易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

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：兴业银行股份有限公司
送出日期：二〇一九年八月二十四日

§1 重要提示

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。

基金托管人兴业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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	易方达掌柜季季盈理财债券		
基金主代码	000833		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017年6月15日		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	4,539,342,957.73份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	易方达掌柜季季盈理财债券A	易方达掌柜季季盈理财债券B	易方达掌柜季季盈理财债券C
下属分级基金的交易代码	000833	005099	005100
报告期末下属分级基金的份额总额	100,406,972.17份	4,436,797,521.51份	2,138,464.05份

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

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将对基金资产组合进行积极管理，在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。对于银行存款及大额存单的投资，本基金根据宏观经济指标分析债券类资产和银行存款的预期收益率水平，制定和调整银行存款及大额存单投资比例、存款期限等。本基金对利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，结合利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化，据此确定组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，选择合适的期限结构配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。
业绩比较基准	中国人民银行公布的三个月银行定期整存整取存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于短期理财债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和投资期限较长的债券型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	龚小武
	联系电话	020-85102688	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95561
传真		020-85104666	021-62159217

2.4 信息披露方式

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

§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）		
	易方达掌柜季季盈理财债券A	易方达掌柜季季盈理财债券B	易方达掌柜季季盈理财债券C
本期已实现收益	2,078,186.68	100,827,891.12	77,143.97
本期利润	2,078,186.68	100,827,891.12	77,143.97
本期净值收益率	1.3906%	1.4612%	1.4409%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)		
	易方达掌柜季季盈理财债券A	易方达掌柜季季盈理财债券B	易方达掌柜季季盈理财债券C
期末基金资产净值	100,406,972.17	4,436,797,521.51	2,138,464.05
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润分配是按运作期结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 易方达掌柜季季盈理财债券A：

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2017%	0.0012%	0.0917%	0.0000%	0.1100%	0.0012%
过去三个月	0.6461%	0.0008%	0.2784%	0.0000%	0.3677%	0.0008%
过去六个月	1.3906%	0.0008%	0.5546%	0.0000%	0.8360%	0.0008%
过去一年	3.1367%	0.0013%	1.1215%	0.0000%	2.0152%	0.0013%
过去三年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	8.0645%	0.0022%	2.3056%	0.0000%	5.7589%	0.0022%

2. 易方达掌柜季季盈理财债券B：

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2133%	0.0011%	0.0917%	0.0000%	0.1216%	0.0011%
过去三个月	0.6813%	0.0007%	0.2784%	0.0000%	0.4029%	0.0007%
过去六个月	1.4612%	0.0008%	0.5546%	0.0000%	0.9066%	0.0008%
过去一年	3.2820%	0.0013%	1.1215%	0.0000%	2.1605%	0.0013%
过去三年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	7.1388%	0.0022%	2.0215%	0.0000%	5.1173%	0.0022%

3. 易方达掌柜季季盈理财债券C：

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2099%	0.0011%	0.0917%	0.0000%	0.1182%	0.0011%
过去三个月	0.6712%	0.0007%	0.2784%	0.0000%	0.3928%	0.0007%
过去六个月	1.4409%	0.0008%	0.5546%	0.0000%	0.8863%	0.0008%
过去一年	3.2404%	0.0013%	1.1215%	0.0000%	2.1189%	0.0013%
过去三年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	7.1703%	0.0022%	2.0465%	0.0000%	5.1238%	0.0022%

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

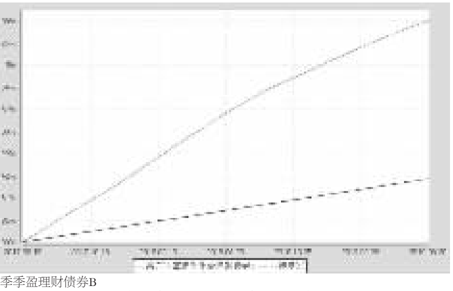
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

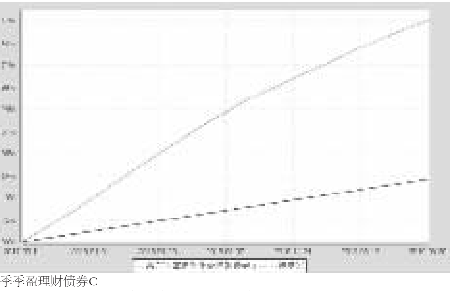
1、易方达掌柜季季盈理财债券A

（2017年6月15日至2019年6月30日）



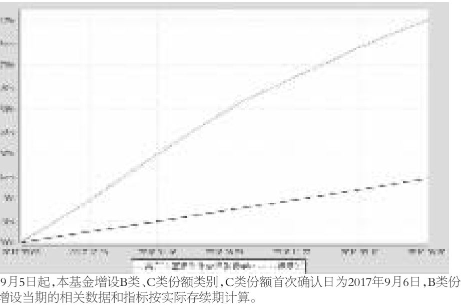
2、易方达掌柜季季盈理财债券B

（2017年9月14日至2019年6月30日）



3、易方达掌柜季季盈理财债券C

（2017年9月6日至2019年6月30日）



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

2.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值收益率为8.0645%，同期业绩比较基准收益率为2.3056%。B类基金份额净值收益率为7.1388%，同期业绩比较基准收益率为2.0215%。C类基金份额净值收益率为7.1703%，同期业绩比较基准收益率为2.0465%。

§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		
石大怿	本基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达天天发货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理（自2013年01月15日至2019年05月27日）、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自2016年06月02日至2019年06月27日）、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	2017-06-15	–	10年	硕士研究生，曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。
梁莹	本基金的基金经理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理（自2014年09月24日至2019年05月27日）、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达货币市场基金的基金经理助理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理	2017-07-11	–	9年	硕士研究生，曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员，易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益基金经理助理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理。
易璘	本基金的基金经理助理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理助理（自2018年06月20日至2019年05月27日）、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达天天发货币市场基金的基金经理助理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理助理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理助理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理助理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理助理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理助理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达货币市场基金的基金经理助理	2018-06-20	–	9年	硕士研究生，曾任汇添富基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司高级债券交易员。

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/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年上半年，债券市场收益率经历了先下后上再下的过程，经济预期和信用环境变化是核心驱动因素。春节前，受国内货币环境宽松、经济基本面存在下行压力、以及美联储加息受阻等因素影响，国内债市收益率快速下行。2月中旬公布的1月社融超预期回升，债市出现调整。2月社融数据回落，叠加欧美央行释放鸽派信号，3月债市又有所反弹。总体看，一季度债市收益率震荡下行。4月公布的一季度经济数据较好，通胀预期升温，央行重提"把好货币总闸门"，市场对货币收紧的担忧上升，债市收益率上行。5月，中美贸易摩擦超预期变化和央行定向降准等因素推动了债市收益率重回下行通道，信用利差收敛。5月下旬，包商事件打破了银行同业刚兑预期，事件持续发酵推动了信用分层加剧，市场风险偏好进一步下降，中低评级和民企信用利差开始明显走阔。6月，经济基本面继续有利于债市，但资金面波动加剧、地方债供给放量等因素对债市产生一定干扰。整体来看，二季度债市收益率呈现出先上后下的走势。

货币市场收益率跟随债市大环境的波动，上半年总体也是震荡下行，并在6月下旬达到了近几年低点。受此影响，短期理财基金收益率继续下行。

操作方面，报告期内基金以同业存单、同业存款、短期逆回购为主要配置资产，保持了适中的剩余期限和杠杆率。总体来看，组合保持了稳定的投资收益和较好的流动性。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内A类基金份额净值收益率为1.3906%；B类基金份额净值收益率为1.4612%；C类基金份额净值收益率为1.4409%；同期业绩比较基准收益率为0.5546%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观基本面方面，虽然中美贸易摩擦为全球经济带来了极大的不确定性，但国内经济基本面的后续走势将会是债市最核心的驱动变量。当前宏观经济虽呈现出一定的下行压力，但仍具韧性，且政策层面上也仍保留有较大的空间。在资金面仍处于相对宽松的大背景下，经济失速下行的概率并不大。在此过程中利率下行和核心资产的投资价值将值得重视。展望2019年下半年，全球经济景气度下滑、货币宽松、中外利差较高、境外资金流入增多等，都将有利于债市。

本基金将坚持短期理财基金作为流动性管理工具的定位，继续保持投资组合较好的流动性，并将随着经济基本面和货币政策预期的调整，及时调整组合久期。基金投资类属配置将以同业存款、同业存单、短期逆回购为主，追求相对稳定的投资收益。基金管理人始终将基金资产安全和基金收益稳定的重要性置于对高收益的追求之上，坚持规范运作、审慎投资，勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

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

根据相关法律法规及《易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金基金合同》，本基金每日将各类基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

§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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	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	2,917,856,550.32	2,941,994,862.66
结算备付金	9,930,000.00	–
存出保证金	–	–
交易性金融资产	2,059,397,148.61	5,416,585,770.26
其中：股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	2,059,397,148.61	5,416,585,770.26
资产支持证券投资	–	–
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	11,576,573.54	25,161,783.44
应收股利	–	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	4,998,760,272.47	8,383,742,416.36
负债和所有者权益	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	–	–
卖出回购金融资产款	251,041,674.48	360,999,258.50
应付证券清算款	–	–
应付赎回款	206,749,413.19	34,216.81
应付管理人报酬	1,011,357.94	1,463,071.78
应付托管费	252,839.50	365,767.93
应付销售服务费	63,938.90	101,783.69
应付交易费用	39,795.46	36,074.81
应交税费	–	–
应付利息	28,387.20	190,319.60
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	229,908.07	325,906.51
负债合计	459,417,314.74	363,516,399.63
所有者权益：		
实收基金	4,539,342,957.73	8,020,226,016.73
未分配利润	–	–
所有者权益合计	4,539,342,957.73	8,020,226,016.73
负债和所有者权益总计	4,998,760,272.47	8,383,742,416.36

注：报告截止日2019年6月30日，A类基金份额净值1.0000元，B类基金份额净值1.0000元，C类基金份额净值1.0000元；基金份额总额4,539,342,957.73份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额100,406,972.17份，B类基金份额总额4,436,797,521.51份，C类基金份额总额2,138,464.05份。

6.2 利润表

会计主体：易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	114,245,962.03	203,082,894.10
1.利息收入	114,449,975.98	204,461,462.02
其中：存款利息收入	43,087,440.89	127,784,379.60
债券利息收入	60,228,516.15	64,729,594.10
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	11,134,018.94	11,947,488.32
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以"-"填列）	-204,013.95	-1,378,567.92
其中：股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-204,013.95	-1,378,567.92
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	–	–
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	–	–
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	–	–
5.其他收入（损失以"-"号填列）	–	–
减：二、费用	11,262,740.26	17,002,249.38
1. 管理人报酬	7,022,762.38	7,927,059.35
2. 托管费	1,755,690.51	1,981,764.83
3. 销售服务费	455,634.23	544,028.75
4. 交易费用	–	–
5. 利息支出	1,873,865.41	6,313,666.93
其中：卖出回购金融资产支出	1,873,865.41	6,313,666.93
6. 税金及附加	45.13	–
7. 其他费用	154,742.60	235,729.52
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	102,983,221.77	186,080,644.72
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	102,983,221.77	186,080,644.72

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金

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）	8,020,226,016.73	–	8,020,226,016.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	102,983,221.77	102,983,221.77
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）	-3,480,883,059.00	–	-3,480,883,059.00
其中：1.基金申购款	102,983,221.77	–	102,983,221.77
2.基金赎回款	-3,583,866,280.77	–	-3,583,866,280.77
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）	–	-102,983,221.77	-102,983,221.77
五、期末所有者权益（基金净值）	4,539,342,957.73	–	4,539,342,957.73
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）	5,113,452,125.99	–	5,113,452,125.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	186,080,644.72	186,080,644.72
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）	4,808,969,413.71	–	4,808,969,413.71
其中：1.基金申购款	7,866,485,907.52	–	7,866,485,907.52
2.基金赎回款	-3,057,516,493.81	–	-3,057,516,493.81
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）	–	-186,080,644.72	-186,080,644.72
五、期末所有者权益（基金净值）	9,922,421,539.70	–	9,922,421,539.70

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

易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金(以下简称"本基金")根据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2014]988号《关于准予易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2017]1118号《关于易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达掌柜季季盈理财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，《易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金基金合同》于2017年6月15日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,372,790,138.48份基金份额，其中认购资金利息折合825.66份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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

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〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1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。

6.4.8.1.2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。

6.4.8.1.3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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1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	7,022,762.38	7,927,059.35
其中：支付销售机构的客户维护费	58,868.34	80,906.80

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2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	1,755,690.51	1,981,764.83

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.05%÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5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、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.3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			
	易方达掌柜季季盈理财债券A	易方达掌柜季季盈理财债券B	易方达掌柜季季盈理财债券C	合计
易方达基金管理有限公司	856.76	343,435.69	1,316.70	345,609.15
合计	856.76	343,435.69	1,316.70	345,609.15
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			
	易方达掌柜季季盈理财债券A	易方达掌柜季季盈理财债券B	易方达掌柜季季盈理财债券C	合计
易方达基金管理有限公司	2,774.79	385,060.57	4,628.92	392,464.28
合计	2,774.79	385,060.57	4,628.92	392,464.28

注：本基金A类基金份额销售服务费年费率为0.15%；B类基金份额销售服务费年费率为0.01%；C类基金份额销售服务费年费率为0.05%。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×销售服务费年费率÷当年天数

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日该类基金资产净值

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。

6.4.8.3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。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2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

易方达掌柜季季盈理财债券A

无。

易方达掌柜季季盈理财债券B

无。

易方达掌柜季季盈理财债券C

无。

6.4.8.5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
兴业银行-活期存款	2,856,550.32	128,349.46	1,046,840.74	100,888.15
兴业银行-定期存款	250,000,000.00	3,372,083.39	200,000,000.00	26,383,333.36

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

6.4.8.6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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1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。

6.4.9.2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。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1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251,041,674.48元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160313	16进出13	2019-07-01	100.09	200,000	20,018,214.06
190201	19国开01	2019-07-01	99.96	986,000	98,558,174.29
190301	19进出01	2019-07-01	99.87	1,100,000	109,861,319.28
190402	19农发02	2019-07-01	99.86	300,000	29,959,472.23
合计				2,586,000	258,397,179.86

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

6.4.9.3.2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为0，无抵押债券。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为2,059,397,148.61元，无属于第一或第三层次的余额(2018年12月31日：第二层次5,416,585,770.26元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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	固定收益投资	2,059,397,148.61	41.20
	其中：债券	2,059,397,148.61	41.20
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	2,927,786,550.32	58.57
4	其他各项资产	11,576,573.54	0.23
5	合计	4,998,760,272.47	100.00

7.2债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	2.31	
	其中：买断式回购融资	–	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	251,041,674.48	5.53
	其中：买断式回购融资	–	–

注：上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定"本基金在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%"，本报告期内本基金未发生超标情况。

7.3基金投资组合平均剩余期限

7.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	125
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	127
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金合同约定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过180天"，本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

7.3.2期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	2.48	5.53
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天（含）—60天	10.33	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天（含）—90天	56.00	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天（含）—120天	–	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天（含）—397天（含）	41.05	–
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	109.87	5.53

7.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金属于理财债券型基金，不适用本项目。

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	309,799,374.79	6.82
	其中：政策性金融债	309,799,374.79	6.82
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	20,062,213.32	0.44
6	中期票据	–	–
7	同业存单	1,729,535,560.50	38.10
8	其他	–	–
9	合计	2,059,397,148.61	45.37
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111903065	19农业银行CD065	5,000,000	496,891,216.66	10.95
2	111804071	18中国银行CD071	2,000,000	199,409,044.50	4.39
3	111812212	18北京银行CD212	2,000,000	197,329,242.26	4.35
4	111907099	19招商银行CD099	2,000,000	197,315,649.87	4.35
5	111993996	19徽商银行CD023	2,000,000	195,483,258.40	4.31
6	111918140	19华夏银行CD140	1,500,000	149,535,232.68	3.29
7	190201	19国开01	1,200,000	119,949,096.50	2.64
8	190301	19进出01	1,100,000	109,861,319.28	2.42
9	111812223	18北京银行CD223	1,000,000	98,491,092.35	2.17
10	111906095	19交通银行CD095	1,000,000	97,789,725.97	2.15

7.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1103%
报告期内偏离度的最低值	-0.0039%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0554%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

（1）基金持有的债券（包括票据）购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入，每日计提收益；

（2）基金持有的回购以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；

（3）基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.9.219交通银行CD095（代码：111906095）为易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2018年7月26日，中国人民银行针对交通银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户，罚款人民币130万元。2018年10月18日，上海保监局针对交通银行欺骗投保人、向投保人隐瞒与合同有关的重要情况的违法违规事实，责令改正，并处34万元罚款。2018年11月9日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司关于以下违规事实：（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力，处以罚款690万元人民币。2018年11月9日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位的违规事实，处以罚款50万元人民币。

19招商银行CD099（代码：111907099）为易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2018年7月5日，深圳保监局针对招商银行股份有限公司电话销售欺骗投保人罚款30万元。

19徽商银行CD023（代码：111993996）为易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2018年7月6日，中国人民银行合肥中心支行针对徽商银行股份有限公司违反收单银行结算账户管理相关法律制度规定的违法违规事实责令限期改正，给予警告，并处10万元罚款。2018年9月10日，安徽银监局针对徽商银行股份有限公司违规批量转让不良资产的违法违规事实罚款45万元。2018年12月26日，中国人民银行合肥中心支行针对徽商银行股份有限公司违反《非金融机构支付服务管理办法》相关规定的违法违规事实，给予警告并处1万元罚款。

19农业银行CD065（代码：111903065）为易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的前十大持仓证券。2019年5月7日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对中国农业银行股份有限公司信用卡中心2016年9月至2017年6月间部分信用卡资金违规用于非消费领域的违法违规事实，责令改正，并处罚款50万元。

本基金投资19交通银行CD095、19招商银行CD099、19徽商银行CD023、19农业银行CD065的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除19交通银行CD095、19招商银行CD099、19徽商银行CD023、19农业银行CD065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。

7.9.3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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	11,576,573.54
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	11,576,573.54

§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
易方达掌柜季季盈理财债券A	7,321	13,714.93	0.00	0.00%	100,406,972.17	100.00%
易方达掌柜季季盈理财债券B	11	403,345,229.23	4,436,797,521.51	100.00%	0.00	0.00%
易方达掌柜季季盈理财债券C	110	19,440.58	0.00	0.00%	2,138,464.05	100.00%
合计	7,442	609,962.77	4,436,797,521.51	97.74%	102,545,436.22	2.26%

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	易方达掌柜季季盈理财债券A	12,356.32	0.0123%
	易方达掌柜季季盈理财债券B	0.00	0.0000%
	易方达掌柜季季盈理财债券C	107,012.79	5.0042%
	合计	119,369.11	0.0026%

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	易方达掌柜季季盈理财债券A	0
	易方达掌柜季季盈理财债券B	0
	易方达掌柜季季盈理财债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达掌柜季季盈理财债券A	0
	易方达掌柜季季盈理财债券B	0
	易方达掌柜季季盈理财债券C	0
	合计	0

§9开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达掌柜季季盈理财债券A	易方达掌柜季季盈理财债券B	易方达掌柜季季盈理财债券C
基金合同生效日（2017年6月15日）基金份额总额	1,372,790,138.48	–	–
本报告期期初基金份额总额	188,064,118.06	7,824,329,238.06	7,832,660.61
本报告期基金总申购份额	2,078,186.68	100,827,891.12	77,143.97
减：本报告期基金总赎回份额	89,735,332.57	3,488,359,607.67	5,771,340.53
本报告期基金拆分变动份额	–	–	–
本报告期期末基金份额总额	100,406,972.17	4,436,797,521.51	2,138,464.05

§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。

自2019年1月22日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

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	
申万宏源	2	–	–	–	–	–

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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
申万宏源	–	–	3,304,100,000.00	100.00%	–	–

10.8偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§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	1,939,290,824.36	22,217,794.60	955,018,076.23	1,006,490,542.73	22.17%
	2	2019年03月05日~2019年03月28日	1,456,163,096.06	11,214,013.79	1,467,377,109.85	–	–
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，资产管理产品以摊余成本进行计量需满足产品为封闭式产品等条件，本基金将在《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。

易方达基金管理有限公司
二〇一九年八月二十四日