易方达双债增强债券型证券投资基金

2021 年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

§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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 18
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.12 投资组合报告附注 43

§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 46
§9 开放式基金份额变动 47
§10 重大事件揭示 47
10.1 基金份额持有人大会决议 47
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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
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 48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 48
10.8 其他重大事件 50
§11 备查文件目录 51
11.1 备查文件目录 51
11.2 存放地点 51
11.3 查阅方式 52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达双债增强债券型证券投资基金	
基金简称	易方达双债增强债券	
基金主代码	110035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 12 月 1 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,883,678,304.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达双债增强债券 A	易方达双债增强债券 C
下属分级基金的交易代码	110035	110036
报告期末下属分级基金的份额总额	1,208,111,209.63 份	675,567,094.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于信用债、可转债等固定收益品种，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供持续稳定的回报。
投资策略	本基金根据对基本面因素的分析，以及对不同资产的风险收益特征及相关关系进行研究，确定大类资产配置比例；通过对信贷水平、信用利差水平、信用债市场供求关系等因素进行分析，进行信用债投资；通过对转股溢价率、隐含波动率、对应正股的市场走势、供求关系等因素进行分析，投资可转债；综合考虑组合收益、利率风险以及流动性，投资于利率品种；综合考虑新股估值水平、中签率、上市后的平均涨幅等因素，决定新股申购投资。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。
业绩比较基准	中债企业债总全价指数收益率*40%+天相可转债指数收益率*40%+中债国债总全价指数收益率*20%
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低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102

负责人	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637111
传真		020-38798812	021-60635778
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）	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）**	
	易方达双债增强债券 A	易方达双债增强债券 C
本期已实现收益	46,723,797.66	21,001,953.25
本期利润	132,978,504.29	112,365,175.18
加权平均基金份额本期利润	0.1342	0.1559
本期加权平均净值利润率	7.61%	9.19%
本期基金份额净值增长率	8.99%	8.77%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	易方达双债增强债券 A	易方达双债增强债券 C
期末可供分配利润	636,667,802.73	316,732,243.40
期末可供分配基金份额利润	0.5270	0.4688
期末基金资产净值	2,255,402,414.18	1,215,157,876.12
期末基金份额净值	1.867	1.799
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2021 年 6 月 30 日)**	
	易方达双债增强债券 A	易方达双债增强债券 C
基金份额累计净值增长率	113.05%	105.61%

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达双债增强债券 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	1.58%	0.36%	-0.02%	0.14%	1.60%	0.22%
过去三个月	7.48%	0.32%	1.91%	0.12%	5.57%	0.20%
过去六个月	8.99%	0.54%	1.90%	0.19%	7.09%	0.35%
过去一年	14.89%	0.57%	3.97%	0.22%	10.92%	0.35%
过去三年	48.76%	0.49%	15.39%	0.21%	33.37%	0.28%
自基金合同生效起至今	113.05%	0.31%	14.40%	0.47%	98.65%	-0.16%

易方达双债增强债券 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	1.58%	0.36%	-0.02%	0.14%	1.60%	0.22%
过去三个月	7.34%	0.33%	1.91%	0.12%	5.43%	0.21%
过去六个月	8.77%	0.55%	1.90%	0.19%	6.87%	0.36%
过去一年	14.44%	0.57%	3.97%	0.22%	10.47%	0.35%
过去三年	47.34%	0.49%	15.39%	0.21%	31.95%	0.28%
自基金合同生效起至今	105.61%	0.31%	14.40%	0.47%	91.21%	-0.16%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达双债增强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

（2011 年 12 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）

易方达双债增强债券 A

易方达双债增强债券 C

注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 113.05%，C 类基金份额净值增长率为 105.61%，同期业绩比较基准收益率为 14.40%。

§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，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、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，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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	本基金的基金经理、易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经	2016-12-03	-	18 年	硕士研究生，具有基金从业资格。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

	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、易方达投资级信用债债券型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、固定收益全策略投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员，易方达资产管理（香港）有限公司就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、基金经理				金投资部副总经理、固定收益投资部副总经理、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、易方达保本一号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、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金基金经理、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基金经理、易方达中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理、易方达中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理、易方达中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。
胡文伯	本基金的基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 07 月 31 日至 2021 年 06 月 09 日）、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 11 月 15 日至 2021 年 02 月 10 日）、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 11 月 23 日至 2021 年 02 月 10 日）、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 11 月 23 日至 2021 年 02 月 10 日）、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 11 月 23 日至 2021 年 02 月 10 日）、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达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、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券	2020-10-16	-	7 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员。

	投资基金的基金经理助理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达年年恒夏纯债一年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、易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达恒利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达安源中短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达富惠纯债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、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理助理				
张凯頔	本基金的基金经理助理、易方达稳健回报一年封闭运作混合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、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理助理（自 2016 年 09 月 09 日至 2021 年 02 月 10 日）、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、易方达增强回报债券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、易方达中债 3-5 年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 年政策	2016-03-16	-	10 年	硕士研究生，具有基金从业资格。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。

	性金融债指数证券投资基金的基金经理助理、易方达中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理助理、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、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、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞通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、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达平稳增长证券投资基金的基金经理助理、易方达稳健增长混合型证券投资基金的基金经理助理				

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/基金经理助理，“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。

3.为加强基金流动性管理，本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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 15 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年全球经济增长仍在复苏通道中，中国经济持续恢复。需求方面，出口实现较快增长，显示全球总需求仍在恢复。基建投资保持低位，制造业投资持续向好，地产呈现较强韧性。消费恢复态势进一步增强，但弹性受限，接触型消费恢复进程仍受到散发疫情影响，汽车销售增速回落较大。社融环比增速持续在偏低水平，信用扩张不足。但银行表内信贷数据相对稳健、企业和居民中长期贷款数据持续表现较好，显示经济微观主体的资金需求不弱。

流动性和供给方面，地方政府债上半年发行进度显著低于预期和往年同期，市场流动性整体呈中性偏宽松态势，局部略有波动但整体表现平稳。上半年债券市场整体呈现震荡、慢牛行情，债牛走得非常犹豫和缓慢。

股票市场方面，上半年整体先涨后跌再涨，呈现震荡走势，创业板表现好于主板，新能源、芯片等板块表现较好。年初至半年末，上证指数上涨 5.18%，上证 50 指数下跌 2.11%，沪深 300 指数上涨 2.16%，创业板指数上涨 19.88%。

转债市场方面，上半年经历了信用风险和期权价值主导市场的两种情形，年初信用风险主导，大量低价券出现大幅杀跌，随后随着期权价值的回归，低价券快速反弹。转债市场受益于权益市场波动率的提升，期权价值提升，整体中证转债指数涨幅 4.04%。

报告期内本基金仍然维持高仓位在转债市场，年初高仓位在低价转债策略上，二季度结构上调整至更均衡的状态。纯债部分将继续维持偏低的久期和组合杠杆，保持组合流动性。权益部分继续重点关注定增以及可转债中优质个股的转股配置机会。可转债为组合贡献了主要的正收益。

4.4.2 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 1.867 元，本报告期份额净值增长率为 8.99%，同期业绩比较基准收益率为 1.90%；C 类基金份额净值为 1.799 元，本报告期份额净值增长率为 8.77%，同期业绩比较基准收益率为 1.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球疫情仍在不断演变，外部环境存在比较多的不确定、不稳定因素，中美贸易冲突、美联储货币政策变化等对国内政策和资本市场仍存在一定影响，如何巩固好国内经济恢复的成果、应对好外部带来的不确定冲击可能是未来政策的主要目标。鉴于上半年财政支出进度较为落后，对经济担忧的预期有所增加，下半年稳增长的力度预计有所增强，支持投资恢复的有利因素在增多，财政支出加快对于经济的边际拉动作用逐步显现，迟来的地方债发行也将平衡债券市场上半年明显不平衡的供需环境。从收益率的角度看，目前的债券收益率已处于历史较低水平，需要警惕是否隐含了较多或者在一定程度上透支了对经济的悲观预期，关注债券市场波动带来的投资机会。

对于权益市场，无论是盈利和整体流动性都存在不确定性，下半年权益市场延续前两年整体牛市的概率在下降，但仍存在结构性机会，未来主要寻找行业和个股的机会，重点配置一些经过历史数据验证优秀、行业地位高、竞争力强、护城河深、同时景气度向上、并且估值合理的优质标的。

转债市场，一方面受益于债券市场的宽松预期，转债估值会有一定支撑；另一方面取决于权益市场的波动，转债市场同样出现结构性机会的概率更大。当前转债市场已经基本完全由期权价值主导，信用风险不再定价，低价券策略进入止盈区间，转债更好的超额收益来源可能来自于平衡型转债以及类权益的投资，一些正股估值合理或者偏低的转债，仍然有较好配置价值。

基于以上判断，本基金将降低整体转债仓位，同时更精选风险收益比更优质的转债个券配置。债券部分将维持中性的久期和组合杠杆，保持组合流动性。权益部分仓位不做大幅调整，仍重点关注定增以及可转债和可交换债中优质个股的转股配置机会。

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，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直接的重大利益冲突。

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

易方达双债增强债券 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达双债增强债券 C:本报告期内未实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达双债增强债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,893,153.73	37,421,086.39
结算备付金		14,964,656.08	100,061,689.14
存出保证金		222,246.74	206,678.30
交易性金融资产	6.4.7.2	3,896,373,102.79	3,870,823,256.39
其中：股票投资		165,173,873.23	159,357,934.67
基金投资		-	-
债券投资		3,731,199,229.56	3,711,465,321.72
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	11,970,125.99	119,770,379.66
应收证券清算款		13,000,536.74	37,308,854.32
应收利息	6.4.7.5	18,847,135.93	24,450,840.58
应收股利		-	-
应收申购款		18,922,179.53	3,840,301.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,976,193,137.53	4,193,883,086.09
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 6 月 30 日**	**上年度末 2020 年 12 月 31 日**
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		477,000,000.00	909,546,176.93
应付证券清算款		14,259,716.69	3,055,660.04
应付赎回款		10,814,720.49	49,234,301.35
应付管理人报酬		2,127,580.87	2,170,549.16
应付托管费		607,880.27	620,156.88
应付销售服务费		459,255.42	439,580.41
应付交易费用	6.4.7.7	36,417.81	198,643.12

应交税费		99,761.90	185,713.49
应付利息		-	-65,382.58
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	227,513.78	253,480.42
负债合计		505,632,847.23	965,638,879.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,883,678,304.47	1,907,793,334.13
未分配利润	6.4.7.10	1,586,881,985.83	1,320,450,872.74
所有者权益合计		3,470,560,290.30	3,228,244,206.87
负债和所有者权益总计		3,976,193,137.53	4,193,883,086.09

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.867 元，C 类基金份额净值 1.799 元；基金份额总额 1,883,678,304.47 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,208,111,209.63 份，C 类基金份额总额 675,567,094.84 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达双债增强债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		**267,519,108.24**	**-6,387,750.70**
1.利息收入		19,570,152.07	12,743,831.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	438,735.06	282,017.22
债券利息收入		18,998,408.03	12,459,336.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		133,008.98	2,478.10
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		67,561,169.70	48,546,737.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,834,134.21	-9,798,628.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	72,309,571.42	58,149,030.97
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,085,732.49	196,335.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.16	177,617,928.56	-72,309,573.11

填列）			
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,769,857.91	4,631,253.25
减：二、费用		**22,175,428.77**	**12,441,531.37**
1．管理人报酬		10,242,968.19	6,725,767.21
2．托管费		2,926,562.37	1,921,647.73
3．销售服务费		2,424,698.08	1,459,379.76
4．交易费用	6.4.7.18	291,331.51	212,232.62
5．利息支出		6,079,485.32	1,972,164.11
其中：卖出回购金融资产支出		6,079,485.32	1,972,164.11
6．税金及附加		55,230.64	34,573.34
7．其他费用	6.4.7.19	155,152.66	115,766.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**245,343,679.47**	**-18,829,282.07**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**245,343,679.47**	**-18,829,282.07**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达双债增强债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	1,907,793,334.13	1,320,450,872.74	3,228,244,206.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	245,343,679.47	245,343,679.47
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）	-24,115,029.66	21,087,433.62	-3,027,596.04
其中：1.基金申购款	1,806,299,146.90	1,338,846,989.79	3,145,146,136.69
2.基金赎回款	-1,830,414,176.56	-1,317,759,556.17	-3,148,173,732.73
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）	1,883,678,304.47	1,586,881,985.83	3,470,560,290.30
项目	上年度可比期间		

	2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	233,517,396.31	120,531,043.71	354,048,440.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,829,282.07	-18,829,282.07
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）	1,331,955,626.71	850,461,829.43	2,182,417,456.14
其中：1.基金申购款	2,676,996,541.27	1,655,048,014.95	4,332,044,556.22
2.基金赎回款	-1,345,040,914.56	-804,586,185.52	-2,149,627,100.08
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）	1,565,473,023.02	952,163,591.07	2,517,636,614.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达双债增强债券型证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1539 号《关于核准易方达双债增强债券型证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达双债增强债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达双债增强债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,604,109,956.06 份基金份额，其中认购资金利息折合 134,779.61 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，注册登记机构为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金

信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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》、《易方达双债增强债券型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,893,153.73
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	1,893,153.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		158,951,177.59	165,173,873.23	6,222,695.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,884,843,238.92	2,928,965,229.56	44,121,990.64
	银行间市场	799,840,220.38	802,234,000.00	2,393,779.62
	合计	3,684,683,459.30	3,731,199,229.56	46,515,770.26

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,843,634,636.89	3,896,373,102.79	52,738,465.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	11,970,125.99	-
合计	11,970,125.99	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,151.85
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	6,060.69
应收债券利息	18,837,335.82
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,497.57
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	90.00
合计	18,847,135.93

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末

	2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	26,660.10
银行间市场应付交易费用	9,757.71
合计	36,417.81

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,375.43
应付证券出借违约金	-
预提费用	224,138.35
合计	227,513.78

6.4.7.9 实收基金

易方达双债增强债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,237,368,898.81	1,237,368,898.81
本期申购	1,078,888,569.09	1,078,888,569.09
本期赎回（以“-”号填列）	-1,108,146,258.27	-1,108,146,258.27
本期末	1,208,111,209.63	1,208,111,209.63

易方达双债增强债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	670,424,435.32	670,424,435.32
本期申购	727,410,577.81	727,410,577.81
本期赎回（以“-”号填列）	-722,267,918.29	-722,267,918.29
本期末	675,567,094.84	675,567,094.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

易方达双债增强债券 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
上年度末	615,680,380.45	266,483,146.95	882,163,527.40
本期利润	46,723,797.66	86,254,706.63	132,978,504.29
本期基金份额交易产生的变动数	-25,736,375.38	57,885,548.24	32,149,172.86
其中：基金申购款	529,652,736.07	313,415,473.55	843,068,209.62
基金赎回款	-555,389,111.45	-255,529,925.31	-810,919,036.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	636,667,802.73	410,623,401.82	1,047,291,204.55

易方达双债增强债券 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
上年度末	297,606,650.82	140,680,694.52	438,287,345.34
本期利润	21,001,953.25	91,363,221.93	112,365,175.18
本期基金份额交易产生的变动数	-1,876,360.67	-9,185,378.57	-11,061,739.24
其中：基金申购款	319,143,155.30	176,635,624.87	495,778,780.17
基金赎回款	-321,019,515.97	-185,821,003.44	-506,840,519.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	316,732,243.40	222,858,537.88	539,590,781.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	41,253.97
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	395,608.13
其他	1,872.96
合计	438,735.06

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	95,629,437.11
减：卖出股票成本总额	101,463,571.32
买卖股票差价收入	-5,834,134.21

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,990,240,774.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,896,397,359.53
减：应收利息总额	21,533,843.67
买卖债券差价收入	72,309,571.42

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,085,732.49
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,085,732.49

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	177,617,928.56
——股票投资	14,950,707.61
——债券投资	162,667,220.95
——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	177,617,928.56

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	2,769,857.91

其他	-
合计	2,769,857.91

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	282,181.51
银行间市场交易费用	9,150.00
合计	291,331.51

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	33,764.31
银行间账户维护费	16,650.00
其他	600.00
合计	155,152.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	63,099,785.66	65.98%	29,551,847.06	46.46%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	58,764.88	69.31%	5,776.23	21.67%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	27,521.48	50.26%	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,242,968.19	6,725,767.21

其中：支付销售机构的客户维护费	1,549,201.16	1,715,638.13

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.7%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 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、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,926,562.37	1,921,647.73

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达双债增强债券 A	易方达双债增强债券 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,075,657.32	1,075,657.32
中国建设银行	-	53,235.13	53,235.13
广发证券	-	3,160.34	3,160.34
合计	-	1,132,052.79	1,132,052.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达双债增强债券A	易方达双债增强债券C	合计
易方达基金管理有限公司	-	167,880.65	167,880.65
中国建设银行	-	62,696.08	62,696.08
广发证券	-	8,458.19	8,458.19
合计	-	239,034.92	239,034.92

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 0.4%。

本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.4%÷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

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	易方达双债增强债券A	易方达双债增强债券C	易方达双债增强债券A	易方达双债增强债券C
报告期初持有的基	3,821,865.60	-	3,821,865.60	-

金份额				
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	3,821,865.60	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	3,821,865.60	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	0.3590%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 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

易方达双债增强债券 A

无。

易方达双债增强债券 C

无。

6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国建设银行-活期存款	1,893,153.73	41,253.97	22,051,039.28	171,195.81

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达双债增强债券 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达双债增强债券 C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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	流通受限类型	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
601360	三六零	2021-01-06	2021-07-09	非公开发行流通受限	12.93	12.11	2,706,883	34,999,997.19	32,780,353.13	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	1,050	104,999.08	104,999.08	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 477,000,000.00 元，于 2021 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门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、监察合规管理部门、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为债券型基金，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。本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2021 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 101.06%(2020 年 12 月 31 日：104.33%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	20,146,219.18
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	222,183,041.09	202,713,808.16
合计	222,183,041.09	222,860,027.34

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。

6.4.13.2.2 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 2021年6月30日	上年度末 2020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

6.4.13.2.3 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 2021年6月30日	上年度末 2020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

6.4.13.2.4 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,302,679,852.42	1,208,619,255.48
AAA 以下	2,225,173,671.87	2,099,108,892.14
未评级	0.00	205,269,369.86
合计	3,527,853,524.29	3,512,997,517.48

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 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 2021年6月30日	上年度末 2020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

6.4.13.2.6 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 2021年6月30日	上年度末 2020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

6.4.13.3 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 2021 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。

6.4.13.3.1 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	1,893,153.73	-	-	-	1,893,153.73
结算备付金	14,964,656.08	-	-	-	14,964,656.08
存出保证金	222,246.74	-	-	-	222,246.74
交易性金融资产	385,237,200.00	2,426,863,920.84	919,098,108.72	165,173,873.23	3,896,373,102.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	11,970,125.99	-	-	-	11,970,125.99
应收证券清算款	-	-	-	13,000,536.74	13,000,536.74
应收利息	-	-	-	18,847,135.93	18,847,135.93
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	18,922,179.53	18,922,179.53
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	414,287,382.54	2,426,863,920.84	919,098,108.72	215,943,725.43	3,976,193,137.53
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	477,000,000.00	-	-	-	477,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	14,259,716.69	14,259,716.69
应付赎回款	-	-	-	10,814,720.49	10,814,720.49
应付管理人报酬	-	-	-	2,127,580.87	2,127,580.87
应付托管费	-	-	-	607,880.27	607,880.27
应付销售服务费	-	-	-	459,255.42	459,255.42
应付交易费用	-	-	-	36,417.81	36,417.81
应交税费	-	-	-	99,761.90	99,761.90
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	227,513.78	227,513.78
负债总计	477,000,000.00	-	-	28,632,847.23	505,632,847.23
利率敏感度缺口	-62,712,617.46	2,426,863,920.84	919,098,108.72	187,310,878.20	3,470,560,290.30
上年度末	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**

2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	37,421,086.39	-	-	-	37,421,086.39
结算备付金	100,061,689.14	-	-	-	100,061,689.14
存出保证金	206,678.30	-	-	-	206,678.30
交易性金融资产	273,671,674.00	2,094,969,564.74	1,342,824,082.98	159,357,934.67	3,870,823,256.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	119,770,379.66	-	-	-	119,770,379.66
应收证券清算款	-	-	-	37,308,854.32	37,308,854.32
应收利息	-	-	-	24,450,840.58	24,450,840.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,840,301.31	3,840,301.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	531,131,507.49	2,094,969,564.74	1,342,824,082.98	224,957,930.88	4,193,883,086.09
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	909,546,176.93	-	-	-	909,546,176.93
应付证券清算款	-	-	-	3,055,660.04	3,055,660.04
应付赎回款	-	-	-	49,234,301.35	49,234,301.35
应付管理人报酬	-	-	-	2,170,549.16	2,170,549.16
应付托管费	-	-	-	620,156.88	620,156.88
应付销售服务费	-	-	-	439,580.41	439,580.41
应付交易费用	-	-	-	198,643.12	198,643.12
应交税费	-	-	-	185,713.49	185,713.49
应付利息	-	-	-	-65,382.58	-65,382.58
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	253,480.42	253,480.42
负债总计	909,546,176.93	-	-	56,092,702.29	965,638,879.22

利率敏感度缺口	-378,414,669.44	2,094,969,564.74	1,342,824,082.98	168,865,228.59	3,228,244,206.87

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	4,315,138.01	5,180,680.48
	2.市场利率上升 25 个基点	-4,249,131.04	-5,138,556.74

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购(含增发)，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	165,173,873.23	4.76	159,357,934.67	4.94
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	165,173,873.23	4.76	159,357,934.67	4.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	115,277,074.12	133,547,596.92
	2.业绩比较基准下降 5%	-115,277,074.12	-133,547,596.92

注：股票投资业绩基准取上证 A 指。

6. 4. 14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,827,262,510.36 元，属于第二层次的余额为 1,069,110,592.43 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 2,678,711,966.36 元，第二层次 1,192,111,290.03 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2021 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(2020 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 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	165,173,873.23	4.15
	其中：股票	165,173,873.23	4.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,731,199,229.56	93.84
	其中：债券	3,731,199,229.56	93.84
	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	11,970,125.99	0.30
	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	16,857,809.81	0.42
8	其他各项资产	50,992,098.94	1.28
9	合计	3,976,193,137.53	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	132,393,520.10	3.81
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,780,353.13	0.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	165,173,873.23	4.76

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002036	联创电子	2,829,634	37,209,687.10	1.07
2	601360	三六零	2,706,883	32,780,353.13	0.94
3	601799	星宇股份	125,998	28,440,268.56	0.82
4	600566	济川药业	1,565,761	28,027,121.90	0.81

5	002831	裕同科技	788,398	23,407,536.62	0.67
6	300003	乐普医疗	476,616	15,308,905.92	0.44

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	601360	三六零	34,999,997.19	1.08
2	601799	星宇股份	28,440,268.56	0.88
3	603901	永创智能	21,266,873.52	0.66
4	002382	蓝帆医疗	7,518,248.00	0.23
5	600905	三峡能源	90,100.00	0.00
6	688538	和辉光电	6,625.00	0.00
7	688517	金冠电气	3,855.00	0.00
8	688425	铁建重工	1,435.00	0.00
9	003035	南网能源	1,400.00	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。

7.4.2 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

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	占期初基金资产净值比例（%）
1	603901	永创智能	25,931,696.47	0.80
2	002831	裕同科技	20,371,260.00	0.63
3	300451	创业慧康	20,214,190.52	0.63
4	300003	乐普医疗	8,778,169.44	0.27
5	002382	蓝帆医疗	7,516,381.20	0.23
6	603232	格尔软件	6,346,518.98	0.20
7	002036	联创电子	6,202,424.50	0.19
8	600905	三峡能源	152,330.00	0.00
9	688981	中芯国际	57,440.00	0.00
10	605277	新亚电子	20,850.00	0.00
11	688538	和辉光电	10,500.00	0.00
12	003029	吉大正元	10,370.00	0.00
13	688517	金冠电气	7,560.00	0.00
14	003035	南网能源	6,990.00	0.00
15	688425	铁建重工	2,756.00	0.00

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。

7.4.3 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	92,328,802.27
卖出股票收入（成交）总额	95,629,437.11

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	210,183,000.00	6.06
	其中：政策性金融债	210,183,000.00	6.06
4	企业债券	293,777,200.00	8.46
5	企业短期融资券	10,036,000.00	0.29
6	中期票据	453,964,000.00	13.08
7	可转债（可交换债）	2,732,894,029.56	78.75
8	同业存单	-	-
9	其他	30,345,000.00	0.87
10	合计	3,731,199,229.56	107.51

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	1,604,040	185,394,943.20	5.34
2	210206	21 国开 06	1,300,000	130,013,000.00	3.75
3	128129	青农转债	1,104,600	118,037,556.00	3.40
4	110057	现代转债	964,620	107,854,162.20	3.11
5	128081	海亮转债	808,460	91,929,986.60	2.65

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2020 年 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违反银行交易记录管理规定的行为，处 60 万元人民币罚款,要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2020 年 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违规开展外汇交易的行为，处 60 万元人民币罚款,要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

本基金投资光大转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除光大转债外，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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额

1	存出保证金	222,246.74
2	应收证券清算款	13,000,536.74
3	应收股利	-
4	应收利息	18,847,135.93
5	应收申购款	18,922,179.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,992,098.94

7.12.4 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	113011	光大转债	185,394,943.20	5.34
2	128129	青农转债	118,037,556.00	3.40
3	110057	现代转债	107,854,162.20	3.11
4	128081	海亮转债	91,929,986.60	2.65
5	128108	蓝帆转债	90,612,223.00	2.61
6	123035	利德转债	75,579,908.67	2.18
7	123077	汉得转债	71,181,387.90	2.05
8	110053	苏银转债	68,238,300.80	1.97
9	110068	龙净转债	67,910,865.60	1.96
10	110062	烽火转债	66,370,961.40	1.91
11	123049	维尔转债	64,129,565.18	1.85
12	127018	本钢转债	62,307,906.48	1.80
13	123078	飞凯转债	56,139,339.84	1.62
14	110051	中天转债	55,832,642.60	1.61
15	113604	多伦转债	51,120,977.50	1.47
16	128106	华统转债	50,312,876.26	1.45
17	128128	齐翔转 2	50,214,682.09	1.45
18	113596	城地转债	48,979,666.80	1.41
19	128075	远东转债	48,919,279.88	1.41
20	110064	建工转债	45,331,236.80	1.31
21	128097	奥佳转债	40,812,216.90	1.18
22	113569	科达转债	40,099,800.00	1.16
23	123023	迪森转债	38,138,397.45	1.10
24	132014	18 中化 EB	38,025,039.30	1.10

25	128042	凯中转债	37,931,495.30	1.09
26	127025	冀东转债	37,340,552.75	1.08
27	128083	新北转债	36,687,424.55	1.06
28	110041	蒙电转债	35,595,876.00	1.03
29	110045	海澜转债	34,966,981.20	1.01
30	127013	创维转债	34,936,474.50	1.01
31	127019	国城转债	33,010,042.40	0.95
32	128141	旺能转债	32,974,256.28	0.95
33	127014	北方转债	32,483,584.70	0.94
34	128044	岭南转债	31,372,597.92	0.90
35	128107	交科转债	29,834,784.88	0.86
36	110052	贵广转债	29,732,461.70	0.86
37	123060	苏试转债	28,949,553.60	0.83
38	128127	文科转债	27,302,057.30	0.79
39	113528	长城转债	25,549,294.00	0.74
40	128073	哈尔转债	24,640,434.00	0.71
41	113568	新春转债	24,473,950.80	0.71
42	123088	威唐转债	23,713,840.57	0.68
43	113600	新星转债	22,392,651.60	0.65
44	128023	亚太转债	22,223,730.76	0.64
45	128063	未来转债	22,114,320.58	0.64
46	128139	祥鑫转债	21,695,538.87	0.63
47	128132	交建转债	21,584,567.07	0.62
48	128138	侨银转债	20,499,487.50	0.59
49	128074	游族转债	18,781,799.19	0.54
50	128096	奥瑞转债	18,287,417.75	0.53
51	113535	大业转债	16,760,950.00	0.48
52	128013	洪涛转债	13,751,052.00	0.40
53	128026	众兴转债	10,806,974.40	0.31
54	123028	清水转债	8,769,198.20	0.25
55	113563	柳药转债	7,302,363.00	0.21
56	113601	塞力转债	4,678,781.70	0.13
57	128035	大族转债	2,567,026.00	0.07

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601360	三六零	32,780,353.13	0.94	非公开发行流通受限

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
易方达双债增强债券 A	40,808	29,604.76	791,584,584.32	65.52%	416,526,625.31	34.48%
易方达双债增强债券 C	17,200	39,277.16	405,192,877.61	59.98%	270,374,217.23	40.02%
合计	58,008	32,472.73	1,196,777,461.93	63.53%	686,900,842.54	36.47%

8.2 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	易方达双债增强债券 A	122,357.52	0.0101%
	易方达双债增强债券 C	6.58	0.0000%
	合计	122,364.10	0.0065%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	易方达双债增强债券 A	0
	易方达双债增强债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达双债增强债券 A	0
	易方达双债增强债券 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达双债增强债券 A	易方达双债增强债券 C
基金合同生效日（2011 年 12 月 1 日）基金份额总额	551,303,364.17	1,052,806,591.89
本报告期期初基金份额总额	1,237,368,898.81	670,424,435.32
本报告期基金总申购份额	1,078,888,569.09	727,410,577.81
减：本报告期基金总赎回份额	1,108,146,258.27	722,267,918.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,208,111,209.63	675,567,094.84

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	32,529,651.45	34.02%	26,023.72	30.69%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	63,099,785.66	65.98%	58,764.88	69.31%	-

国元证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券华南	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为东北证券股份有限公司,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、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

1） 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2） 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	2,172,297,447.10	48.52%	28,928,100,000.00	68.46%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	2,305,173,432.31	51.48%	13,324,900,000.00	31.54%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-

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	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配三六零（601360）非公开发行 A 股的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
2	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加东方财富证券为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-12
3	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加基煜基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19

4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-01-21
5	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
6	易方达基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021-02-08
7	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加长沙银行为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-08
8	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加腾安基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-10
9	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加微众银行为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-25
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	上海证券报	2021-03-30
11	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-04-19

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达双债增强债券型证券投资基金募集的文件；

2.《易方达双债增强债券型证券投资基金基金合同》；

3.《易方达双债增强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。

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

二〇二一年八月二十八日