

易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达恒盛 3 个月定开混合发起式
基金主代码	007884
交易代码	007884
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 6 日
报告期末基金份额总额	1,413,625,871.19 份
投资目标	在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭运作期与开放运作期采取不同的投资策略。封闭期本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场因素、估值及流动性因素、政策因素等分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。债券投资上主要通过久期配置、

	<p>类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。股票方面本基金将通过分析行业景气度、行业竞争格局等因素，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置的基础上，本基金将基于公司基本面分析和估值水平分析进行个股投资策略。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。开放运作期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2023年4月1日-2023年6月30日)
1.本期已实现收益	20,836,688.63
2.本期利润	20,383,828.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.0148

4.期末基金资产净值	1,483,364,145.97
5.期末基金份额净值	1.0493

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.50%	0.16%	0.99%	0.08%	0.51%	0.08%
过去六个月	5.58%	0.19%	2.33%	0.08%	3.25%	0.11%
过去一年	1.78%	0.20%	2.22%	0.10%	-0.44%	0.10%
过去三年	21.14%	0.21%	10.47%	0.12%	10.67%	0.09%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	24.54%	0.19%	14.99%	0.12%	9.55%	0.07%

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

易方达恒盛3个月定期开放混合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的历史走势对比图

（2019年9月6日至2023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 24.54%，同期业绩比较基准收益率为 14.99%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡剑	本基金的基金经理，易方达稳健收益债券、易方达信用债债券、易方达裕惠定开混合发起式、易方达岁丰添利债券（LOF）、易方达恒利3个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达高等级信用债债券的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员、基础设施资产管理委员会委员	2019-09-06	-	17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债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、固定收益投资业务总部总经理，易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达纯债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达纯债1年定期开放债券、易方达裕惠回报债券、易方达瑞财混合、

					易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达高等级信用债债券、易方达丰惠混合、易方达瑞富混合、易方达睿智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合、易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达富惠纯债债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开债券指数、易方达恒惠定开债券发起式、易方达科润混合（LOF）的基金经理。
纪玲云	本基金的基金经理，易方达信用债债券、易方达瑞财混合、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒裕一年定开债券发起式、易方达裕华利率债 3 个月定开债券、易方达裕兴 3 个月定开债券、易方达恒固 18 个月封闭式债券的基金经理，易方达稳健收益债券的基金经理助理，固定收益分类资产研究管理部总经理	2019-09-06	-	14 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、投资经理助理、固定收益研究部总经理助理、固定收益分类资产研究管理部负责人、投资经理，易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达科润混合（LOF）的基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共15次，其中14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 报告期内基金投资策略和运作分析

在经历了一季度的平稳复苏之后，国内经济基本面在二季度走弱。首先，以社会消费品零售总额数据为代表的消费端复苏呈现边际走弱的迹象。社会消费品零售总额的环比增速在3月份表现出向上修复动力不足的情况，4-5月份则进一步回落，较疫情之前的增长缺口重新扩大。结构上看限额以下的零售恢复情况更差，表明中低端的消费意愿恢复不足，后续还存在较多的恢复空间。其次，地产数据4-5月份出现显著下行，同比2019年的数据基本回到2022年四季度的低点，新开工和投资数据同样大幅下滑。第三，我们在4月份看到工业生产的数据较需求下滑更快，虽然5月份有所恢复，但是产能利用率偏低、库存偏高、利润率低等问题没有改善，这使得未来一段时间，经济可能持续面临企业主动去库存的不利影响。第四，基建和制造业投资增速在4-5月份也出现边际回落的情况。

政策面延续了相对平稳的节奏，围绕推动高质量发展、加快建设以实体经济为支撑的现代化产业体系推出相关政策。银行间资金面整体保持平稳宽松。央行降息，引导金融体系利率水平下行，加大对实体经济的支持力度。

从债券市场的表现来看，二季度收益率下行以利率债为主导，呈现小幅陡峭

化的走势。1-5年国开收益率下行 28-29BP，7-10年国开收益率下行 24-25BP，超长端 20年国开收益率下行 14BP。信用债收益率基本跟随利率债下行，级别利差略有扩大。4-5年的 AA+信用债收益率仅下行 13-16BP，较 AAA 信用债的利差扩大 8-14BP，1年、2年 AA(2)的城投收益率也仅分别下行 18BP 和 22BP。权益市场振荡下跌。沪深 300 指数下跌 5.15%，创业板指数下跌 7.69%。行业方面，通信继续上涨 16.3%，传媒、家用电器、公用事业、机械设备、国防军工、汽车获取正收益，其余行业均为负收益，其中商贸零售、食品饮料、建筑材料、美容护理、农林牧渔、基础化工等行业下跌较多，跌幅达到 10% 以上。可转债表现相对较好，中证转债指数仅下跌 0.15%。

操作上，组合基本维持了不高的权益仓位，积极增加债券久期。从变化上看，可转债仓位维持，股票仓位在 5 月中旬有小幅降低，债券久期在 4 月下旬提升至偏长水平。综合来看，不高的权益仓位使得组合二季度受股票市场负面影响较为有限，同时债券获取了较好的资本利得收益，对股票市场形成了较好的对冲。组合在二季度获取了稳健的、有竞争力的投资回报。

4.5 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 1.0493 元，本报告期份额净值增长率为 1.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期，本基金均存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期，本基金均存在连续六十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	177,416,544.17	6.69
	其中：股票	177,416,544.17	6.69

2	固定收益投资	2,424,265,958.21	91.42
	其中：债券	2,313,236,400.64	87.24
	资产支持证券	111,029,557.57	4.19
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	47,191,932.13	1.78
7	其他资产	2,832,673.95	0.11
8	合计	2,651,707,108.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,147,323.00	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	121,229,249.21	8.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	2,986,740.15	0.20
F	批发和零售业	87,400.25	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	28,824,027.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,211,684.05	0.89
J	金融业	4,115,747.40	0.28
K	房地产业	3,304,138.08	0.22
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,436,178.13	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	177,416,544.17	11.96

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600018	上港集团	2,335,600	12,261,900.00	0.83
2	600660	福耀玻璃	231,000	8,281,350.00	0.56
3	601728	中国电信	1,462,311	8,232,810.93	0.56
4	601298	青岛港	1,102,800	7,686,516.00	0.52
5	601799	星宇股份	57,800	7,144,080.00	0.48
6	601598	中国外运	1,493,600	6,960,176.00	0.47
7	300760	迈瑞医疗	22,600	6,775,480.00	0.46
8	603596	伯特利	79,100	6,269,466.00	0.42
9	600519	贵州茅台	3,700	6,256,700.00	0.42
10	600685	中船防务	207,600	6,217,620.00	0.42

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	722,136,458.89	48.68
	其中：政策性金融债	32,216,095.89	2.17
4	企业债券	440,166,927.77	29.67
5	企业短期融资券	76,117,575.37	5.13
6	中期票据	886,956,579.76	59.79
7	可转债（可交换债）	165,886,673.06	11.18

8	同业存单	-	-
9	其他	21,972,185.79	1.48
10	合计	2,313,236,400.64	155.95

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	2128025	21 建设银行二级 01	1,100,000	114,892,287.67	7.75
2	2128042	21 兴业银行二级 02	800,000	82,951,732.60	5.59
3	115273	23 海通 08	700,000	70,808,202.74	4.77
4	2128032	21 兴业银行二级 01	500,000	52,415,117.81	3.53
5	102282071	22 大唐集 MTN006(能源保供特别债)	500,000	50,873,797.26	3.43

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	199272	23 北辰 A	200,000	20,310,027.40	1.37
2	199694	G23XH 优	200,000	20,119,438.90	1.36
3	193933	和皖 A	100,000	10,238,883.05	0.69
4	183148	G 国电优	100,000	10,231,152.88	0.69
5	180926	铁托 7 优	100,000	10,095,482.74	0.68
6	199430	23 济建优	100,000	10,044,178.08	0.68
7	180961	耘睿 023A	100,000	10,000,895.89	0.67
8	135541	荟臻 023A	100,000	9,999,624.66	0.67
9	112006	耘睿 031A	100,000	9,989,873.97	0.67

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，大唐国际发电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京市石景山区市场监管局、河北省市场监管局的处罚。山西焦煤集团有限责任公司在报告编制日前一年内曾受到北京市西城区卫生健康委员会、古交市林业局、古交市水务局、山西省应急管理厅、太原市生态环境局古交分局、太原市应急管理局、西城区消防救援支队的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中信建投证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	71,153.55
2	应收证券清算款	2,761,520.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,832,673.95

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	123165	回天转债	3,591,050.21	0.24
2	118020	芳源转债	3,521,252.93	0.24
3	127060	湘佳转债	3,226,028.04	0.22
4	123146	中环转2	2,766,574.28	0.19
5	127025	冀东转债	2,694,960.15	0.18
6	110064	建工转债	2,593,451.45	0.17
7	127052	西子转债	2,571,941.30	0.17
8	113044	大秦转债	2,552,907.23	0.17
9	127055	精装转债	2,516,842.16	0.17
10	127018	本钢转债	2,512,488.42	0.17
11	113640	苏利转债	2,364,247.48	0.16
12	127075	百川转2	2,358,330.18	0.16
13	123160	泰福转债	2,348,835.96	0.16
14	113649	丰山转债	2,310,097.21	0.16
15	127044	蒙娜转债	2,271,111.86	0.15
16	123120	隆华转债	2,233,166.47	0.15
17	113629	泉峰转债	2,232,477.39	0.15
18	113604	多伦转债	2,196,195.88	0.15
19	127042	嘉美转债	2,168,846.30	0.15
20	127045	牧原转债	2,146,815.82	0.14
21	127047	帝欧转债	2,106,001.81	0.14
22	123147	中辰转债	2,094,673.81	0.14
23	127027	能化转债	2,072,164.52	0.14
24	118011	银微转债	2,014,433.91	0.14
25	127040	国泰转债	2,001,685.08	0.13
26	127061	美锦转债	1,956,302.78	0.13
27	113636	甬金转债	1,948,850.79	0.13
28	113637	华翔转债	1,915,443.32	0.13
29	123132	回盛转债	1,845,390.77	0.12
30	113017	吉视转债	1,831,947.43	0.12
31	110087	天业转债	1,755,897.34	0.12
32	113656	嘉诚转债	1,751,997.70	0.12

33	111009	盛泰转债	1,747,242.67	0.12
34	123172	漱玉转债	1,707,823.38	0.12
35	113653	永22转债	1,695,514.20	0.11
36	123151	康医转债	1,678,963.72	0.11
37	128037	岩土转债	1,660,631.75	0.11
38	127078	优彩转债	1,598,935.30	0.11
39	118022	锂科转债	1,594,971.01	0.11
40	123085	万顺转2	1,583,430.99	0.11
41	123162	东杰转债	1,577,980.42	0.11
42	110080	东湖转债	1,555,029.33	0.10
43	113574	华体转债	1,552,328.09	0.10
44	123064	万孚转债	1,533,181.51	0.10
45	128105	长集转债	1,532,551.57	0.10
46	118028	会通转债	1,528,877.80	0.10
47	113059	福莱转债	1,504,946.14	0.10
48	123056	雪榕转债	1,501,503.56	0.10
49	113659	莱克转债	1,498,266.99	0.10
50	118024	冠宇转债	1,497,769.01	0.10
51	118006	阿拉转债	1,477,601.68	0.10
52	128026	众兴转债	1,475,407.82	0.10
53	118029	富淼转债	1,462,799.57	0.10
54	113665	汇通转债	1,428,663.26	0.10
55	113610	灵康转债	1,386,725.40	0.09
56	127068	顺博转债	1,385,285.61	0.09
57	128127	文科转债	1,376,513.82	0.09
58	113641	华友转债	1,374,298.92	0.09
59	123072	乐歌转债	1,354,946.21	0.09
60	113632	鹤21转债	1,350,189.45	0.09
61	127033	中装转2	1,349,366.61	0.09
62	113549	白电转债	1,320,250.95	0.09
63	127073	天赐转债	1,300,399.90	0.09
64	127053	豪美转债	1,299,729.52	0.09
65	113619	世运转债	1,210,255.14	0.08
66	110089	兴发转债	1,181,387.24	0.08
67	123163	金沃转债	1,158,570.06	0.08
68	113048	晶科转债	1,158,426.77	0.08
69	123080	海波转债	1,104,569.07	0.07
70	123099	普利转债	1,093,076.59	0.07
71	113519	长久转债	1,077,280.24	0.07
72	118023	广大转债	1,071,435.25	0.07
73	118010	洁特转债	1,006,028.40	0.07
74	113600	新星转债	1,005,270.27	0.07
75	110086	精工转债	993,615.33	0.07

76	113051	节能转债	978,638.05	0.07
77	123154	火星转债	957,177.97	0.06
78	110084	贵燃转债	947,512.54	0.06
79	111003	聚合转债	819,802.42	0.06
80	113644	艾迪转债	790,575.35	0.05
81	123171	共同转债	781,491.60	0.05
82	123119	康泰转2	772,573.11	0.05
83	128021	兄弟转债	730,434.08	0.05
84	111002	特纸转债	684,571.24	0.05
85	123127	耐普转债	648,612.82	0.04
86	123161	强联转债	605,246.07	0.04
87	113054	绿动转债	596,560.75	0.04
88	127019	国城转债	595,875.29	0.04
89	123144	裕兴转债	570,351.07	0.04
90	111001	山玻转债	501,872.80	0.03
91	123087	明电转债	479,389.34	0.03
92	123103	震安转债	430,039.24	0.03
93	118015	芯海转债	406,625.23	0.03
94	123166	蒙泰转债	333,397.38	0.02
95	113647	禾丰转债	227,058.15	0.02
96	123158	宙邦转债	130,502.83	0.01
97	123082	北陆转债	101,881.63	0.01
98	127032	苏行转债	713.97	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601298	青岛港	7,686,516.00	0.52	重大事项停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,238,633,285.05
报告期期间基金总申购份额	188,198,927.68
减：报告期期间基金总赎回份额	13,206,341.54
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少）	-

以“-”填列)	
报告期期末基金份额总额	1,413,625,871.19

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 报告期末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	-	-	10,000,000.00	0.7074%	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	-	-	10,000,000.00	0.7074%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满3年，发起份额已全部赎回。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2023年04月01日~2023年06月30日	1,036,344,694.54	0.00	0.00	1,036,344,694.54	73.31%
	2	2023年04月19日~2023年06月30日	182,082,119.14	188,198,927.26	0.00	370,281,046.40	26.19%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，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；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，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，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权终止基金合同；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、定期开放运作的风险

(1) 本基金以定期开放方式运作且不上市交易，投资者仅可在开放运作期申赎基金份额，在封闭运作期内无法申购赎回。若投资者在开放运作期末赎回基金份额，则需继续持有至下一封闭运作期结束才能赎回，投资者在封闭运作期内存在无法赎回基金份额的风险。

(2) 基金合同生效后的首个运作期为封闭运作期，自基金合同生效日至基金管理人规定的时间，首个封闭运作期可能少于或者超过3个月，投资者应仔细阅读相关法律文件及公告，并及时行使相关权利。

(3) 除首个运作期封闭运作外，本基金的运作期包含“封闭运作期”和“开放运作期”，运作期期限3个月，基金管理人在每个封闭运作期结束前公布开放运作期和下一封闭运作期的具体时间安排，由于市场环境等因素的影响，本基金每次开放运作期和封闭运作期的时间及长度不完全一样，投资者应关注相关公告并及时行使权利，否则会面临无法申购/赎回基金份额的风险。

2、单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过50%的风险

(1) 本基金单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可

达到或者超过 50%，单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者大额赎回时，可能会对本基金资产运作及净值表现产生较大影响。

（2）巨额赎回的风险

相对于其他基金，本基金更可能因开放期内单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者集中大额赎回发生巨额赎回。当发生巨额赎回时，基金管理人可能根据基金当时的资产组合状况决定延缓支付赎回款，投资者面临赎回款被延缓支付的风险。

3、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同的风险

本基金的销售对象主要为机构投资者，不向个人投资者公开发售，基金持续营销可能受到影响。本基金基金合同生效满三年后继续存续的，若连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于 5000 万元情形，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。投资者面临转换基金运作方式、与其他基金合并的风险。

《基金合同》生效满三年后的存续期内，若连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权终止基金合同。若管理人与托管人根据实际情况决定终止基金合同，本基金面临终止清盘的风险。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达恒盛 3 个月定期开放混合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。

10.2 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。

10.3 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

二〇二三年七月二十日