |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -                 | -                 |
| 报告期期末基金份额总额                   | 4,988,657,941.34  | 717,206,570.27    |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 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。

### 7.2 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。

## § 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磐固六个月持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 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

二〇二一年七月二十日