易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。

本报告期自 2019 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 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13
6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
7 投资组合报告 35
7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 35
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 35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 36
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 36
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 37
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 37
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 37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 37

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 37
7.12 投资组合报告附注 37
8 基金份额持有人信息 38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 38
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 39
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 39
9 开放式基金份额变动 39
10 重大事件揭示 40
10.1 基金份额持有人大会决议 40
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 40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 40
10.4 基金投资策略的改变 40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 40
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 40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 41
10.8 其他重大事件 43
11 影响投资者决策的其他重要信息 44
11.1 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 44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 45
12 备查文件目录 45
12.1 备查文件目录 45
12.2 存放地点 45
12.3 查阅方式 45

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金	
基金简称	易方达聚盈分级债券发起式	
基金主代码	000428	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2013 年 11 月 14 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	558,705,016.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达聚盈分级债券发起式 A	易方达聚盈分级债券发起式 B
下属分级基金的交易代码	000429	000430
报告期末下属分级基金的份额总额	231,003,871.62 份	327,701,144.60 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，力争实现基金资产的稳健增值。	
投资策略	本基金将采取积极管理的投资策略，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，自上而下地决定债券组合久期及类属配置；同时在严谨深入的信用分析的基础上，自下而上地精选个券，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。	
业绩比较基准	中债新综合财富指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金，基金整体的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。	
下属分级基金的风险收益特征	聚盈 A 相对低风险、预期收益相对稳定。	聚盈 B 相对较高风险、预期收益相对较高。

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
信息披露负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096

传真	020-85104666	010-66275853
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
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

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（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	11,103,860.27
本期利润	11,127,365.55
加权平均基金份额本期利润	0.0195
本期加权平均净值利润率	1.91%
本期基金份额净值增长率	1.98%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2019 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	134,125,394.11
期末可供分配基金份额利润	0.2401
期末基金资产净值	571,208,722.04
期末基金份额净值	1.0224
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2019 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	38.81%

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

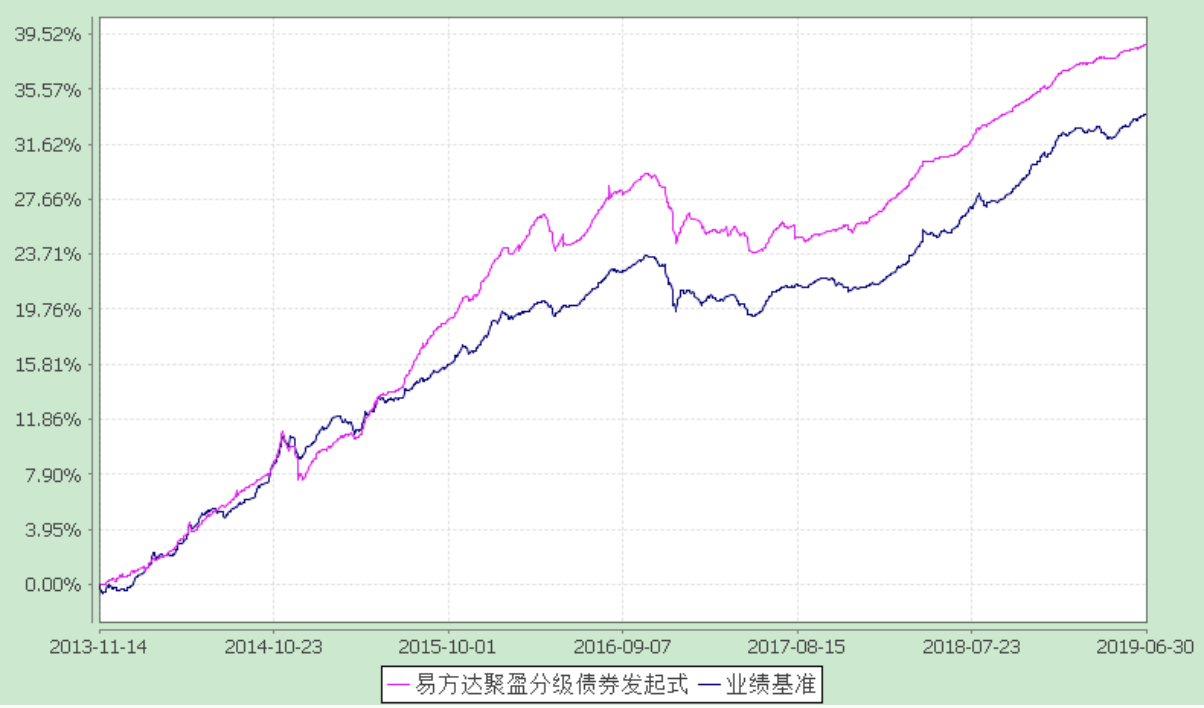
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.30%	0.02%	0.53%	0.03%	-0.23%	-0.01%
过去三个月	0.71%	0.02%	0.65%	0.06%	0.06%	-0.04%
过去六个月	1.98%	0.03%	1.82%	0.06%	0.16%	-0.03%
过去一年	5.88%	0.03%	6.08%	0.06%	-0.20%	-0.03%
过去三年	10.65%	0.08%	10.73%	0.07%	-0.08%	0.01%
自基金合同生效起至今	38.81%	0.09%	33.79%	0.08%	5.02%	0.01%

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

易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013 年 11 月 14 日至 2019 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 38.81%，同期业绩比较基准收益率为 33.79%。

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		

张磊	本基金的基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理（自 2016 年 12 月 03 日至 2019 年 01 月 03 日）、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理（自 2015 年 06 月 13 日至 2019 年 01 月 03 日）、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理（自 2011 年 12 月 01 日至 2019 年 01 月 03 日）、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理（自 2018 年 01 月 30 日至 2019 年 02 月 01 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（自 2014 年 09 月 10 日至 2019 年 01 月 03 日）、固定收益组合管理部负责人	2013-11-14	2019-01-04	15 年	硕士研究生，曾任泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心固定收益部研究员、投资经理，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，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、固定收益部投资经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理。
李一硕	本基金的基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达安源中短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 03 月 01 日至 2019 年 06 月 27 日）、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 03 月 01 日至 2019 年 06 月 27 日）、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 03 月 01 日至 2019 年 06 月 27 日）、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰惠混合型证券投资基	2019-01-04	-	11 年	硕士研究生，曾任瑞银证券有限公司研究员，中国国际金融有限公司研究员，易方达基金管理有限公司研究员、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

	金的基金经理助理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理助理				

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 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年一季度我国宏观经济中出现了一些积极信号。信贷和社融数据不断改善，季度环比增速明显反弹。此外，固定资产投资同比增速也有所提高，其中尤其是房地产投资增速受施工分项带动而大幅增长。市场此前略有担忧的消费与进出口增速数据在今年一季度也总体保持平稳。

二季度宏观经济的下行压力则相对一季度有所加大。5 月工业增加值同比增长 5.0%，较 4 月份的 5.4%进一步走低。固定资产投资方面，5 月增速单月同比也由此前的 5.7%降至 4.4%，季调后连续两个月下滑。其中制造业投资在今年以来连续 4 个月持续回落后略有反弹，但尚未扭转弱势。二季度基建投资同样维持在相对偏低水平，对冲经济回落的效果并不显著。融资方面，二季度表内信贷和社融数据低于预期，其中企业中长期贷款相对偏弱，反映实体融资需求可能仍然不足。6 月份宏观数据较 4-5 月份有所改善，主要体现在工业增加值及社会消费品零售总额增速上，但市场仍对其可持续性存疑。

在上述经济增速仍然乏力的背景下，上半年央行保持了相对较为宽松的货币政策，同时强调降低风险溢价，债券市场整体面临较好的投资环境。虽然 3 月份较为正面的经济数据带动收益率在 4 月一度走高，但随后呈现下行态势。

操作上，组合维持相对合理的久期和杠杆水平，以获取持有期收益为主要目标，维持较高的组合流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0224 元，本报告期份额净值增长率为 1.98%，同期业绩比较基准收益率为 1.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度我国经济超预期主要受增值税调整和房地产投资高企的影响，二季度已经相对有所回落。在工业企业利润维持低位以及中美贸易争端仍未完全解决的背景下，作为经济核心内生性变量的制造业投资难以大幅回升。受到地方政府债务水平的限制，基建投资的扩张可能将保持克制。由于房屋施工面积处于高位，房地产投资预计仍将是未来一段时间内宏观经济的重要支撑因素，但需要关

注融资环境边际收紧带来的不利影响。海外方面，主要经济体增长前景仍不明朗，长端美债及欧债均位于下行趋势当中，有利于扩大国内央行的货币政策灵活度。考虑到经济继续面临一定的下行压力，预计稳健的货币政策将保持松紧适度，市场流动性继续维持充裕水平，债券市场收益率上行的风险较为有限。虽然上半年通胀水平一度走高，但主要是由于食品分项的拉动，非食品分项则维持低位。预计三季度通胀压力将在边际上有所缓解，不会对债券市场形成制约。但从估值角度看，目前债券市场各主要期限品种的收益率处于历史相对偏低水平，收益率大幅下降的空间也受到限制。目前收益率曲线形态比较陡峭，中端期限的配置价值相对较高。

操作上，下半年我们将保持目前的配置结构，以获取持有期收益为主要目标，维持较高的组合流动性。

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

根据《易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金(包括聚盈 A 和聚盈 B)不进行收益分配。

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：易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金

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	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	629,338.41	1,127,342.83
结算备付金		4,965,279.91	-
存出保证金		10,825.89	1,902.52
交易性金融资产	6.4.7.2	558,693,909.80	641,512,565.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		558,693,909.80	641,512,565.40
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	5,200,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	11,667,698.30	11,376,115.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	250.10	250.10
资产总计		581,167,302.41	654,018,176.30
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2019 年 6 月 30 日**	**上年度末 2018 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		9,500,000.00	69,992,775.01
应付证券清算款		2,186.30	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		93,724.32	98,801.97
应付托管费		46,862.17	49,401.03
应付销售服务费		47,601.83	53,285.19
应付交易费用	6.4.7.7	2,218.04	18,558.13
应交税费		72,574.78	77,692.47
应付利息		-	57,608.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	193,412.93	270,000.00
负债合计		9,958,580.37	70,618,122.65
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	389,770,551.62	407,946,560.06
未分配利润	6.4.7.10	181,438,170.42	175,453,493.59
所有者权益合计		571,208,722.04	583,400,053.65
负债和所有者权益总计		581,167,302.41	654,018,176.30

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，易方达聚盈分级债券发起式份额净值 1.0224 元，易方达聚盈分级债券发起式 A 份额净值 1.0042 元，易方达聚盈分级债券发起式 B 份额净值 1.0352 元；基金份额总额 558,705,016.22 份，下属分级基金的份额总额分别为：易方达聚盈分级债券发起式 A 基金份额总额 231,003,871.62 份，易方达聚盈分级债券发起式 B 基金份额总额 327,701,144.60 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		**13,213,953.37**	**29,711,103.13**
1.利息收入		13,838,061.70	21,302,107.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	43,228.89	28,357.98
债券利息收入		13,721,812.49	21,230,191.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		73,020.32	43,557.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-647,613.61	-10,590,759.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-647,613.61	-10,590,759.86
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	23,505.28	18,999,755.12
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		**2,086,587.82**	**4,402,807.62**
1．管理人报酬		577,121.85	654,591.09
2．托管费		288,560.98	327,295.50
3．销售服务费		304,101.26	434,901.08
4．交易费用	6.4.7.18	3,511.16	3,745.98
5．利息支出		747,392.95	2,679,042.67
其中：卖出回购金融资产支出		747,392.95	2,679,042.67
6．税金及附加		46,083.03	76,429.59
7．其他费用	6.4.7.19	119,816.59	226,801.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**11,127,365.55**	**25,308,295.51**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**11,127,365.55**	**25,308,295.51**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 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）	407,946,560.06	175,453,493.59	583,400,053.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,127,365.55	11,127,365.55
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）	-18,176,008.44	-5,142,688.72	-23,318,697.16
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-18,176,008.44	-5,142,688.72	-23,318,697.16
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）	389,770,551.62	181,438,170.42	571,208,722.04
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）	568,691,379.68	166,921,150.70	735,612,530.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,308,295.51	25,308,295.51
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）	-121,438,184.49	-28,039,272.65	-149,477,457.14
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-121,438,184.49	-28,039,272.65	-149,477,457.14
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）	447,253,195.19	164,190,173.56	611,443,368.75

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

易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金(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[2013]1415 号《关于核准易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金募集的批复》注册，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《易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2013 年 11 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 549,578,829.21 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,552.21 份基金份额。根据《易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金为契约型、开放式、发起式基金，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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部

分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	629,338.41
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	629,338.41

6.4.7.2 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		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	159,219,631.37	158,372,278.80	-847,352.57
	银行间市场	398,174,682.57	400,321,631.00	2,146,948.43
	合计	557,394,313.94	558,693,909.80	1,299,595.86
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		557,394,313.94	558,693,909.80	1,299,595.86

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 2019 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,200,000.00	-

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 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	551.05
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	2,010.96
应收债券利息	11,662,917.94
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,213.94
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.41

合计	11,667,698.30

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
其他应收款	250.10
待摊费用	-
合计	250.10

6.4.7.7 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	-
银行间市场应付交易费用	2,218.04
合计	2,218.04

6.4.7.8 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	-
预提费用	193,412.93
合计	193,412.93

6.4.7.9 实收基金

易方达聚盈分级债券发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	250,165,219.17	197,934,945.70
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-23,140,145.20	-18,176,008.44
基金拆分/份额折算调整	3,978,797.65	-
本期末	231,003,871.62	179,758,937.26

易方达聚盈分级债券发起式 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	327,701,144.60	210,011,614.36
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	327,701,144.60	210,011,614.36

注：1.根据《易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金招募说明书》和《易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的基金管理人易方达基金管理有限公司确定 2019 年 2 月 11 日、2019 年 5 月 13 日为聚盈 A 的基金份额折算基准日。折算基准日聚盈 A 的基金份额净值调整为 1.0000 元。各基金份额持有人持有的聚盈 A 经折算后的份额数四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2.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

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	128,164,222.56	47,289,271.03	175,453,493.59
本期利润	11,103,860.27	23,505.28	11,127,365.55
本期基金份额交易产生的变动数	-5,142,688.72	-	-5,142,688.72
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-5,142,688.72	-	-5,142,688.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	134,125,394.11	47,312,776.31	181,438,170.42

6.4.7.11 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,812.51
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	22,341.33
其他	75.05
合计	43,228.89

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 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6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	381,702,027.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	372,498,001.58
减：应收利息总额	9,851,639.45
买卖债券差价收入	-647,613.61

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

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 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6月30日
1.交易性金融资产	23,505.28
——股票投资	-
——债券投资	23,505.28
——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	23,505.28

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	153.66
银行间市场交易费用	3,357.50
合计	3,511.16

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	58,700.75
银行汇划费	7,803.66
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	119,816.59

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

根据本基金的基金合同的规定，本基金以 2019 年 8 月 12 日为份额折算基准日，对易方达聚盈 A 进行基金份额折算。本基金管理人已于 2019 年 8 月 12 日对本次易方达聚盈 A 的赎回和转出申请进行了确认，并于 2019 年 8 月 14 日对上述事项进行了公告。

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、基金发起人
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人

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

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股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2019年1月1日至2019年6月30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	577,121.85	654,591.09
其中：支付销售机构的客户维护费	2,434.16	4,588.59

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。管理费的计算

方法如下：

H＝E×0.20 %÷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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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 2019年1月1日至2019年6月30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托管费	288,560.98	327,295.50

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计

算方法如下：

H＝E×0.10%÷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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，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 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达聚盈分级债券发起式 A	易方达聚盈分级债券发起式 B	合计
易方达基金管理有限公司	297,919.32	-	297,919.32
合计	297,919.32	-	297,919.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达聚盈分级债券发起式A	易方达聚盈分级债券发起式B	合计
易方达基金管理有限公司	423,254.61	-	423,254.61
合计	423,254.61	-	423,254.61

注：聚盈 A 的年销售服务费率为 0.25%，聚盈 B 不收取销售服务费。

聚盈 A 销售服务费按前一日聚盈 A 基金资产净值的 0.25%年费率计提。

聚盈 A 销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为聚盈 A 基金份额每日应计提的销售服务费

E 为聚盈 A 基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日

	易方达聚盈分级债券发起式A	易方达聚盈分级债券发起式B	易方达聚盈分级债券发起式A	易方达聚盈分级债券发起式B
报告期初持有的基金份额	-	218,241,335.20	-	199,380,335.48
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	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	218,241,335.20	-	199,380,335.48
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	66.60%	-	66.60%

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。

6.4.10.4.2 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

易方达聚盈分级债券发起式 A

无。

易方达聚盈分级债券发起式 B

无。

6.4.10.5 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1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 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
中国建设银行-活期存款	629,338.41	20,812.51	1,465,024.69	21,460.76

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

根据《易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金(包括聚盈 A 和聚

盈 B)不进行收益分配。

6.4.12 期末（2019 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

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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 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 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 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 9,500,000.00 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。

6.4.13 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。

本基金为债券型基金，基金整体的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。日常经营活动中本基金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，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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 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 89.24%(2018 年 12 月 31 日：93.39%)。

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	40,883,557.19	69,051,180.54
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	40,546,098.63	177,435,494.52
合计	81,429,655.82	246,486,675.06

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 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

6.4.13.2.3 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

6.4.13.2.4 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	上年度末

	2019年6月30日	2018年12月31日
AAA	288,768,869.86	163,647,765.71
AAA 以下	169,848,874.66	134,726,248.33
未评级	30,309,427.40	108,027,754.79
合计	488,927,171.92	406,401,768.83

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 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

6.4.13.2.6 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	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 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。

6.4.13.3.1 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 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	629,338.41	-	-	-	629,338.41
结算备付金	4,965,279.91	-	-	-	4,965,279.91
存出保证金	10,825.89	-	-	-	10,825.89
交易性金融资产	227,831,096.80	330,862,813.00	-	-	558,693,909.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	5,200,000.00	-	-	-	5,200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	11,667,698.30	11,667,698.30
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	250.10	250.10
资产总计	238,636,541.01	330,862,813.00	-	11,667,948.40	581,167,302.41
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	9,500,000.00	-	-	-	9,500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,186.30	2,186.30
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	93,724.32	93,724.32
应付托管费	-	-	-	46,862.17	46,862.17
应付销售服务费	-	-	-	47,601.83	47,601.83
应付交易费用	-	-	-	2,218.04	2,218.04
应交税费	-	-	-	72,574.78	72,574.78
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	193,412.93	193,412.93
负债总计	9,500,000.00	-	-	458,580.37	9,958,580.37
利率敏感度缺口	229,136,541.01	330,862,813.00	-	11,209,368.03	571,208,722.04
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,127,342.83	-	-	-	1,127,342.83
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	1,902.52	-	-	-	1,902.52
交易性金融资产	304,993,626.40	331,362,439.00	5,156,500.00	-	641,512,565.40
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	-	-	-	11,376,115.45	11,376,115.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	250.10	250.10
资产总计	306,122,871.75	331,362,439.00	5,156,500.00	11,376,365.55	654,018,176.30

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	69,992,775.01	-	-	-	69,992,775.01
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	98,801.97	98,801.97
应付托管费	-	-	-	49,401.03	49,401.03
应付销售服务费	-	-	-	53,285.19	53,285.19
应付交易费用	-	-	-	18,558.13	18,558.13
应交税费	-	-	-	77,692.47	77,692.47
应付利息	-	-	-	57,608.85	57,608.85
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	270,000.00	270,000.00
负债总计	69,992,775.01	-	-	625,347.64	70,618,122.65
利率敏感度缺口	236,130,096.74	331,362,439.00	5,156,500.00	10,751,017.91	583,400,053.65

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	1,648,760.95	2,253,060.26
	2.市场利率上升 25 个基点	-1,633,715.73	-2,230,454.48

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。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，同时本基金不参与可转换债券投资。于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

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 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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 558,693,909.80 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：无属于第一层次的余额，第二层次 641,512,565.40 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(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 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	558,693,909.80	96.13
	其中：债券	558,693,909.80	96.13
	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	5,200,000.00	0.89
	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	5,594,618.32	0.96
8	其他各项资产	11,678,774.29	2.01
9	合计	581,167,302.41	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

7.4.3 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。

7.5 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	59,853,000.00	10.48
	其中：政策性金融债	59,853,000.00	10.48
4	企业债券	225,737,909.80	39.52
5	企业短期融资券	50,240,000.00	8.80
6	中期票据	222,863,000.00	39.02
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	558,693,909.80	97.81

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	1480464	13 锦城投债 02	500,000	30,825,000.00	5.40
2	101658065	16 龙盛 MTN001	300,000	30,093,000.00	5.27
3	190301	19 进出 01	300,000	29,952,000.00	5.24
4	155211	19 建材 03	300,000	29,949,000.00	5.24
5	190202	19 国开 02	300,000	29,901,000.00	5.23

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 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。

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	10,825.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,667,698.30
5	应收申购款	-

6	其他应收款	250.10
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,678,774.29

7.12.4 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。

7.12.5 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 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
易方达聚盈分级债券发起式 A	6,410	36,038.05	75,404,206.50	32.64%	155,599,665.12	67.36%
易方达聚盈分级债券发起式 B	2	163,850,572.30	327,701,144.60	100.00%	0.00	0.00%
合计	6,412	87,134.28	403,105,351.10	72.15%	155,599,665.12	27.85%

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	易方达聚盈分级债券发起式 A	1,304,110.33	0.5645%
	易方达聚盈分级债券发	0.00	0.0000%

	起式 B		
	合计	1,304,110.33	0.2334%

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	易方达聚盈分级债券发起式 A	0
	易方达聚盈分级债券发起式 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达聚盈分级债券发起式 A	0
	易方达聚盈分级债券发起式 B	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	218,241,335.20	39.0620%	10,000,400.00	1.7899%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	218,241,335.20	39.0620%	10,000,400.00	1.7899%	-

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达聚盈分级债券发起式 A	易方达聚盈分级债券发起式 B
基金合同生效日（2013 年 11 月 14 日）基金份额总额	339,570,429.21	210,008,400.00
本报告期期初基金份额总额	250,165,219.17	327,701,144.60
本报告期基金总申购份额	-	-

减：本报告期基金总赎回份额	23,140,145.20	-
本报告期基金拆分变动份额	3,978,797.65	-
本报告期期末基金份额总额	231,003,871.62	327,701,144.60

注：本基金份额变动含因期间内折算导致的强制调增份额。

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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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、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 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	
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	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	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司各一个

交易单元,新增中信建投证券股份有限公司二个交易单元；新增太平洋证券股份有限公司、西部证券股份有限公司各一个交易单元。

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
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	151,102,600.00	100.00%	3,557,200,000.00	100.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

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	易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-04
2	易方达基金管理有限公司关于易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金之聚盈 A 份额折算方案的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-15
3	易方达基金管理有限公司关于易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金之聚盈 A 份额开放赎回和转换转出业务的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-25
4	易方达基金管理有限公司关于易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金之聚盈 A 份额折算基准日（2019 年 2 月 11 日）后约定年收益率的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-01-30
5	易方达基金管理有限公司关于易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金之聚盈 A 份额折算和确认结果的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-02-13
6	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	2019-03-13

		及基金管理人网站	
7	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
8	易方达基金管理有限公司关于易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金之聚盈 A 份额折算方案的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-04-30
9	易方达基金管理有限公司关于易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金之聚盈 A 份额开放赎回和转换转出业务的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-05-08
10	易方达基金管理有限公司关于易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金之聚盈 A 份额折算基准日（2019 年 5 月 13 日）后约定年收益率的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-05-08
11	易方达基金管理有限公司关于易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金之聚盈 A 份额折算和确认结果的公告	上海证券报及基金管理人网站	2019-05-15
12	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
13	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

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019 年 01 月 01 日~2019 年 06 月 30 日	218,241,335.20	-	-	218,241,335.20	39.06%
产品特有风险							
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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》）要求，公募产品不得进行份额分级，应在《资管新规》规定的过渡期结束前进行整改规范，请投资者关注相关风险以及基金管理人届时发布的相关公告。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1.中国证监会注册易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金募集的文件；

2.《易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金基金合同》；

3.《易方达聚盈分级债券型发起式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。

12.2 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。

12.3 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