

# 易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

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：平安银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 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	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 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贵金属投资明细	44
7.9 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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44

7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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情况.....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§ 11 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	51
11.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金	
基金简称	易方达悦安一年持有债券	
基金主代码	011298	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 4 月 6 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	913,793,277.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
下属分级基金的交易代码	011298	011299
报告期末下属分级基金的份额总额	401,109,015.77 份	512,684,261.49 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金通过在可投范围内的多类资产间的动态配置，在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略追求基金资产的稳定增值。1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的配置比例。2、本基金在债券投资上主要通过久期配置、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；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资；本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。3、本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。4、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。5、本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的风险等。
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×8%+中证港股通综合指数收益率×2%
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理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。

## 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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	潘琦
	联系电话	020-85102688	0755-22168257
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95511-3
传真		020-38798812	0755-82080387
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
办公地址		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； 广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	广东省深圳市福田区益田路 5023号平安金融中心B座
邮政编码		510620; 519031	518001
法定代表人		刘晓艳	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	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; 广东省珠海市横琴新区 荣粤道 188 号 6 层

## § 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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
---------------	--------------------------------------

	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
本期已实现收益	4,660,102.51	4,442,531.45
本期利润	5,876,641.58	5,752,684.00
加权平均基金份额本期利润	0.0113	0.0092
本期加权平均净值利润率	1.14%	0.93%
本期基金份额净值增长率	0.88%	0.66%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2024年6月30日)</b>	
	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
期末可供分配利润	742,181.73	-5,682,089.35
期末可供分配基金份额利润	0.0019	-0.0111
期末基金资产净值	401,851,197.50	507,002,172.14
期末基金份额净值	1.0019	0.9889
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2024年6月30日)</b>	
	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
基金份额累计净值增长率	0.19%	-1.11%

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.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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

易方达悦安一年持有债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-1.09%	0.16%	0.47%	0.05%	-1.56%	0.11%
过去三个月	0.31%	0.19%	1.57%	0.08%	-1.26%	0.11%
过去六个月	0.88%	0.23%	3.63%	0.09%	-2.75%	0.14%
过去一年	-0.26%	0.21%	4.42%	0.09%	-4.68%	0.12%
过去三年	-0.42%	0.16%	9.80%	0.11%	-10.22%	0.05%
自基金合同生效起至今	0.19%	0.16%	11.06%	0.11%	-10.87%	0.05%

易方达悦安一年持有债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-1.12%	0.16%	0.47%	0.05%	-1.59%	0.11%
过去三个月	0.20%	0.19%	1.57%	0.08%	-1.37%	0.11%
过去六个月	0.66%	0.23%	3.63%	0.09%	-2.97%	0.14%
过去一年	-0.67%	0.21%	4.42%	0.09%	-5.09%	0.12%
过去三年	-1.61%	0.16%	9.80%	0.11%	-11.41%	0.05%
自基金合同生效起至今	-1.11%	0.16%	11.06%	0.11%	-12.17%	0.05%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 4 月 6 日至 2024 年 6 月 30 日)

易方达悦安一年持有债券 A



易方达悦安一年持有债券 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0.19%，同期业绩比较基准收益率为11.06%；C类基金份额净值增长率为-1.11%，同期业绩比较基准收益率为11.06%。

## § 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，本基金管理人成立于2001年4月17日，注册资本13,244.2万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 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		
张雅君	本基金的基金经理，易方达裕丰回报债券、易方达裕富债券、易方达招易一年持有混合、易方达磐恒九个月持有混合、易方达磐泰一年持	2021-04-06	-	15年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任海通证券股份有限公司项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券

	有混合（自 2020 年 08 月 14 日至 2024 年 06 月 11 日）、易方达悦通一年持有混合、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合的基金经理，易方达安心回报债券、易方达丰和债券的基金经理助理，多资产公募投资部总经理、多资产研究部总经理				交易员、固定收益研究员、固定收益基金投资部总经理助理、混合资产投资部总经理助理、多资产公募投资部负责人，易方达增强回报债券、易方达纯债债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达裕祥回报债券、易方达富惠纯债债券、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达恒益定开债券发起式、易方达富财纯债债券、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式的基金经理。
周琼	本基金的基金经理助理，易方达鑫转添利混合、易方达裕丰回报债券、易方达丰华债券、易方达新收益混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达安盈回报混合、易方达丰和债券、易方达安心回报债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达丰惠混合、易方达招易一年持有混合（自 2020 年 07 月 09 日至 2024 年 02 月 27 日）、易方达瑞锦混合发起式、易方达磐恒九个月持有混合（自 2020 年 08 月 11 日至 2024 年 02 月 27 日）、易方达磐泰一年持有混合、易方达悦享一年持有混合、易方达悦兴一年持有混合、易方达悦通一年持有混合（自 2020 年 12 月 18 日至 2024 年 02 月 27 日）、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达宁易一年持有混合（自 2021 年 04 月 30 日至 2024 年 02 月 27 日）、易方达稳泰一年持有混合（自 2021 年 05 月 22 日至 2024 年 02 月 27 日）、易方达悦信一年持有混合、易方达瑞富混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦浦一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦稳一年持有混合、易方达安心回馈混合、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达悦鑫一年持有混合、易方达全球配置	2021-04-28	2024-02-28	10 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任凯仁投资咨询（上海）有限公司客户经理，易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员。

	混合（QDII）、易方达悦和稳健一年封闭运作债券的基金经理助理				
胡文伯	本基金的基金经理助理，易方达裕鑫债券、易方达鑫转招利混合、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达磐固六个月持有混合的基金经理，易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达磐恒九个月持有混合、易方达悦享一年持有混合的基金经理助理	2023-06-16	-	10 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，易方达双债增强债券的基金经理。
汪子冲	本基金的基金经理助理，易方达裕富债券、易方达磐固六个月持有混合、易方达新益混合、易方达瑞选混合、易方达瑞祺混合、易方达裕鑫债券、易方达鑫转增利混合、易方达鑫转招利混合、易方达瑞川混合发起式、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达磐恒九个月持有混合、易方达招易一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合的基金经理助理	2024-02-28	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任泰康资产管理有限责任公司固定收益研究高级经理。

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/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行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

#### 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 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 31 次，其中 26 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，5 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

上半年经济总体呈现走弱态势。一季度经济开局良好，一方面得益于外需的正向拉动，另一方面财政支出加快带动制造业投资回升也对内需形成良好支撑。但二季度经济较一季度有所走弱。虽然地产持续出台支持性政策，政府债券发行也有所提速，但国内经济内生需求仍然偏弱。具体来看，地产行业的下滑趋势并未扭转，销量和价格仍惯性下行，居民部门收入预期尚未出现显著改善；信贷增速持续下行，企业端真实融资需求不强。整体上看，经济内生增长动能和市场预期偏弱的格局持续主导经济和资本市场。债券市场方面，一季度受年初配置需求发力、风险偏好回落影响，债券走出流畅的牛市行情，并在三月份转为震荡。二季度债券市场整体仍然呈现抵抗式下行的格局。在资金面宽松、政府债券发行进度不及预期、尤其是银行业规范“手工补息”影响下，非银资金充裕，理财规模快速扩张，虽然央行反复提示长端利率债风险，但各类利率震荡后仍然保持下行的态势，最终 10 年国债收益率在二季度末收在上半年新低附近。股票市场波动较大，年初大幅下挫，二月开始出现修复行情，五月中旬后重新转为震荡下行。上半年股票市场总体呈现震荡和分化的态势，上证综指上半年小幅下跌 0.25%，沪深 300 指数小幅上涨 0.89%，小盘股跌幅较大，中证 2000 指数下跌 23.28%。

报告期内，债券一季度维持偏长的久期，一季度末考虑到债券估值偏贵、市场拥挤度较高，组合减持了部分弹性品种，久期略有下降，二季度组合整体保持偏中性的杠杆和久期水平，并积极进行结构调整，以提升组合流动性和灵活性。股票方面，本基金股票仓位小幅降低，主要考虑权益资产整体估值的低位，个股层面继续做一些均衡，对企业的估值更加采用弱假设，对盈利能力价值的

评估更审慎，对符合高置信度安全边际的龙头公司做仓位置换和集中。转债层面，组合仓位小幅提升，主要出于纯债溢价率低位的考量，在均值回复框架中，转债的风险收益比在中长期维度逐渐抬升，策略上仍然注重凸性价格区间的变化，个券注重考量个股空间和转债溢价率的均衡、以及信用风险和期权价值的均衡。

#### 4.4.2 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 1.0019 元，本报告期份额净值增长率为 0.88%，同期业绩比较基准收益率为 3.63%；C 类基金份额净值为 0.9889 元，本报告期份额净值增长率为 0.66%，同期业绩比较基准收益率为 3.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，政府基调为坚定不移实现全年经济社会发展目标任务。首先，内需方面，地产周期的下行过程仍未结束，加上居民面临现实和预期的收入下滑，虽然几次降息，但提前偿还房贷的情况暂时仍没有得到缓解，且消费萎靡，居民部门面临去杠杆的压力。企业部门存在产能过剩和下游需求不足的问题，虽然融资成本一降再降，企业部门仍缺乏扩张的动力，真实融资需求不强。其次，上半年外需对经济仍是拉动，但是下半年随着海外经济的走弱和地缘政治的不确定性，出口也将面临一定压力。如果要完成全年经济目标，预计需要通过政府加杠杆的方式，所以从政策选择的角度，财政政策更加值得关注。货币政策方面，名义利率已经屡创新低，但是实际利率水平仍然偏高，需要兼顾内外平衡的稳健的货币政策，如果仅采取小幅降息，对经济的支持作用是比较有限的。整体上看，经济内生增长动能偏弱，市场风险偏好不高的格局预计仍将主导经济和资本市场。债券市场方面，虽然央行多次提示长债风险，但债券利率仍呈现震荡下行，内生融资需求和预期弱，资产荒延续的格局仍没有得到根本改善，债券市场恐怕难以摆脱抵抗式下行的趋势，但综合考虑估值位置，组合将采取中性略偏积极应对，期限结构上可以向哑铃型配置倾斜。权益资产方面，红利风格短期胜率仍在，但盈利空间已大幅压缩，个券选择上倾向于更加严格为宜，同时考虑更加平衡的组合配置。

#### 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，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直接的重大利益冲突。

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

易方达悦安一年持有债券 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达悦安一年持有债券 C:本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

## § 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：易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,049,975.46	3,131,379.19
结算备付金		19,777,285.05	22,627,118.65
存出保证金		82,619.26	93,556.32
交易性金融资产	6.4.7.2	1,205,587,774.97	1,697,521,325.79
其中：股票投资		151,357,098.60	252,182,261.42
基金投资		-	-
债券投资		1,015,470,148.64	1,393,306,075.54
资产支持证券投资		38,760,527.73	52,032,988.83
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		271,200.00	3,844,992.97
应收股利		-	-
应收申购款		219.94	394.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,229,769,074.68	1,727,218,767.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		315,046,790.40	439,277,386.55
应付清算款		3,126,626.54	5,020,714.06
应付赎回款		1,831,790.31	1,618,246.81
应付管理人报酬		461,949.95	657,981.73
应付托管费		115,487.51	164,495.43
应付销售服务费		169,621.26	237,536.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30,716.27	57,605.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	132,722.80	156,400.88
负债合计		320,915,705.04	447,190,367.98
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	913,793,277.26	1,296,463,524.00
未分配利润	6.4.7.8	-4,939,907.62	-16,435,124.67
净资产合计		908,853,369.64	1,280,028,399.33
负债和净资产总计		1,229,769,074.68	1,727,218,767.31

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0019 元，C 类基金份额净值 0.9889 元；基金份额总额 913,793,277.26 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 401,109,015.77 份，C 类基金份额总额 512,684,261.49 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		21,308,817.29	38,868,093.39
1.利息收入		172,205.24	355,846.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	170,145.94	341,270.52
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,059.30	14,576.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,609,920.43	5,632,879.01
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-14,942,109.34	-38,933,344.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	30,837,432.95	39,519,145.69
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	846,359.00	1,892,653.72



贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,868,237.82	3,154,423.86
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,526,691.62	32,879,367.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		9,679,491.71	18,996,454.21
1. 管理人报酬		3,396,635.68	6,970,370.95
2. 托管费		849,158.91	1,742,592.72
3. 销售服务费		1,232,244.79	2,430,791.10
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,062,387.38	7,637,909.18
其中：卖出回购金融资产支出		4,062,387.38	7,637,909.18
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		18,275.59	85,803.79
8. 其他费用	6.4.7.18	120,789.36	128,986.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>11,629,325.58</b>	<b>19,871,639.18</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>11,629,325.58</b>	<b>19,871,639.18</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>11,629,325.58</b>	<b>19,871,639.18</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,296,463,524.00	-16,435,124.67	1,280,028,399.33
二、本期期初净资产	1,296,463,524.00	-16,435,124.67	1,280,028,399.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-382,670,246.74	11,495,217.05	-371,175,029.69
（一）、综合收益	-	11,629,325.58	11,629,325.58

总额			
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-382,670,246.74	-134,108.53	-382,804,355.27
其中: 1.基金申购款	452,861.19	-248.87	452,612.32
2.基金赎回款	-383,123,107.93	-133,859.66	-383,256,967.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	913,793,277.26	-4,939,907.62	908,853,369.64
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,927,857,151.87	-17,826,683.30	2,910,030,468.57
二、本期期初净资产	2,927,857,151.87	-17,826,683.30	2,910,030,468.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,093,917,020.58	17,185,666.24	-1,076,731,354.34
(一)、综合收益总额	-	19,871,639.18	19,871,639.18
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-1,093,917,020.58	-2,685,972.94	-1,096,602,993.52
其中: 1.基金申购款	501,946.48	648.92	502,595.40
2.基金赎回款	-1,094,418,967.06	-2,686,621.86	-1,097,105,588.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	1,833,940,131.29	-641,017.06	1,833,299,114.23

产			
---	--	--	--

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：王永铿

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达悦安一年持有期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[2020]3701 号《关于准予易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金注册的批复》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《易方达悦安一年持有期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，《易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金基金合同》于 2021 年 4 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 14,039,630,220.97 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,329.71 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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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净资产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更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策

的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资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，股权的股息、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。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	4,049,975.46
等于：本金	4,049,783.64
加：应计利息	191.82
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	4,049,975.46

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	208,384,365.92	-	151,357,098.60	-57,027,267.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	3,167,164.02		
	市场	322,869,029.48	328,459,319.34	2,423,125.84
	银行间		10,346,329.30	
	市场	666,439,857.23	687,010,829.30	10,224,642.77
合计	989,308,886.71	13,513,493.32	1,015,470,148.64	12,647,768.61
资产支持证券	39,639,839.48	228,527.73	38,760,527.73	-1,107,839.48
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,237,333,092.11	13,742,021.05	1,205,587,774.97	-45,487,338.19

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	30,533.44
其中：交易所市场	15,255.94
银行间市场	15,277.50
应付利息	-
预提费用	102,189.36
合计	132,722.80

## 6.4.7.7 实收基金

## 易方达悦安一年持有债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	591,491,263.49	591,491,263.49
本期申购	358,391.80	358,391.80
本期赎回（以“-”号填列）	-190,740,639.52	-190,740,639.52
本期末	401,109,015.77	401,109,015.77

## 易方达悦安一年持有债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	704,972,260.51	704,972,260.51
本期申购	94,469.39	94,469.39
本期赎回（以“-”号填列）	-192,382,468.41	-192,382,468.41
本期末	512,684,261.49	512,684,261.49

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.8 未分配利润

## 易方达悦安一年持有债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	717,139.42	-4,716,433.81	-3,999,294.39
本期期初	717,139.42	-4,716,433.81	-3,999,294.39
本期利润	4,660,102.51	1,216,539.07	5,876,641.58
本期基金份额交易产生的变动数	-817,991.07	-317,174.39	-1,135,165.46
其中：基金申购款	647.50	63.89	711.39
基金赎回款	-818,638.57	-317,238.28	-1,135,876.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,559,250.86	-3,817,069.13	742,181.73

## 易方达悦安一年持有债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,852,503.59	-5,583,326.69	-12,435,830.28
本期期初	-6,852,503.59	-5,583,326.69	-12,435,830.28
本期利润	4,442,531.45	1,310,152.55	5,752,684.00
本期基金份额交易产生的变动数	1,557,959.08	-556,902.15	1,001,056.93
其中：基金申购款	-794.30	-165.96	-960.26
基金赎回款	1,558,753.38	-556,736.19	1,002,017.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-852,013.06	-4,830,076.29	-5,682,089.35

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	6,488.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	162,984.25
其他	673.27
合计	170,145.94

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,942,109.34
股票投资收益——赎回差价收入	-



股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-14,942,109.34

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	97,703,553.07
减：卖出股票成本总额	112,521,009.26
减：交易费用	124,653.15
买卖股票差价收入	-14,942,109.34

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	19,524,066.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,313,366.94
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	30,837,432.95

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	852,600,918.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	832,664,260.07
减：应计利息总额	8,609,603.80
减：交易费用	13,687.95
买卖债券差价收入	11,313,366.94

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	846,475.66
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-116.66
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	846,359.00

#### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	12,328,648.77
减：卖出资产支持证券成本总额	11,923,116.66
减：应计利息总额	405,648.77
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-116.66

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,868,237.82
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,868,237.82

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	2,526,691.62
——股票投资	-3,898,817.00
——债券投资	7,766,391.96
——资产支持证券投资	-1,340,883.34
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	2,526,691.62

#### 6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	42,517.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	120,789.36

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
平安银行股份有限公司	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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 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。

**6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 债券交易**

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债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

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债券回购交易。

**6.4.10.1.5 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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,396,635.68	6,970,370.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,520,282.14	3,120,591.93
应支付基金管理人的净管理费	1,876,353.54	3,849,779.02

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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 5 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	849,158.91	1,742,592.72

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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 5 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 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 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	340.21	340.21
平安银行	-	1,217,217.26	1,217,217.26
合计	-	1,217,557.47	1,217,557.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	675.96	675.96
平安银行	-	2,408,117.26	2,408,117.26
合计	-	2,408,793.22	2,408,793.22

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金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 3 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行	240,284,849.81	143,873,918.50	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行	100,705,421.92	141,520,535.20	-	-	-	-

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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

###### 易方达悦安一年持有债券 A

无。

###### 易方达悦安一年持有债券 C

无。

## 6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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
平安银行-活期存款	4,049,975.46	6,488.42	1,149,842.44	13,261.11

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

## 6.4.10.7 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。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

## 易方达悦安一年持有债券 A

本报告期内未发生利润分配。

## 易方达悦安一年持有债券 C

本报告期内未发生利润分配。

## 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 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。

## 6.4.12.2 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暂时停牌等流通受限股票。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 120,046,790.40 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
2028037	20 光大银行 永续债	2024-07-02	106.64	334,000	35,616,245.14
2128032	21 兴业银行	2024-07-03	106.48	148,000	15,759,468.63

	二级 01				
2128047	21 招商银行 永续债	2024-07-03	105.73	600,000	63,437,744.26
2128051	21 工商银行 二级 02	2024-07-04	105.16	200,000	21,032,740.98
合计				1,282,000	135,846,199.01

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 195,000,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。



#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 109.30%(2023 年 12 月 31 日：107.38%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	49,591,626.21	70,905,754.10
合计	49,591,626.21	70,905,754.10

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	862,630,340.13	1,254,847,574.05
AAA 以下	35,224,896.28	16,682,423.89
未评级	58,181,063.23	50,870,323.50
合计	956,036,299.64	1,322,400,321.44

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	38,760,527.73	52,032,988.83
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	38,760,527.73	52,032,988.83

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	9,842,222.79	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	9,842,222.79	0.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,049,975.46	-	-	-	4,049,975.46
结算备付金	19,777,285.05	-	-	-	19,777,285.05
存出保证金	82,619.26	-	-	-	82,619.26
交易性金融资产	190,423,439.89	632,533,240.99	231,273,995.49	151,357,098.60	1,205,587,774.

					97
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	271,200.00	271,200.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	219.94	219.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	214,333,319.66	632,533,240.99	231,273,995.49	151,628,518.54	1,229,769,074.68
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	315,046,790.40	-	-	-	315,046,790.40
应付清算款	-	-	-	3,126,626.54	3,126,626.54
应付赎回款	-	-	-	1,831,790.31	1,831,790.31
应付管理人报酬	-	-	-	461,949.95	461,949.95
应付托管费	-	-	-	115,487.51	115,487.51
应付销售服务费	-	-	-	169,621.26	169,621.26
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	30,716.27	30,716.27
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	132,722.80	132,722.80
负债总计	315,046,790.40	-	-	5,868,914.64	320,915,705.04
利率敏感度缺口	-100,713,470.74	632,533,240.99	231,273,995.49	145,759,603.90	908,853,369.64
<b>上年度末</b>					
<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	3,131,379.19	-	-	-	3,131,379.19
结算备付金	22,627,118.65	-	-	-	22,627,118.65
存出保证金	93,556.32	-	-	-	93,556.32

交易性金融资产	287,378,042.11	715,649,160.59	442,311,861.67	252,182,261.42	1,697,521,325.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	3,844,992.97	3,844,992.97
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	394.39	394.39
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	313,230,096.27	715,649,160.59	442,311,861.67	256,027,648.78	1,727,218,767.31
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	439,277,386.55	-	-	-	439,277,386.55
应付清算款	-	-	-	5,020,714.06	5,020,714.06
应付赎回款	-	-	-	1,618,246.81	1,618,246.81
应付管理人报酬	-	-	-	657,981.73	657,981.73
应付托管费	-	-	-	164,495.43	164,495.43
应付销售服务费	-	-	-	237,536.56	237,536.56
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	57,605.96	57,605.96
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	156,400.88	156,400.88
负债总计	439,277,386.55	-	-	7,912,981.43	447,190,367.98
利率敏感度缺口	-126,047,290.28	715,649,160.59	442,311,861.67	248,114,667.35	1,280,028,399.33

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日

1.市场利率下降 25 个基点	4,562,547.57	6,791,758.93
2.市场利率上升 25 个基点	-4,501,164.39	-6,741,650.94

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	151,357,098.60	16.65	252,182,261.42	19.70
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	151,357,098.60	16.65	252,182,261.42	19.70

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	138,372,966.56	176,083,217.57
2.业绩比较基准下降 5%	-138,372,966.56	-176,083,217.57	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日
第一层次	210,231,246.15
第二层次	995,356,528.82
第三层次	-
合计	1,205,587,774.97

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	权益投资	151,357,098.60	12.31
	其中：股票	151,357,098.60	12.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,054,230,676.37	85.73
	其中：债券	1,015,470,148.64	82.57
	资产支持证券	38,760,527.73	3.15
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,827,260.51	1.94
8	其他各项资产	354,039.20	0.03
9	合计	1,229,769,074.68	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 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	126,729,020.60	13.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,545,824.00	0.17
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-



H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,618,370.00	0.18
J	金融业	21,463,884.00	2.36
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	151,357,098.60	16.65

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	109,800	14,058,792.00	1.55
2	600486	扬农化工	241,670	13,642,271.50	1.50
3	688696	极米科技	155,394	12,002,632.56	1.32
4	002916	深南电路	112,072	11,853,855.44	1.30
5	600036	招商银行	314,700	10,759,593.00	1.18
6	601658	邮储银行	2,111,300	10,704,291.00	1.18
7	600309	万华化学	113,868	9,207,366.48	1.01
8	300973	立高食品	326,000	9,157,340.00	1.01
9	002841	视源股份	290,600	8,581,418.00	0.94
10	600519	贵州茅台	5,660	8,305,427.40	0.91
11	002415	海康威视	267,508	8,268,672.28	0.91
12	603517	绝味食品	445,480	6,860,392.00	0.75
13	000786	北新建材	187,200	5,552,352.00	0.61
14	600298	安琪酵母	118,000	3,295,740.00	0.36
15	000333	美的集团	48,432	3,123,864.00	0.34
16	300628	亿联网络	76,380	2,808,492.60	0.31
17	688059	华锐精密	50,178	2,277,077.64	0.25
18	603833	欧派家居	41,200	2,206,672.00	0.24
19	002756	永兴材料	49,620	1,775,403.60	0.20

20	601233	桐昆股份	106,400	1,698,144.00	0.19
21	300253	卫宁健康	274,300	1,618,370.00	0.18
22	601117	中国化学	187,600	1,545,824.00	0.17
23	688598	金博股份	37,507	1,061,448.10	0.12
24	002371	北方华创	3,100	991,659.00	0.11

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300973	立高食品	5,327,050.00	0.42
2	688696	极米科技	3,734,085.03	0.29
3	603833	欧派家居	2,437,961.00	0.19
4	002916	深南电路	1,249,041.00	0.10
5	603517	绝味食品	1,236,899.41	0.10
6	002841	视源股份	972,880.00	0.08
7	300496	中科创达	616,375.00	0.05
8	873806	云星宇	20,372.00	0.00

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	8,102,405.34	0.63
2	002572	索菲亚	7,033,093.84	0.55
3	000786	北新建材	6,120,750.00	0.48
4	601658	邮储银行	6,002,187.00	0.47
5	600690	海尔智家	5,485,988.00	0.43
6	600150	中国船舶	4,701,793.00	0.37
7	600519	贵州茅台	4,416,448.00	0.35
8	002831	裕同科技	3,922,799.85	0.31
9	601117	中国化学	3,764,513.00	0.29
10	002304	洋河股份	3,728,806.00	0.29
11	688696	极米科技	3,500,614.52	0.27
12	601233	桐昆股份	3,292,435.00	0.26
13	000528	柳工	3,256,085.00	0.25
14	000651	格力电器	2,947,431.22	0.23
15	002415	海康威视	2,601,557.00	0.20
16	000858	五粮液	2,451,390.00	0.19

17	000932	华菱钢铁	2,355,160.00	0.18
18	300628	亿联网络	2,249,814.00	0.18
19	600745	闻泰科技	2,236,213.00	0.17
20	002409	雅克科技	2,013,563.00	0.16

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	15,594,663.44
卖出股票收入（成交）总额	97,703,553.07

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	14,795,704.07	1.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	638,160,822.61	70.22
	其中：政策性金融债	46,065,036.89	5.07
4	企业债券	132,665,822.48	14.60
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	160,910,306.95	17.70
7	可转债（可交换债）	59,095,269.74	6.50
8	同业存单	9,842,222.79	1.08
9	其他	-	-
10	合计	1,015,470,148.64	111.73

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	2128047	21 招商银行永续债	600,000	63,437,744.26	6.98
2	2228014	22 交通银行二级 01	600,000	62,776,622.95	6.91
3	185190	21 诚通 23	600,000	61,158,509.59	6.73
4	2028037	20 光大银行永续债	500,000	53,317,732.24	5.87
5	2128008	21 中国银行二级 01	500,000	52,352,986.30	5.76

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	156659	PR 产 1A	200,000	19,879,712.39	2.19
2	189847	21LJZ 优	200,000	18,880,815.34	2.08

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通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。招商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、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。中国光大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。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。

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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	82,619.26
2	应收清算款	271,200.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	219.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	354,039.20

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113021	中信转债	6,813,900.10	0.75

2	113641	华友转债	5,930,746.95	0.65
3	113060	浙 22 转债	5,574,560.99	0.61
4	128048	张行转债	3,500,022.78	0.39
5	113069	博 23 转债	3,231,337.59	0.36
6	110079	杭银转债	3,220,862.10	0.35
7	113049	长汽转债	2,475,403.04	0.27
8	127050	麒麟转债	2,393,555.55	0.26
9	110087	天业转债	2,218,888.82	0.24
10	128081	海亮转债	2,160,351.19	0.24
11	113037	紫银转债	1,886,419.07	0.21
12	113056	重银转债	1,783,068.89	0.20
13	123035	利德转债	1,567,497.05	0.17
14	110062	烽火转债	1,147,998.82	0.13
15	113050	南银转债	1,133,725.22	0.12
16	128083	新北转债	1,020,528.32	0.11
17	110094	众和转债	966,378.38	0.11
18	123119	康泰转 2	937,935.64	0.10
19	123210	信服转债	904,453.35	0.10
20	127084	柳工转 2	761,723.72	0.08
21	123208	孩王转债	730,949.61	0.08
22	110073	国投转债	621,295.71	0.07
23	113549	白电转债	593,213.55	0.07
24	128135	洽洽转债	524,485.82	0.06
25	128108	蓝帆转债	507,394.34	0.06
26	113669	景 23 转债	502,840.47	0.06
27	110081	闻泰转债	451,906.24	0.05
28	127089	晶澳转债	422,293.06	0.05
29	123048	应急转债	391,928.90	0.04
30	110084	贵燃转债	342,003.35	0.04
31	123145	药石转债	309,030.02	0.03
32	113582	火炬转债	276,740.01	0.03
33	113033	利群转债	270,412.98	0.03
34	113655	欧 22 转债	270,029.11	0.03
35	123108	乐普转 2	262,427.01	0.03
36	113616	韦尔转债	257,094.22	0.03
37	113047	旗滨转债	241,234.22	0.03
38	118034	晶能转债	234,295.50	0.03
39	132020	19 蓝星 EB	221,122.19	0.02
40	113058	友发转债	201,325.32	0.02
41	123022	长信转债	199,867.98	0.02
42	113584	家悦转债	124,257.01	0.01
43	113043	财通转债	116,712.68	0.01
44	110052	贵广转债	98,759.97	0.01
45	118031	天 23 转债	80,780.57	0.01

46	111017	蓝天转债	1,612.60	0.00
----	--------	------	----------	------

### 7.12.5 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。

## § 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
易方达悦安一年持有债券 A	4,885	82,110.34	0.00	0.00%	401,109,015.77	100.00%
易方达悦安一年持有债券 C	5,271	97,265.08	0.00	0.00%	512,684,261.49	100.00%
合计	10,156	89,975.71	0.00	0.00%	913,793,277.26	100.00%

### 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	易方达悦安一年持有债券 A	7,960.71	0.0020%
	易方达悦安一年持有债券 C	200,100.99	0.0390%
	合计	208,061.70	0.0228%

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	易方达悦安一年持有债券 A	0
	易方达悦安一年持有债券 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达悦安一年持有债券 A	0
	易方达悦安一年持有债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
基金合同生效日（2021 年 4 月 6 日）基金份额总额	6,367,393,958.47	7,672,236,262.50
本报告期初基金份额总额	591,491,263.49	704,972,260.51
本报告期基金总申购份额	358,391.80	94,469.39
减：本报告期基金总赎回份额	190,740,639.52	192,382,468.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	401,109,015.77	512,684,261.49

## § 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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 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	
东北证券	2	2,831,974.00	2.50%	2,265.58	3.31%	-
海通证券	1	56,746,579.91	50.10%	34,048.37	49.68%	-
华创证券	1	56,454.45	0.05%	33.86	0.05%	-
浙商证券	1	53,642,836.15	47.36%	32,185.74	46.96%	-

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。本报告期内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、个股分析报告及丰富全面的信息；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
东北证券	25,335,761.92	9.93%	3,814,900,000.00	17.22%	-	-
海通证券	39,247,260.30	15.38%	3,554,100,000.00	16.05%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	190,641,581.81	74.70%	14,779,000,000.00	66.73%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-01-19
2	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-02-28
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报	2024-03-29
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-04-20
5	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达悦安一年持有期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。

### 11.2 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。

### 11.3 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

二〇二四年八月三十日