

# 易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金

## 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	易方达瑞财混合
基金主代码	001802
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 4 日
报告期末基金份额总额	1,119,593,207.69 份
投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	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。股票投资策略方面，本基金将通过分析行业景气度和行业竞争格局，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，本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。债券投资策略方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。	
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率×75%+沪深 300 指数收益率×25%	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞财混合 I	易方达瑞财混合 E
下属分级基金的交易代码	001802	001803
报告期末下属分级基金的份额总额	1,110,785,549.01 份	8,807,658.68 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 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
--------	---

	易方达瑞财混合 I	易方达瑞财混合 E
1.本期已实现收益	12,621,306.32	85,417.63
2.本期利润	19,136,583.20	131,628.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0173	0.0160
4.期末基金资产净值	1,196,344,752.70	9,443,866.41
5.期末基金份额净值	1.077	1.072

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

##### 易方达瑞财混合 I

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	1.60%	0.25%	0.79%	0.18%	0.81%	0.07%
过去六个月	3.26%	0.25%	3.13%	0.22%	0.13%	0.03%
过去一年	3.86%	0.22%	1.90%	0.21%	1.96%	0.01%
过去三年	11.03%	0.22%	1.32%	0.26%	9.71%	-0.04%
过去五年	28.99%	0.20%	16.96%	0.28%	12.03%	-0.08%
自基金合同生效起至今	56.11%	0.17%	37.63%	0.28%	18.48%	-0.11%

##### 易方达瑞财混合 E

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	1.52%	0.25%	0.79%	0.18%	0.73%	0.07%

月						
过去六个月	3.18%	0.25%	3.13%	0.22%	0.05%	0.03%
过去一年	3.68%	0.22%	1.90%	0.21%	1.78%	0.01%
过去三年	10.38%	0.22%	1.32%	0.26%	9.06%	-0.04%
过去五年	27.63%	0.20%	16.96%	0.28%	10.67%	-0.08%
自基金合同生效起至今	53.41%	0.17%	37.63%	0.28%	15.78%	-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

易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金  
 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  
 (2016 年 2 月 4 日至 2024 年 6 月 30 日)

易方达瑞财混合 I



易方达瑞财混合 E



注：自基金合同生效至报告期末，I类基金份额净值增长率为 56.11%，同期业绩比较基准收益率为 37.63%；E 类基金份额净值增长率为 53.41%，同期业绩比较基准收益率为 37.63%。

## § 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		
纪玲云	本基金的基金经理，易方达信用债债券、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、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	2019-01-11	-	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。

	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				
--	--	--	--	--	--

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 I 类基金份额净值为 1.077 元，本报告期份额净值增长率为 1.60%，同期业绩比较基准收益率为 0.79%；E 类基金份额净值为 1.072 元，本报告期份额净值增长率为 1.52%，同期业绩比较基准收益率为 0.79%。

#### 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	139,638,752.80	9.21
	其中：股票	139,638,752.80	9.21
2	固定收益投资	1,364,767,744.93	90.01
	其中：债券	1,312,388,680.37	86.56
	资产支持证券	52,379,064.56	3.45
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	6,711,065.39	0.44
7	其他资产	5,069,512.84	0.33
8	合计	1,516,187,075.96	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	586,507.20	0.05
B	采矿业	6,763,606.00	0.56
C	制造业	82,167,115.13	6.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,492,002.00	0.12
E	建筑业	713,537.50	0.06
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	29,007,966.00	2.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,106,133.12	0.76
J	金融业	2,310,232.05	0.19
K	房地产业	-	-
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	7,469,157.00	0.62
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	139,638,752.80	11.58

### 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	601298	青岛港	819,100	7,830,596.00	0.65
2	600873	梅花生物	752,300	7,538,046.00	0.63
3	601088	中国神华	145,400	6,451,398.00	0.54
4	600018	上港集团	986,600	5,702,548.00	0.47
5	600150	中国船舶	139,100	5,662,761.00	0.47
6	600660	福耀玻璃	112,131	5,371,074.90	0.45
7	300347	泰格医药	109,900	5,341,140.00	0.44
8	601598	中国外运	927,800	5,223,514.00	0.43
9	600026	中远海能	324,000	5,057,640.00	0.42
10	002472	双环传动	229,000	5,042,580.00	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	51,681,657.61	4.29
2	央行票据	-	-

3	金融债券	287,074,011.89	23.81
	其中：政策性金融债	65,930,824.20	5.47
4	企业债券	71,506,377.58	5.93
5	企业短期融资券	103,616,986.35	8.59
6	中期票据	505,184,747.52	41.90
7	可转债（可交换债）	293,324,899.42	24.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,312,388,680.37	108.84

#### 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	102480955	24 诚通控股 MTN009A	500,000	53,825,852.05	4.46
2	092280108	22 中行二级资本债 02A	500,000	52,411,836.07	4.35
3	2400001	24 特别国债 01	500,000	51,681,657.61	4.29
4	230431	23 农发 31	500,000	50,876,666.67	4.22
5	242480002	24 兴业银行永续债 01	500,000	50,453,104.11	4.18

#### 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	100,000	10,522,424.66	0.87
2	260418	G 黄河优	100,000	10,404,671.78	0.86
3	193933	和皖 A	100,000	10,249,777.05	0.85
4	199694	G23XH 优	100,000	10,160,707.51	0.84
5	144163	24 光水 06	100,000	10,037,712.33	0.83
6	144164	24 光水 07	10,000	1,003,771.23	0.08

#### 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)					-577,680.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					60,500.00

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，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国家金融监督管理总局的处罚。中国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、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	25,296.43
2	应收证券清算款	5,034,212.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,004.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,069,512.84

#### 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	6,698,454.43	0.56
2	123196	正元转 02	4,836,979.68	0.40
3	123078	飞凯转债	4,660,022.53	0.39
4	123107	温氏转债	4,511,615.72	0.37
5	128081	海亮转债	4,245,833.35	0.35
6	127049	希望转 2	4,055,230.90	0.34
7	127090	兴瑞转债	4,032,382.51	0.33
8	123150	九强转债	3,978,036.13	0.33
9	127054	双箭转债	3,926,489.16	0.33
10	113597	佳力转债	3,887,630.34	0.32
11	123092	天壕转债	3,778,920.61	0.31
12	118011	银微转债	3,735,672.65	0.31
13	127053	豪美转债	3,694,762.50	0.31
14	113641	华友转债	3,505,685.32	0.29
15	118031	天 23 转债	3,493,063.38	0.29
16	123229	艾录转债	3,414,307.32	0.28
17	127032	苏行转债	3,372,611.86	0.28
18	118043	福立转债	3,361,014.20	0.28
19	127040	国泰转债	3,296,101.26	0.27
20	113033	利群转债	3,275,453.42	0.27
21	110089	兴发转债	3,265,734.93	0.27
22	123236	家联转债	3,223,869.17	0.27
23	127082	亚科转债	3,152,169.73	0.26
24	118012	微芯转债	3,085,575.39	0.26

25	123119	康泰转 2	3,020,568.59	0.25
26	113676	荣 23 转债	3,017,322.26	0.25
27	113058	友发转债	2,947,270.66	0.24
28	123217	富仕转债	2,850,086.09	0.24
29	127039	北港转债	2,815,170.67	0.23
30	123114	三角转债	2,795,971.46	0.23
31	110094	众和转债	2,715,473.93	0.23
32	113653	永 22 转债	2,628,665.02	0.22
33	123160	泰福转债	2,611,415.47	0.22
34	113549	白电转债	2,566,605.42	0.21
35	123190	道氏转 02	2,499,107.80	0.21
36	123052	飞鹿转债	2,495,165.35	0.21
37	113673	岱美转债	2,487,583.31	0.21
38	118033	华特转债	2,352,795.99	0.20
39	110093	神马转债	2,325,000.12	0.19
40	128128	齐翔转 2	2,309,810.25	0.19
41	123205	大叶转债	2,299,629.28	0.19
42	123171	共同转债	2,284,555.67	0.19
43	123228	震裕转债	2,253,536.35	0.19
44	118029	富淼转债	2,235,540.39	0.19
45	123101	拓斯转债	2,230,544.82	0.18
46	127075	百川转 2	2,180,238.29	0.18
47	127052	西子转债	2,158,572.11	0.18
48	123072	乐歌转债	2,152,835.75	0.18
49	123050	聚飞转债	2,138,305.25	0.18
50	128109	楚江转债	2,135,627.05	0.18
51	113577	春秋转债	2,110,836.53	0.18
52	118003	华兴转债	2,105,887.24	0.17
53	113628	晨丰转债	2,082,040.39	0.17
54	123233	凯盛转债	2,074,657.49	0.17
55	118020	芳源转债	2,052,279.65	0.17
56	118023	广大转债	2,030,748.62	0.17
57	123161	强联转债	1,999,419.30	0.17
58	113644	艾迪转债	1,992,763.78	0.17
59	127061	美锦转债	1,937,280.08	0.16
60	113637	华翔转债	1,924,706.42	0.16
61	113059	福莱转债	1,901,254.58	0.16
62	123216	科顺转债	1,885,418.32	0.16
63	127078	优彩转债	1,865,589.54	0.15
64	111005	富春转债	1,855,567.59	0.15
65	113629	泉峰转债	1,853,804.44	0.15
66	128105	长集转债	1,819,976.05	0.15
67	123146	中环转 2	1,803,912.09	0.15

68	118038	金宏转债	1,769,972.84	0.15
69	127042	嘉美转债	1,767,987.07	0.15
70	110064	建工转债	1,760,789.90	0.15
71	123120	隆华转债	1,754,504.67	0.15
72	110095	双良转债	1,743,390.73	0.14
73	123076	强力转债	1,724,697.80	0.14
74	127055	精装转债	1,695,486.01	0.14
75	127060	湘佳转债	1,689,751.44	0.14
76	113640	苏利转债	1,662,022.17	0.14
77	123191	智尚转债	1,637,576.60	0.14
78	113631	皖天转债	1,624,137.40	0.13
79	123213	天源转债	1,621,129.21	0.13
80	123184	天阳转债	1,597,342.15	0.13
81	113610	灵康转债	1,552,284.93	0.13
82	110084	贵燃转债	1,547,158.03	0.13
83	127073	天赐转债	1,546,520.16	0.13
84	110087	天业转债	1,517,707.81	0.13
85	123201	纽泰转债	1,498,242.61	0.12
86	123183	海顺转债	1,487,542.22	0.12
87	111009	盛泰转债	1,483,427.11	0.12
88	127070	大中转债	1,466,657.25	0.12
89	127051	博杰转债	1,457,891.32	0.12
90	123235	亿田转债	1,452,755.80	0.12
91	123215	铭利转债	1,443,829.60	0.12
92	111000	起帆转债	1,397,000.77	0.12
93	123211	阳谷转债	1,392,828.52	0.12
94	123212	立中转债	1,384,654.22	0.11
95	123193	海能转债	1,356,405.63	0.11
96	123124	晶瑞转 2	1,348,968.67	0.11
97	128132	交建转债	1,329,746.36	0.11
98	123185	能辉转债	1,322,222.06	0.11
99	118042	奥维转债	1,310,710.58	0.11
100	113668	鹿山转债	1,306,423.27	0.11
101	127077	华宏转债	1,306,019.47	0.11
102	113669	景 23 转债	1,303,415.42	0.11
103	113627	太平转债	1,301,512.25	0.11
104	118044	赛特转债	1,281,590.83	0.11
105	118009	华锐转债	1,280,252.27	0.11
106	110090	爱迪转债	1,278,350.95	0.11
107	128127	文科转债	1,264,548.07	0.10
108	123149	通裕转债	1,237,156.33	0.10
109	123175	百畅转债	1,166,210.41	0.10
110	113675	新 23 转债	1,160,489.74	0.10

111	123172	漱玉转债	1,117,795.40	0.09
112	127100	神码转债	1,097,348.06	0.09
113	113665	汇通转债	1,082,738.56	0.09
114	128066	亚泰转债	1,066,778.22	0.09
115	123220	易瑞转债	1,064,185.27	0.09
116	113651	松霖转债	1,015,156.82	0.08
117	123208	孩王转债	1,012,217.38	0.08
118	123145	药石转债	1,008,592.47	0.08
119	123147	中辰转债	1,002,402.24	0.08
120	118040	宏微转债	961,568.82	0.08
121	118030	睿创转债	946,575.18	0.08
122	128083	新北转债	866,549.92	0.07
123	127087	星帅转 2	860,429.79	0.07
124	123202	祥源转债	832,322.67	0.07
125	123132	回盛转债	787,914.59	0.07
126	123204	金丹转债	739,805.10	0.06
127	113060	浙 22 转债	726,844.69	0.06
128	127068	顺博转债	709,716.02	0.06
129	127050	麒麟转债	709,201.64	0.06
130	127086	恒邦转债	709,105.81	0.06
131	123151	康医转债	698,092.32	0.06
132	111002	特纸转债	696,941.08	0.06
133	127066	科利转债	696,009.06	0.06
134	118036	力合转债	654,827.33	0.05
135	113600	新星转债	634,708.50	0.05
136	123162	东杰转债	570,844.54	0.05
137	123219	宇瞳转债	570,528.15	0.05
138	123231	信测转债	556,509.20	0.05
139	113666	爱玛转债	523,857.96	0.04
140	113632	鹤 21 转债	519,223.51	0.04
141	118027	宏图转债	499,178.23	0.04
142	123085	万顺转 2	467,551.77	0.04
143	123144	裕兴转债	459,265.45	0.04
144	123103	震安转债	392,229.05	0.03
145	113649	丰山转债	358,279.50	0.03
146	113068	金铜转债	336,492.02	0.03
147	123166	蒙泰转债	185,834.86	0.02
148	127035	濮耐转债	165,474.23	0.01
149	118041	星球转债	147,672.17	0.01
150	111003	聚合转债	146,929.78	0.01
151	113664	大元转债	109,898.72	0.01
152	123187	超达转债	109,373.33	0.01

## 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	易方达瑞财混合I	易方达瑞财混合E
报告期期初基金份额总额	1,107,047,655.67	7,725,220.32
报告期期间基金总申购份额	4,712,044.18	1,154,588.44
减：报告期期间基金总赎回份额	974,150.84	72,150.08
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	1,110,785,549.01	8,807,658.68

## § 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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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	1,084,244,303.99	0.00	0.00	1,084,244,303.99	96.84%

#### 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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达瑞财灵活配置混合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。

### 9.2 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。

### 9.3 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