

# 易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

2024 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：二〇二四年七月十八日

## § 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 2024 年 7 月 16 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 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	1,734,130,909.28 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 (2024年4月1日-2024年6月30日)
1.本期已实现收益	28,247,378.97
2.本期利润	33,663,657.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.0198
4.期末基金资产净值	1,923,444,823.63

5.期末基金份额净值	1.1092
------------	--------

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	1.83%	0.20%	1.36%	0.08%	0.47%	0.12%
过去六个月	4.78%	0.19%	3.51%	0.09%	1.27%	0.10%
过去一年	5.71%	0.18%	4.31%	0.09%	1.40%	0.09%
过去三年	13.94%	0.20%	9.70%	0.11%	4.24%	0.09%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	31.65%	0.19%	19.94%	0.12%	11.71%	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2024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 31.65%，同期业绩比较基准收益率为 19.94%。

## § 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（自 2013 年 04 月 24 日至 2024 年 06 月 03 日）、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	2019-09-06	-	18 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司债券研究员、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、

	策委员会委员、基础设施资产管理委员会委员				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、易方达瑞智混合、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 年期国开行债券指数、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、易方达兴利 180 天持有债券的基金经理，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	-	15 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，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21次，其中18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，3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

二季度经济基本面整体保持平稳，边际上有所走弱。首先，一季度表现比较好的出口数据在4、5月份有所走平，显示海外补库需求有所放缓。其次，在产销率大幅下降之后，企业二季度生产动能明显减弱，工业增加值数据持续低于历史同期水平。第三，经济结构转型继续推进，具体表现为制造业投资持续强劲，但是地产投资持续低迷，基建投资也在4月份之后有显著走弱。第四，消费端表现为以价补量，整体居民消费恢复仍然偏慢。经济依然表现出结构化转型过程中需求相对不足的特点。

二季度货币政策和财政政策保持平稳，地产政策则继续放松。4月份政治局会议提出“统筹研究消化存量房产和优化增量住房的政策措施”之后，5月17日央行连发3条重磅房地产新政，此后各地政府在首付比例、房贷利率等方面都进行了较大力度的放松，目前政策效果初显但持续性还有待观察。

从债券市场的表现来看，二季度大部分品种的收益率出现20-40BP的下行，其中信用类品种下行30-40BP，利率品种下行20-30BP，30年国债表现相对较弱，

收益率仅下行 6BP。从节奏上看，除了 4 月下旬出现过 20BP 左右的回调以外，收益率在整个区间呈现较为平稳的下行走势。

权益市场先涨后跌，整体下行，且结构分化较大。二季度沪深 300 指数下跌 2.14%，而创业板指数下跌达到 7.41%。行业方面，银行、公用事业、电子、煤炭、交通运输行业取得了正收益，但综合、传媒、商贸零售和社会服务等行业下跌较多，二季度跌幅达到 15% 以上。中证转债指数二季度上涨 0.75%。

操作上，本组合在二季度保持了相对中性的股票仓位和偏高的可转债仓位，对组合收益有一定负面影响，但对业绩影响在可控范围内。组合债券部分保持了相对偏长的久期，是二季度组合收益的主要来源，较好地覆盖了权益资产带来的波动。综合来看组合在二季度延续了绝对收益的操作思路，净值平稳增长，获取了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 1.1092 元，本报告期份额净值增长率为 1.83%，同期业绩比较基准收益率为 1.36%。

#### 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	169,277,472.81	6.53
	其中：股票	169,277,472.81	6.53
2	固定收益投资	2,403,070,503.41	92.68
	其中：债券	2,319,855,128.61	89.47
	资产支持证券	83,215,374.80	3.21
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	17,484,749.27	0.67
7	其他资产	3,049,324.62	0.12
8	合计	2,592,882,050.11	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	4,086,715.20	0.21
B	采矿业	6,384,843.00	0.33
C	制造业	111,869,532.19	5.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,384,500.00	0.07
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	25,924,544.00	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,070,933.27	0.42
J	金融业	2,018,828.35	0.10
K	房地产业	1,209,040.00	0.06
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	8,306,040.00	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	169,277,472.81	8.80
----	----------------	------

### 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	002472	双环传动	471,400	10,380,228.00	0.54
2	601298	青岛港	875,100	8,365,956.00	0.43
3	600660	福耀玻璃	154,600	7,405,340.00	0.39
4	600150	中国船舶	174,796	7,115,945.16	0.37
5	600685	中船防务	242,500	6,765,750.00	0.35
6	600873	梅花生物	665,300	6,666,306.00	0.35
7	300347	泰格医药	132,200	6,424,920.00	0.33
8	601088	中国神华	143,900	6,384,843.00	0.33
9	600018	上港集团	1,022,400	5,909,472.00	0.31
10	300760	迈瑞医疗	18,900	5,498,199.00	0.29

#### 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	51,681,657.61	2.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	600,236,300.23	31.21
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	381,600,052.93	19.84
5	企业短期融资券	196,040,537.02	10.19
6	中期票据	708,936,192.05	36.86
7	可转债（可交换债）	381,360,388.77	19.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,319,855,128.61	120.61

#### 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	232480004	24 农行二级资本债 01A	1,300,000	134,499,022.95	6.99
2	232380089	23 中信银行二级资本债 01A	700,000	73,996,770.49	3.85
3	242400011	24 广发银行永续债 01	700,000	70,253,668.49	3.65
4	092280065	22 工行二级资本债 03A	600,000	63,151,645.90	3.28
5	102480955	24 诚通控股 MTN009 A	500,000	53,825,852.05	2.80

#### 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	21,044,849.32	1.09
2	199694	G23XH 优	200,000	20,321,415.01	1.06
3	144164	24 光水 07	110,000	11,041,483.56	0.57
4	260418	G 黄河优	100,000	10,404,671.78	0.54
5	193933	和皖 A	100,000	10,249,777.05	0.53
6	199430	23 济建优	100,000	10,153,178.08	0.53

#### 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

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，主要选择流动性好的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的利率风险。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					-592,760.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					69,700.00

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行交易。本基金力争通过国债期货的交易，降低组合债券持仓调整的交易成本，增加组合的灵活性，对冲潜在风险。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 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，广发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的处罚。中国农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、国家外汇管理局北京市分局的处罚。中信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的处罚。兖矿能源集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家矿山安全监察局山东局、济宁市城乡水务局、济宁市能源局、邹城市交通运输局、邹城市消防救援大队的处罚。

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	50,030.28
2	应收证券清算款	2,999,294.34
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	3,049,324.62

## 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	123107	温氏转债	6,617,877.72	0.34
2	113632	鹤21转债	6,483,213.52	0.34
3	127045	牧原转债	6,446,251.99	0.34
4	111000	起帆转债	6,279,610.36	0.33
5	123196	正元转02	5,785,793.61	0.30
6	113051	节能转债	5,759,765.34	0.30
7	123171	共同转债	5,748,744.22	0.30
8	110090	爱迪转债	5,310,527.15	0.28
9	110085	通22转债	5,000,664.41	0.26
10	113669	景23转债	4,984,736.93	0.26
11	123194	百洋转债	4,974,715.66	0.26
12	113631	皖天转债	4,719,239.45	0.25
13	127039	北港转债	4,562,559.69	0.24
14	118000	嘉元转债	4,475,926.29	0.23
15	127082	亚科转债	4,380,457.68	0.23
16	128081	海亮转债	4,136,242.45	0.22
17	128121	宏川转债	3,861,657.20	0.20
18	113649	丰山转债	3,839,970.97	0.20
19	118030	睿创转债	3,747,552.05	0.19
20	118042	奥维转债	3,673,160.68	0.19
21	127049	希望转2	3,664,715.69	0.19
22	113030	东风转债	3,605,868.19	0.19
23	123119	康泰转2	3,535,740.13	0.18

24	127054	双箭转债	3,524,697.69	0.18
25	118031	天23转债	3,493,063.38	0.18
26	123101	拓斯转债	3,484,913.01	0.18
27	123052	飞鹿转债	3,479,798.91	0.18
28	110094	众和转债	3,466,142.85	0.18
29	123190	道氏转02	3,448,168.80	0.18
30	123092	天壕转债	3,385,152.84	0.18
31	127040	国泰转债	3,373,850.21	0.18
32	113656	嘉诚转债	3,356,796.97	0.17
33	123078	飞凯转债	3,316,112.41	0.17
34	127061	美锦转债	3,241,899.89	0.17
35	123150	九强转债	3,204,695.37	0.17
36	128132	交建转债	3,190,459.75	0.17
37	123228	震裕转债	3,189,837.45	0.17
38	113651	松霖转债	3,184,138.79	0.17
39	110093	神马转债	3,174,774.41	0.17
40	113623	凤21转债	3,158,077.19	0.16
41	127086	恒邦转债	3,158,066.70	0.16
42	127088	赫达转债	3,092,336.39	0.16
43	110095	双良转债	3,041,266.18	0.16
44	128144	利民转债	3,037,276.43	0.16
45	118043	福立转债	3,009,600.39	0.16
46	113664	大元转债	2,899,455.65	0.15
47	127027	能化转债	2,877,280.62	0.15
48	123157	科蓝转债	2,805,577.41	0.15
49	123114	三角转债	2,670,133.09	0.14
50	123217	富仕转债	2,657,367.22	0.14
51	118003	华兴转债	2,618,031.21	0.14
52	128066	亚泰转债	2,593,091.67	0.13
53	123187	超达转债	2,587,325.97	0.13
54	113058	友发转债	2,567,722.92	0.13
55	113676	荣23转债	2,495,003.72	0.13
56	123219	宇瞳转债	2,449,989.23	0.13
57	123224	宇邦转债	2,446,119.00	0.13
58	127101	豪鹏转债	2,419,019.88	0.13
59	127055	精装转债	2,413,637.73	0.13
60	118012	微芯转债	2,391,603.49	0.12
61	123120	隆华转债	2,383,499.05	0.12
62	118037	上声转债	2,368,039.74	0.12
63	113675	新23转债	2,311,704.84	0.12
64	113673	岱美转债	2,305,746.04	0.12
65	118011	银微转债	2,299,292.42	0.12
66	113644	艾迪转债	2,288,825.39	0.12

67	123184	天阳转债	2,265,434.86	0.12
68	127099	盛航转债	2,248,200.48	0.12
69	123212	立中转债	2,221,157.40	0.12
70	123200	海泰转债	2,219,550.87	0.12
71	123050	聚飞转债	2,214,852.56	0.12
72	127052	西子转债	2,199,257.24	0.11
73	123145	药石转债	2,197,169.46	0.11
74	123022	长信转债	2,193,979.36	0.11
75	110089	兴发转债	2,144,192.10	0.11
76	118013	道通转债	2,141,293.66	0.11
77	113577	春秋转债	2,114,628.46	0.11
78	123185	能辉转债	2,072,461.26	0.11
79	127085	韵达转债	2,069,899.06	0.11
80	111008	沿浦转债	2,054,594.57	0.11
81	111014	李子转债	2,032,428.85	0.11
82	123151	康医转债	2,019,525.12	0.10
83	123165	回天转债	2,018,917.61	0.10
84	111004	明新转债	2,007,323.85	0.10
85	113653	永22转债	1,988,758.72	0.10
86	127042	嘉美转债	1,986,609.13	0.10
87	123208	孩王转债	1,982,412.46	0.10
88	123172	漱玉转债	1,977,277.64	0.10
89	127075	百川转2	1,970,527.41	0.10
90	127076	中宠转2	1,969,804.27	0.10
91	128130	景兴转债	1,947,580.50	0.10
92	127044	蒙娜转债	1,938,637.36	0.10
93	123063	大禹转债	1,938,614.96	0.10
94	127068	顺博转债	1,932,396.95	0.10
95	123202	祥源转债	1,914,804.59	0.10
96	118029	富淼转债	1,902,546.97	0.10
97	123160	泰福转债	1,854,635.28	0.10
98	128141	旺能转债	1,840,406.84	0.10
99	111009	盛泰转债	1,839,487.80	0.10
100	123229	艾录转债	1,834,953.63	0.10
101	128105	长集转债	1,818,948.98	0.09
102	123146	中环转2	1,807,182.59	0.09
103	113640	苏利转债	1,765,494.37	0.09
104	113628	晨丰转债	1,719,319.45	0.09
105	118044	赛特转债	1,668,172.68	0.09
106	123216	科顺转债	1,564,887.67	0.08
107	123191	智尚转债	1,548,960.52	0.08
108	128083	新北转债	1,540,907.84	0.08
109	111015	东亚转债	1,525,563.99	0.08

110	123049	维尔转债	1,488,620.64	0.08
111	111013	新港转债	1,481,195.30	0.08
112	128127	文科转债	1,449,557.37	0.08
113	113597	佳力转债	1,428,418.47	0.07
114	113608	威派转债	1,242,260.78	0.06
115	118020	芳源转债	1,223,601.22	0.06
116	123173	恒锋转债	1,125,893.30	0.06
117	113610	灵康转债	1,117,403.55	0.06
118	123211	阳谷转债	1,070,980.58	0.06
119	127069	小熊转债	1,052,226.63	0.05
120	113549	白电转债	968,756.01	0.05
121	123235	亿田转债	967,513.98	0.05
122	113629	泉峰转债	861,490.93	0.04
123	118023	广大转债	833,145.82	0.04
124	113668	鹿山转债	833,053.10	0.04
125	123162	东杰转债	817,772.35	0.04
126	127015	希望转债	815,291.34	0.04
127	110087	天业转债	756,830.29	0.04
128	127066	科利转债	732,009.53	0.04
129	123147	中辰转债	707,544.11	0.04
130	127083	山路转债	705,926.81	0.04
131	127091	科数转债	673,171.68	0.03
132	123215	铭利转债	663,965.47	0.03
133	123233	凯盛转债	654,481.81	0.03
134	123091	长海转债	646,786.17	0.03
135	123183	海顺转债	643,261.50	0.03
136	113627	太平转债	638,335.05	0.03
137	127043	川恒转债	625,931.78	0.03
138	123193	海能转债	625,205.86	0.03
139	118006	阿拉转债	617,642.15	0.03
140	111003	聚合转债	600,966.89	0.03
141	127078	优彩转债	586,184.64	0.03
142	110064	建工转债	578,003.28	0.03
143	123149	通裕转债	564,400.19	0.03
144	123204	金丹转债	563,999.45	0.03
145	123178	花园转债	553,378.04	0.03
146	111002	特纸转债	547,342.14	0.03
147	110068	龙净转债	543,066.83	0.03
148	127071	天箭转债	521,235.42	0.03
149	113665	汇通转债	504,208.21	0.03
150	123186	志特转债	494,769.51	0.03
151	113677	华懋转债	486,903.08	0.03
152	123170	南电转债	481,287.52	0.03

153	123163	金沃转债	457,713.86	0.02
154	127053	豪美转债	457,096.26	0.02
155	118040	宏微转债	442,282.17	0.02
156	118033	华特转债	431,439.07	0.02
157	118032	建龙转债	430,594.98	0.02
158	118038	金宏转债	420,466.14	0.02
159	113637	华翔转债	419,893.30	0.02
160	127035	濮耐转债	414,307.65	0.02
161	127070	大中转债	372,205.54	0.02
162	113602	景20转债	348,043.41	0.02
163	123082	北陆转债	342,433.09	0.02
164	123152	润禾转债	328,172.50	0.02
165	118026	利元转债	327,654.22	0.02
166	113068	金铜转债	326,530.08	0.02
167	123072	乐歌转债	305,935.89	0.02
168	118009	华锐转债	298,510.00	0.02
169	123213	天源转债	278,086.01	0.01
170	123220	易瑞转债	247,253.26	0.01
171	113658	密卫转债	231,468.67	0.01
172	123124	晶瑞转2	223,122.28	0.01
173	128120	联诚转债	221,773.20	0.01
174	123144	裕兴转债	213,461.40	0.01
175	113679	芯能转债	208,197.21	0.01
176	111005	富春转债	204,155.19	0.01
177	113600	新星转债	185,441.94	0.01
178	123103	震安转债	182,407.60	0.01
179	127087	星帅转2	180,861.48	0.01
180	113643	风语转债	172,680.22	0.01
181	123175	百畅转债	169,540.82	0.01
182	128128	齐翔转2	168,860.19	0.01
183	113663	新化转债	161,689.18	0.01
184	118036	力合转债	149,642.67	0.01
185	123085	万顺转2	148,722.29	0.01
186	118027	宏图转债	131,159.66	0.01
187	128090	汽模转2	64,424.06	0.00
188	123166	蒙泰转债	61,812.45	0.00
189	123121	帝尔转债	51,076.48	0.00
190	123158	宙邦转债	18,194.35	0.00
191	123108	乐普转2	5,312.29	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

报告期期初基金份额总额	1,552,425,227.26
报告期期间基金总申购份额	274,297,348.41
减：报告期期间基金总赎回份额	92,591,666.39
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	1,734,130,909.28

## § 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	0.5767%	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	0.5767%	-

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	2024年04月01日~2024年06月30日	797,225,069.17	274,297,339.31	0.00	1,071,522,408.48	61.79%
	2	2024年04月01日~2024年06月30日	752,199,970.54	0.00	92,591,666.39	659,608,304.15	38.04%
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

二〇二四年七月十八日