

易方达双债增强债券型证券投资基金

2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 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

报告送出日期：二〇二四年四月二十日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 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 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 7,547,585,191.92 份 |
| 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。 | |
| 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 | |
| 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 | 6,196,275,663.51 份 | 1,351,309,528.41 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日) | |
|-----------|---|----------------|
| | 易方达双债增强债券 A | 易方达双债增强债券 C |
| 1.本期已实现收益 | 77,127,914.11 | 14,980,287.68 |
| 2.本期利润 | 84,976,009.80 | 21,659,512.57 |

| | | |
|----------------|-------------------|------------------|
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0117 | 0.0164 |
| 4.期末基金资产净值 | 10,628,825,376.40 | 2,243,681,522.02 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.715 | 1.660 |

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

易方达双债增强债券 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 0.76% | 0.37% | 0.44% | 0.19% | 0.32% | 0.18% |
| 过去六个月 | 0.41% | 0.31% | -0.28% | 0.19% | 0.69% | 0.12% |
| 过去一年 | 0.59% | 0.24% | 0.08% | 0.16% | 0.51% | 0.08% |
| 过去三年 | 20.89% | 0.28% | 5.59% | 0.20% | 15.30% | 0.08% |
| 过去五年 | 53.05% | 0.42% | 10.36% | 0.21% | 42.69% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 139.63% | 0.31% | 20.84% | 0.42% | 118.79% | -0.11% |

易方达双债增强债券 C

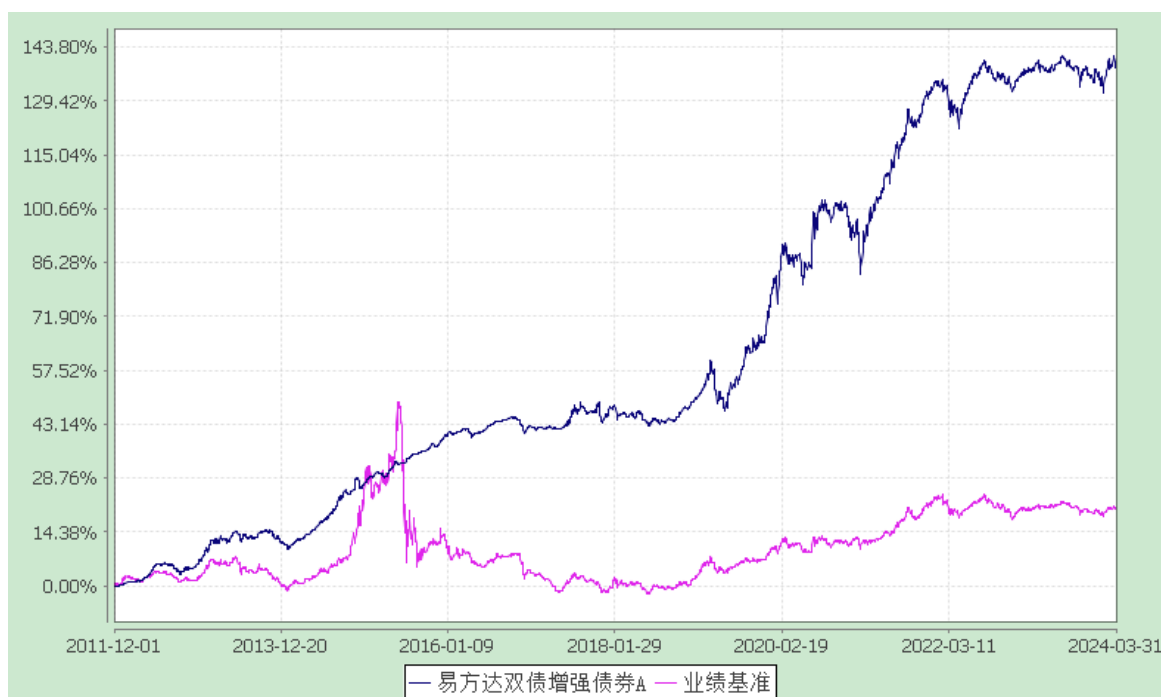
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.67% | 0.37% | 0.44% | 0.19% | 0.23% | 0.18% |
| 过去六个月 | 0.24% | 0.31% | -0.28% | 0.19% | 0.52% | 0.12% |
| 过去一年 | 0.18% | 0.24% | 0.08% | 0.16% | 0.10% | 0.08% |
| 过去三年 | 19.37% | 0.28% | 5.59% | 0.20% | 13.78% | 0.08% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|--------|
| 过去五年 | 50.31% | 0.42% | 10.36% | 0.21% | 39.95% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 128.66% | 0.31% | 20.84% | 0.42% | 107.82% | -0.11% |

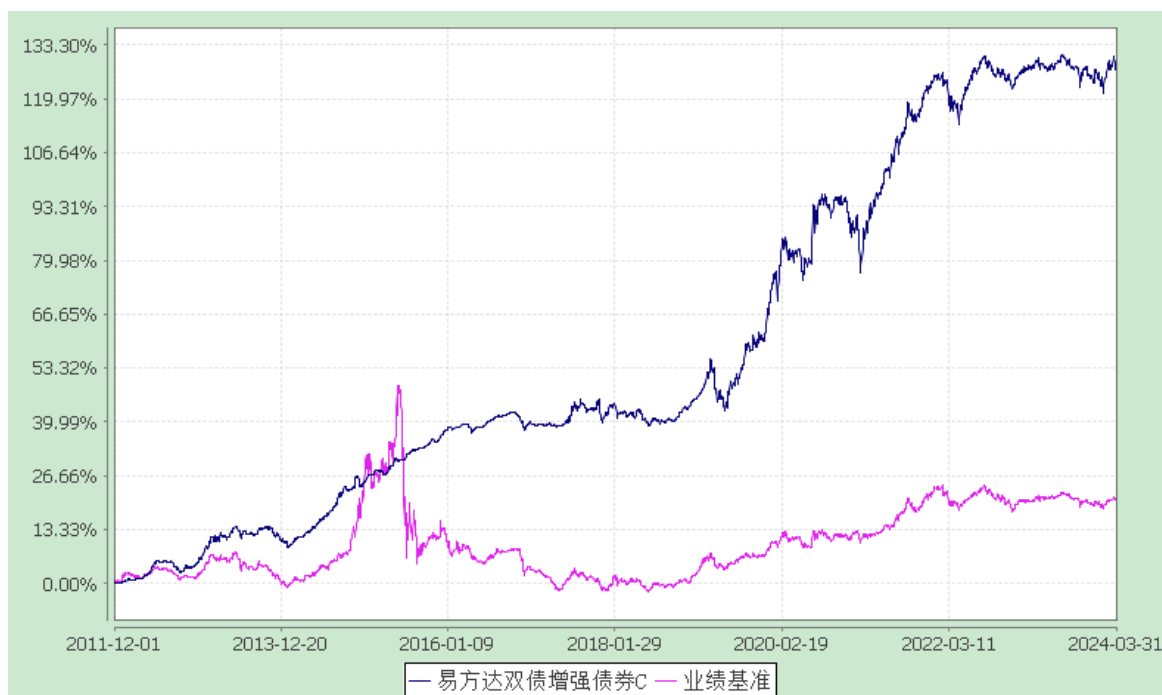
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达双债增强债券型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2011 年 12 月 1 日至 2024 年 3 月 31 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 139.63%，同期业绩比较基准收益率为 20.84%；C 类基金份额净值增长率为 128.66%，同期业绩比较基准收益率为 20.84%。

§ 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 | | |
| 王晓晨 | 本基金的基金经理，易方达增强回报债券、易方达投资级信用债债券、易方达安瑞短债债券、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式、易方达裕祥回报债券、易方达安泽 180 天持有债券的基金经理，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 | 2016-12-03 | - | 21 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、固定收益基金投资部副总经理、固定收益投资部副总经理，易方达货币、易方达保证金货币、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达保本一号混合、易方达中债 |

| | | | | | |
|----|--|------------|---|-----|--|
| | | | | | 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开债债券指数、易方达纯债债券、易方达恒益定开债券发起式、易方达新鑫混合、易方达恒安定开债券发起式、易方达富财纯债债券、易方达中债 1-3 年期国开债债券指数、易方达中债 3-5 年期国开债债券指数、易方达中债 1-3 年政金债指数、易方达中债 3-5 年政金债指数的基金经理,易方达资产管理(香港)有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员 (RO)、提供资产管理负责人员 (RO)。 |
| 田鑫 | 本基金的基金经理,易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达稳健收益债券、易方达裕惠定开混合发起式、易方达裕如混合、易方达裕祥回报债券、易方达增强回报债券、易方达安益 90 天持有债券、易方达岁丰添利债券 (LOF) 的基金经理助理,固定收益分类资产研究管理部总经理助理、固定收益研究员 | 2023-01-11 | - | 7 年 | 硕士研究生,具有基金从业资格。曾任普特南投资管理公司量化分析师,上海壹账通金融科技有限公司高级数据挖掘工程师,易方达基金管理有限公司投资经理助理。 |

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,“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 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，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 10 次，其中 8 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，2 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

一季度经济数据较去年四季度回升。生产端稳中有升，1-2 月规模以上工业增加值同比增长 7.0%，比去年 12 月加快 0.2%。需求端景气改善，1-2 月出口环比超季节性上升，制造业投资和基建投资维持较高增速，地产投资环比大幅反弹；1-2 月社会消费品零售总额同比增长 5.5%，其中服务零售额同比增长 12.3%，市场销售继续恢复，节假日推动服务消费升温。价格方面，1-2 月核心通胀有回暖迹象，PPI（生产者价格指数）低位运行。总体看，开年经济运行起步平稳，但出口向上弹性有不确定性，国内有效需求不足等问题仍然存在，经济恢复的基础仍需进一步巩固。

政策方面，2024 年政府工作报告强调大力推进现代化产业体系建设，加快发展新质生产力，着力扩大国内需求，坚定不移深化改革，扩大高水平对外开放，有效防范化解重点领域风险等。中国人民银行行长潘功胜表示，国内外的形势依然复杂多变，需要发挥政策合力，加大宏观调控的政策力度。货币政策主要有几方面的考虑：一是在总量上保持合理增长，二是在价格上将继续推动社会综合融资成本稳中有降，三是在结构上要更加注重提升效能，四是在汇率上将保持在合理均衡水平上的基本稳定。

财政政策方面，今年广义财政预算有所扩张，延续了中央经济工作会议要求，积极的财政政策要适度加力、提质增效。

市场表现方面，债券收益率一季度整体下行。资金方面，一季度 R007（银行间 7 天质押式回购利率）平均水平较去年四季度有所下行。现券方面，伴随开年以来资金预期较为宽松等原因，债券收益率趋势下行，3 月末 10 年期国债收益率收于 2.29%，10 年期国开债收益率收于 2.42%，均较 2023 年四季度末下行接近 27bp；信用利差中枢持续下行，3 年期 AAA 级中短票收益率较 2023 年四季度末下行 21bp，利差压缩 5bp 左右，中低评级信用利差压缩程度稍高，3 年期 AA 级中短票利差压缩 9bp。

股票方面，一季度股票市场波动较大，表现分化。沪深 300 指数上涨 3.1%，中证 1000 指数下跌 7.58%，创业板指数下跌 7.79%。一季度申万行业中银行、石油石化、煤炭涨幅靠前，医药生物、计算机、电子领跌。

转债方面，由于转债正股价格大幅波动，转债平价和估值大幅下跌。期间转债债性估值已经达到 2018 年以来极值，转债到期收益率大幅超越同期限信用债。转债估值安全边际足够高，无需再担心转债正股波动路径。转债正股实际波动率和隐含波动率利差回到了 2019 到 2020 年，期权定价模型看转债理论弹性收益大幅提高。从转债期权估值角度看转债处于极高的非对称性收益状态，转债资产回撤有限，向上有较大弹性空间，资产处于高胜率和高赔率状态，相对纯债配置价值高。大量行为金融学的文献研究显示人类的大脑在进化的过程中，会有非常多的心理偏差，比如线性外推、损失厌恶、羊群效应、易被恐惧支配等。这些偏差在人类进化的过程中，是有利于个体和种群的生存的。但在投资的行业里面，这些心理偏差会造成极大的定价偏差。而当前，我认为这就是转债资产正在发生的事情。基于资产理性定价，站在市场对立面逆向思考，组合大幅提高了可转债仓位。

报告期内，组合基于对经济基本面走势的判断，积极应对并调整资产配置。操作方面，组合大幅提高了可转债仓位，超配期权价值低估的平衡型和偏债型转债，提高了组合在期权维度 Gamma 和 Vega 暴露。一季度组合在去年四季度中后段提高的债券仓位基础上，结合市场变化小幅调整仓位和久期，并根据相对价值变化不断优化券种结构。本基金将坚持稳健投资的原则，力争以优异的业绩回报基金持有人。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.715 元，本报告期份额净值增长率

为 0.76%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%；C 类基金份额净值为 1.660 元，本报告期份额净值增长率为 0.67%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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 | 266,207,170.93 | 1.54 |
| | 其中：股票 | 266,207,170.93 | 1.54 |
| 2 | 固定收益投资 | 16,858,750,225.29 | 97.79 |
| | 其中：债券 | 16,858,750,225.29 | 97.79 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 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 | 100,654,929.19 | 0.58 |
| 7 | 其他资产 | 14,398,086.58 | 0.08 |
| 8 | 合计 | 17,240,010,411.99 | 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 | - | - |

| | | | |
|---|------------------|----------------|------|
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 178,646,575.02 | 1.39 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 20,363,983.15 | 0.16 |
| E | 建筑业 | 5,784,932.25 | 0.04 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 41,663,826.70 | 0.32 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 19,747,853.81 | 0.15 |
| 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 | 266,207,170.93 | 2.07 |

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 | 601111 | 中国国航 | 5,500,447 | 40,153,263.10 | 0.31 |
| 2 | 000301 | 东方盛虹 | 3,327,674 | 33,542,953.92 | 0.26 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 1,005,719 | 28,059,560.10 | 0.22 |
| 4 | 000401 | 冀东水泥 | 4,604,356 | 24,679,348.16 | 0.19 |
| 5 | 002078 | 太阳纸业 | 1,409,700 | 20,525,232.00 | 0.16 |
| 6 | 601985 | 中国核电 | 2,215,885 | 20,363,983.15 | 0.16 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 1,532,029 | 19,747,853.81 | 0.15 |
| 8 | 002831 | 裕同科技 | 788,398 | 19,544,386.42 | 0.15 |
| 9 | 000887 | 中鼎股份 | 1,211,105 | 13,903,485.40 | 0.11 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 10 | 603681 | 永冠新材 | 976,782 | 12,444,202.68 | 0.10 |
|----|--------|------|---------|---------------|------|

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 | 6,005,382,207.65 | 46.65 |
| | 其中：政策性金融债 | 679,156,718.30 | 5.28 |
| 4 | 企业债券 | 1,293,032,341.49 | 10.04 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 2,230,735,100.66 | 17.33 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 7,329,600,575.49 | 56.94 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 16,858,750,225.29 | 130.97 |

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 | 092280033 | 22 宁波银行二级资本债 01 | 5,200,000 | 541,199,121.31 | 4.20 |
| 2 | 092280014 | 22 上海银行二级资本债 01 | 5,100,000 | 538,179,645.90 | 4.18 |
| 3 | 092280134 | 22 工行二级资本债 04A | 4,000,000 | 410,510,819.67 | 3.19 |
| 4 | 092280080 | 22 光大银行二级资本债 01A | 3,300,000 | 341,363,901.64 | 2.65 |
| 5 | 282380002 | 23 太保寿险永续债 01 | 3,200,000 | 331,912,743.17 | 2.58 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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，北京农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局宁波监管局、国家外汇管理局宁波市分局的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。中国太平洋人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局的处罚。

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 | 293,049.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,529,804.97 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,575,232.37 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 14,398,086.58 |

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 | 127045 | 牧原转债 | 208,262,327.80 | 1.62 |
| 2 | 110079 | 杭银转债 | 152,495,647.25 | 1.18 |
| 3 | 113062 | 常银转债 | 120,838,359.41 | 0.94 |
| 4 | 113059 | 福莱转债 | 104,885,722.48 | 0.81 |
| 5 | 110085 | 通 22 转债 | 103,811,769.48 | 0.81 |
| 6 | 118034 | 晶能转债 | 98,908,209.15 | 0.77 |
| 7 | 113666 | 爱玛转债 | 87,846,620.65 | 0.68 |
| 8 | 118030 | 睿创转债 | 81,328,644.58 | 0.63 |
| 9 | 127049 | 希望转 2 | 80,830,010.07 | 0.63 |
| 10 | 110093 | 神马转债 | 78,041,659.82 | 0.61 |
| 11 | 113049 | 长汽转债 | 72,036,033.23 | 0.56 |
| 12 | 110089 | 兴发转债 | 70,431,528.84 | 0.55 |
| 13 | 127040 | 国泰转债 | 68,402,950.61 | 0.53 |
| 14 | 127073 | 天赐转债 | 64,625,328.71 | 0.50 |
| 15 | 113602 | 景 20 转债 | 63,093,670.89 | 0.49 |
| 16 | 128141 | 旺能转债 | 62,667,744.00 | 0.49 |
| 17 | 113045 | 环旭转债 | 61,485,768.98 | 0.48 |
| 18 | 118038 | 金宏转债 | 61,442,247.65 | 0.48 |
| 19 | 127061 | 美锦转债 | 61,042,698.35 | 0.47 |
| 20 | 127030 | 盛虹转债 | 60,908,811.42 | 0.47 |
| 21 | 123216 | 科顺转债 | 58,349,900.28 | 0.45 |
| 22 | 123170 | 南电转债 | 58,143,417.52 | 0.45 |
| 23 | 127027 | 能化转债 | 57,953,396.47 | 0.45 |
| 24 | 113627 | 太平转债 | 57,433,844.23 | 0.45 |
| 25 | 113636 | 甬金转债 | 55,356,516.04 | 0.43 |
| 26 | 118003 | 华兴转债 | 53,979,168.31 | 0.42 |
| 27 | 113051 | 节能转债 | 53,970,256.30 | 0.42 |
| 28 | 127066 | 科利转债 | 53,970,043.10 | 0.42 |
| 29 | 127070 | 大中转债 | 53,416,600.02 | 0.41 |
| 30 | 118023 | 广大转债 | 53,315,252.67 | 0.41 |
| 31 | 127050 | 麒麟转债 | 50,913,563.59 | 0.40 |
| 32 | 113064 | 东材转债 | 50,442,370.43 | 0.39 |
| 33 | 128081 | 海亮转债 | 49,945,039.29 | 0.39 |
| 34 | 111000 | 起帆转债 | 49,217,204.37 | 0.38 |
| 35 | 110095 | 双良转债 | 48,975,195.96 | 0.38 |
| 36 | 127082 | 亚科转债 | 48,287,643.43 | 0.38 |
| 37 | 127043 | 川恒转债 | 47,957,046.81 | 0.37 |
| 38 | 113549 | 白电转债 | 46,231,934.71 | 0.36 |

| | | | | |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 39 | 123184 | 天阳转债 | 46,040,880.63 | 0.36 |
| 40 | 123169 | 正海转债 | 45,941,960.85 | 0.36 |
| 41 | 127088 | 赫达转债 | 45,852,263.87 | 0.36 |
| 42 | 118005 | 天奈转债 | 44,808,084.76 | 0.35 |
| 43 | 127047 | 帝欧转债 | 44,599,634.66 | 0.35 |
| 44 | 113623 | 凤 21 转债 | 44,502,449.08 | 0.35 |
| 45 | 113669 | 景 23 转债 | 44,447,643.86 | 0.35 |
| 46 | 123151 | 康医转债 | 43,677,433.15 | 0.34 |
| 47 | 127053 | 豪美转债 | 43,202,443.10 | 0.34 |
| 48 | 113656 | 嘉诚转债 | 43,180,945.81 | 0.34 |
| 49 | 127076 | 中宠转 2 | 43,102,851.07 | 0.33 |
| 50 | 123133 | 佩蒂转债 | 43,038,167.27 | 0.33 |
| 51 | 123178 | 花园转债 | 42,978,545.95 | 0.33 |
| 52 | 123161 | 强联转债 | 42,813,880.84 | 0.33 |
| 53 | 123208 | 孩王转债 | 42,747,465.32 | 0.33 |
| 54 | 123204 | 金丹转债 | 40,971,396.75 | 0.32 |
| 55 | 113668 | 鹿山转债 | 40,872,207.71 | 0.32 |
| 56 | 123149 | 通裕转债 | 40,582,698.81 | 0.32 |
| 57 | 127084 | 柳工转 2 | 39,612,937.20 | 0.31 |
| 58 | 113061 | 拓普转债 | 39,324,684.00 | 0.31 |
| 59 | 127069 | 小熊转债 | 39,084,975.01 | 0.30 |
| 60 | 113677 | 华懋转债 | 38,854,514.28 | 0.30 |
| 61 | 118013 | 道通转债 | 38,456,647.94 | 0.30 |
| 62 | 113655 | 欧 22 转债 | 38,439,209.74 | 0.30 |
| 63 | 113676 | 荣 23 转债 | 37,822,428.93 | 0.29 |
| 64 | 113651 | 松霖转债 | 37,485,716.66 | 0.29 |
| 65 | 118042 | 奥维转债 | 37,399,210.35 | 0.29 |
| 66 | 123193 | 海能转债 | 37,263,239.98 | 0.29 |
| 67 | 123205 | 大叶转债 | 36,119,296.68 | 0.28 |
| 68 | 127074 | 麦米转 2 | 35,883,872.56 | 0.28 |
| 69 | 110087 | 天业转债 | 35,819,003.84 | 0.28 |
| 70 | 118032 | 建龙转债 | 35,195,205.83 | 0.27 |
| 71 | 127067 | 恒逸转 2 | 35,064,952.82 | 0.27 |
| 72 | 113653 | 永 22 转债 | 35,039,823.10 | 0.27 |
| 73 | 128044 | 岭南转债 | 34,609,772.80 | 0.27 |
| 74 | 128144 | 利民转债 | 34,529,006.56 | 0.27 |
| 75 | 127077 | 华宏转债 | 34,459,825.45 | 0.27 |
| 76 | 128132 | 交建转债 | 34,357,285.67 | 0.27 |
| 77 | 123119 | 康泰转 2 | 34,344,701.44 | 0.27 |
| 78 | 128109 | 楚江转债 | 34,163,670.08 | 0.27 |
| 79 | 123202 | 祥源转债 | 34,095,346.60 | 0.26 |
| 80 | 113647 | 禾丰转债 | 33,922,132.02 | 0.26 |
| 81 | 127042 | 嘉美转债 | 33,730,376.74 | 0.26 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|---------------|------|
| 82 | 128066 | 亚泰转债 | 33,286,466.57 | 0.26 |
| 83 | 123124 | 晶瑞转 2 | 33,267,992.62 | 0.26 |
| 84 | 113048 | 晶科转债 | 32,977,909.30 | 0.26 |
| 85 | 118029 | 富淼转债 | 32,869,232.92 | 0.26 |
| 86 | 111015 | 东亚转债 | 32,851,434.50 | 0.26 |
| 87 | 118040 | 宏微转债 | 32,833,344.31 | 0.26 |
| 88 | 123113 | 仙乐转债 | 32,362,726.23 | 0.25 |
| 89 | 128097 | 奥佳转债 | 31,902,965.44 | 0.25 |
| 90 | 127044 | 蒙娜转债 | 31,550,567.13 | 0.25 |
| 91 | 123182 | 广联转债 | 31,525,372.18 | 0.24 |
| 92 | 113675 | 新 23 转债 | 31,261,075.32 | 0.24 |
| 93 | 123121 | 帝尔转债 | 31,258,495.49 | 0.24 |
| 94 | 123132 | 回盛转债 | 31,018,784.98 | 0.24 |
| 95 | 113641 | 华友转债 | 30,974,824.21 | 0.24 |
| 96 | 113582 | 火炬转债 | 30,749,825.43 | 0.24 |
| 97 | 123131 | 奥飞转债 | 30,637,906.78 | 0.24 |
| 98 | 123175 | 百畅转债 | 30,232,064.44 | 0.23 |
| 99 | 113625 | 江山转债 | 29,000,770.42 | 0.23 |
| 100 | 123191 | 智尚转债 | 28,844,976.95 | 0.22 |
| 101 | 113673 | 岱美转债 | 28,201,425.91 | 0.22 |
| 102 | 110063 | 鹰 19 转债 | 27,373,720.33 | 0.21 |
| 103 | 123183 | 海顺转债 | 27,007,304.17 | 0.21 |
| 104 | 127062 | 垒知转债 | 26,903,972.90 | 0.21 |
| 105 | 113569 | 科达转债 | 26,558,898.07 | 0.21 |
| 106 | 123212 | 立中转债 | 25,701,643.90 | 0.20 |
| 107 | 123199 | 山河转债 | 25,626,842.71 | 0.20 |
| 108 | 111008 | 沿浦转债 | 25,517,730.28 | 0.20 |
| 109 | 123172 | 漱玉转债 | 25,286,228.74 | 0.20 |
| 110 | 113054 | 绿动转债 | 25,117,855.24 | 0.20 |
| 111 | 113631 | 皖天转债 | 24,897,809.50 | 0.19 |
| 112 | 123150 | 九强转债 | 24,754,077.21 | 0.19 |
| 113 | 123010 | 博世转债 | 24,355,679.96 | 0.19 |
| 114 | 123076 | 强力转债 | 24,140,990.28 | 0.19 |
| 115 | 118011 | 银微转债 | 23,821,801.25 | 0.19 |
| 116 | 123153 | 英力转债 | 23,515,068.86 | 0.18 |
| 117 | 111005 | 富春转债 | 22,681,033.18 | 0.18 |
| 118 | 127019 | 国城转债 | 22,373,585.30 | 0.17 |
| 119 | 113665 | 汇通转债 | 22,369,850.83 | 0.17 |
| 120 | 123108 | 乐普转 2 | 22,207,854.28 | 0.17 |
| 121 | 118041 | 星球转债 | 22,088,819.33 | 0.17 |
| 122 | 123215 | 铭利转债 | 22,070,521.56 | 0.17 |
| 123 | 113058 | 友发转债 | 21,789,638.12 | 0.17 |
| 124 | 123186 | 志特转债 | 21,392,735.47 | 0.17 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|---------------|------|
| 125 | 127078 | 优彩转债 | 21,351,651.06 | 0.17 |
| 126 | 113643 | 风语转债 | 21,344,747.40 | 0.17 |
| 127 | 113628 | 晨丰转债 | 21,251,159.55 | 0.17 |
| 128 | 113639 | 华正转债 | 20,845,332.28 | 0.16 |
| 129 | 123114 | 三角转债 | 20,836,200.20 | 0.16 |
| 130 | 123213 | 天源转债 | 20,743,488.42 | 0.16 |
| 131 | 110094 | 众和转债 | 20,735,723.89 | 0.16 |
| 132 | 123155 | 中陆转债 | 20,696,482.93 | 0.16 |
| 133 | 127007 | 湖广转债 | 19,530,303.54 | 0.15 |
| 134 | 123157 | 科蓝转债 | 19,395,374.25 | 0.15 |
| 135 | 123179 | 立高转债 | 19,223,494.79 | 0.15 |
| 136 | 123049 | 维尔转债 | 18,569,153.60 | 0.14 |
| 137 | 123162 | 东杰转债 | 18,213,687.17 | 0.14 |
| 138 | 127087 | 星帅转 2 | 18,199,467.13 | 0.14 |
| 139 | 113644 | 艾迪转债 | 18,190,850.28 | 0.14 |
| 140 | 128063 | 未来转债 | 17,699,033.11 | 0.14 |
| 141 | 123173 | 恒锋转债 | 17,361,876.87 | 0.13 |
| 142 | 128083 | 新北转债 | 16,944,178.05 | 0.13 |
| 143 | 110047 | 山鹰转债 | 16,618,350.96 | 0.13 |
| 144 | 123147 | 中辰转债 | 16,617,778.77 | 0.13 |
| 145 | 123063 | 大禹转债 | 16,555,603.16 | 0.13 |
| 146 | 113619 | 世运转债 | 16,530,103.93 | 0.13 |
| 147 | 123168 | 惠云转债 | 16,243,468.34 | 0.13 |
| 148 | 113662 | 豪能转债 | 16,048,557.99 | 0.12 |
| 149 | 111012 | 福新转债 | 16,014,324.19 | 0.12 |
| 150 | 113657 | 再 22 转债 | 15,998,331.20 | 0.12 |
| 151 | 113649 | 丰山转债 | 15,852,303.63 | 0.12 |
| 152 | 123082 | 北陆转债 | 15,622,968.81 | 0.12 |
| 153 | 123142 | 申昊转债 | 15,579,199.61 | 0.12 |
| 154 | 123171 | 共同转债 | 15,301,863.94 | 0.12 |
| 155 | 123120 | 隆华转债 | 15,274,024.27 | 0.12 |
| 156 | 113068 | 金铜转债 | 15,054,411.06 | 0.12 |
| 157 | 123185 | 能辉转债 | 15,029,265.06 | 0.12 |
| 158 | 123088 | 威唐转债 | 14,775,222.79 | 0.11 |
| 159 | 118044 | 赛特转债 | 14,560,020.05 | 0.11 |
| 160 | 123217 | 富仕转债 | 14,360,648.37 | 0.11 |
| 161 | 128090 | 汽模转 2 | 14,341,559.72 | 0.11 |
| 162 | 123159 | 崧盛转债 | 13,982,955.35 | 0.11 |
| 163 | 123219 | 宇瞳转债 | 13,633,736.35 | 0.11 |
| 164 | 118036 | 力合转债 | 13,597,228.67 | 0.11 |
| 165 | 118006 | 阿拉转债 | 13,518,325.80 | 0.11 |
| 166 | 123128 | 首华转债 | 13,475,481.69 | 0.10 |
| 167 | 123189 | 晓鸣转债 | 12,797,552.96 | 0.10 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|---------------|------|
| 168 | 123071 | 天能转债 | 12,705,596.11 | 0.10 |
| 169 | 113674 | 华设转债 | 12,584,934.57 | 0.10 |
| 170 | 118009 | 华锐转债 | 12,506,532.47 | 0.10 |
| 171 | 111004 | 明新转债 | 11,969,264.64 | 0.09 |
| 172 | 127039 | 北港转债 | 11,896,297.51 | 0.09 |
| 173 | 127068 | 顺博转债 | 11,864,127.67 | 0.09 |
| 174 | 110070 | 凌钢转债 | 11,584,355.67 | 0.09 |
| 175 | 111011 | 冠盛转债 | 11,493,184.58 | 0.09 |
| 176 | 123196 | 正元转 02 | 11,226,835.05 | 0.09 |
| 177 | 123154 | 火星转债 | 11,206,127.85 | 0.09 |
| 178 | 123190 | 道氏转 02 | 11,177,393.67 | 0.09 |
| 179 | 123035 | 利德转债 | 11,104,816.21 | 0.09 |
| 180 | 123107 | 温氏转债 | 10,691,731.63 | 0.08 |
| 181 | 110084 | 贵燃转债 | 10,394,955.67 | 0.08 |
| 182 | 123091 | 长海转债 | 9,911,487.68 | 0.08 |
| 183 | 123152 | 润禾转债 | 9,849,469.48 | 0.08 |
| 184 | 123146 | 中环转 2 | 9,592,445.17 | 0.07 |
| 185 | 123158 | 宙邦转债 | 9,425,459.17 | 0.07 |
| 186 | 123130 | 设研转债 | 9,394,015.24 | 0.07 |
| 187 | 111003 | 聚合转债 | 9,059,575.30 | 0.07 |
| 188 | 113629 | 泉峰转债 | 9,050,462.99 | 0.07 |
| 189 | 113667 | 春 23 转债 | 8,926,777.72 | 0.07 |
| 190 | 123220 | 易瑞转债 | 8,399,797.43 | 0.07 |
| 191 | 110090 | 爱迪转债 | 8,338,453.78 | 0.06 |
| 192 | 110086 | 精工转债 | 7,889,937.71 | 0.06 |
| 193 | 118018 | 瑞科转债 | 7,637,250.89 | 0.06 |
| 194 | 118026 | 利元转债 | 7,322,737.64 | 0.06 |
| 195 | 113532 | 海环转债 | 7,269,281.38 | 0.06 |
| 196 | 118027 | 宏图转债 | 6,469,700.82 | 0.05 |
| 197 | 123221 | 力诺转债 | 6,353,531.21 | 0.05 |
| 198 | 111002 | 特纸转债 | 6,146,735.29 | 0.05 |
| 199 | 128071 | 合兴转债 | 6,033,886.57 | 0.05 |
| 200 | 123106 | 正丹转债 | 5,967,660.86 | 0.05 |
| 201 | 127075 | 百川转 2 | 5,952,990.22 | 0.05 |
| 202 | 113065 | 齐鲁转债 | 5,632,086.12 | 0.04 |
| 203 | 113601 | 塞力转债 | 5,173,615.31 | 0.04 |
| 204 | 123072 | 乐歌转债 | 5,142,452.85 | 0.04 |
| 205 | 118015 | 芯海转债 | 4,465,112.79 | 0.03 |
| 206 | 118012 | 微芯转债 | 3,767,857.31 | 0.03 |
| 207 | 113632 | 鹤 21 转债 | 3,687,597.51 | 0.03 |
| 208 | 113060 | 浙 22 转债 | 3,590,439.36 | 0.03 |
| 209 | 123090 | 三诺转债 | 3,339,880.99 | 0.03 |
| 210 | 123160 | 泰福转债 | 3,081,454.89 | 0.02 |

| | | | | |
|-----|--------|---------|--------------|------|
| 211 | 113670 | 金 23 转债 | 2,933,337.43 | 0.02 |
| 212 | 123187 | 超达转债 | 2,834,817.66 | 0.02 |
| 213 | 123103 | 震安转债 | 2,744,667.49 | 0.02 |
| 214 | 123085 | 万顺转 2 | 2,604,691.13 | 0.02 |
| 215 | 111014 | 李子转债 | 2,554,429.23 | 0.02 |
| 216 | 123211 | 阳谷转债 | 2,050,133.94 | 0.02 |
| 217 | 127063 | 贵轮转债 | 2,025,454.15 | 0.02 |
| 218 | 127015 | 希望转债 | 1,739,197.08 | 0.01 |
| 219 | 123165 | 回天转债 | 1,693,960.54 | 0.01 |
| 220 | 111009 | 盛泰转债 | 1,512,476.54 | 0.01 |
| 221 | 113618 | 美诺转债 | 1,503,266.48 | 0.01 |
| 222 | 123109 | 昌红转债 | 1,427,155.20 | 0.01 |
| 223 | 128128 | 齐翔转 2 | 1,331,430.52 | 0.01 |
| 224 | 113659 | 莱克转债 | 1,101,678.72 | 0.01 |
| 225 | 113661 | 福 22 转债 | 1,090,233.38 | 0.01 |
| 226 | 123011 | 德尔转债 | 1,082,001.81 | 0.01 |
| 227 | 118033 | 华特转债 | 1,017,484.69 | 0.01 |
| 228 | 113044 | 大秦转债 | 694,875.28 | 0.01 |
| 229 | 113030 | 东风转债 | 596,733.81 | 0.00 |
| 230 | 128130 | 景兴转债 | 516,044.66 | 0.00 |
| 231 | 113664 | 大元转债 | 447,418.29 | 0.00 |
| 232 | 123163 | 金沃转债 | 273,387.41 | 0.00 |
| 233 | 128123 | 国光转债 | 257,883.99 | 0.00 |
| 234 | 128121 | 宏川转债 | 117,488.51 | 0.00 |
| 235 | 127025 | 冀东转债 | 42,968.78 | 0.00 |
| 236 | 127018 | 本钢转债 | 12,419.09 | 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 易方达双债增强债 券A | 易方达双债增强债 券C |
|------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 8,061,214,412.35 | 1,221,073,439.42 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 387,610,213.09 | 663,843,349.08 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,252,548,961.93 | 533,607,260.09 |
| 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 | 6,196,275,663.51 | 1,351,309,528.41 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会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。

8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年四月二十日