

# 易方达安心回报债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

### 2022 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十日

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 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	5
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53

7.12	投资组合报告附注 .....	53
§8	基金份额持有人信息 .....	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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的情况 .....	57
§9	开放式基金份额变动 .....	57
§10	重大事件揭示 .....	57
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4	基金投资策略的改变 .....	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8	其他重大事件 .....	60
§11	备查文件目录 .....	62
11.1	备查文件目录 .....	62
11.2	存放地点 .....	62
11.3	查阅方式 .....	62

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达安心回报债券型证券投资基金	
基金简称	易方达安心回报债券	
基金主代码	110027	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 21 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,573,239,990.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
下属分级基金的交易代码	110027	110028
报告期末下属分级基金的份额总额	9,012,596,075.24 份	1,560,643,915.46 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争战胜通货膨胀和银行定期存款利率，主要面向以储蓄存款为主要投资工具的中小投资者，追求基金资产的长期、持续、稳定增值，努力为投资者实现有吸引力的回报，为投资者提供养老投资的工具。
投资策略	本基金采取稳健的资产配置策略，通过自上而下的方法进行固定收益类品种与权益类品种的战略及战术资产配置，在控制基金资产净值波动、追求收益稳定的基础上，提高基金的收益水平。具体来看，本基金主要通过研究各类资产在较长时期的收益与风险水平特征，及各类资产收益与风险间的相关关系，对国内外宏观经济形势与政策、市场利率走势、信用利差水平、利率期限结构以及证券市场走势等因素进行分析，在本基金合同约定范围内制定合理的战略资产配置计划。固定收益品种投资方面，本基金将经济分为衰退、萧条、复苏、繁荣四个阶段，并在各个阶段通过投资不同的固定收益类属资产，以获得超越长期平均通胀水平的回报。权益类品种投资方面，本基金采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略，严格管理权益类品种的投资比例以及净值的波动幅度。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	三年期银行定期存款收益率（税后）+1.0%
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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55 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	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 43 楼

## 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

## §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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
本期已实现收益	462,061,978.82	70,125,090.06
本期利润	-649,929,670.43	-110,100,598.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0618	-0.0622

本期加权平均净值利润率	-3.22%	-3.29%
本期基金份额净值增长率	-2.11%	-2.28%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2022年6月30日)</b>	
	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
期末可供分配利润	1,636,831,189.54	255,126,104.58
期末可供分配基金份额利润	0.1816	0.1635
期末基金资产净值	17,599,551,157.10	3,007,010,884.39
期末基金份额净值	1.953	1.927
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2022年6月30日)</b>	
	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
基金份额累计净值增长率	273.48%	259.59%

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

#### 易方达安心回报债券 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	2.47%	0.35%	0.31%	0.01%	2.16%	0.34%
过去三个月	3.66%	0.43%	0.93%	0.01%	2.73%	0.42%
过去六个月	-2.11%	0.46%	1.86%	0.01%	-3.97%	0.45%
过去一年	0.14%	0.40%	3.75%	0.01%	-3.61%	0.39%
过去三年	31.54%	0.48%	11.25%	0.01%	20.29%	0.47%
自基金合同生效起至今	273.48%	0.72%	48.92%	0.01%	224.56%	0.71%

#### 易方达安心回报债券 B

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	2.45%	0.34%	0.31%	0.01%	2.14%	0.33%
过去三个月	3.55%	0.43%	0.93%	0.01%	2.62%	0.42%
过去六个月	-2.28%	0.46%	1.86%	0.01%	-4.14%	0.45%
过去一年	-0.26%	0.40%	3.75%	0.01%	-4.01%	0.39%
过去三年	29.96%	0.48%	11.25%	0.01%	18.71%	0.47%

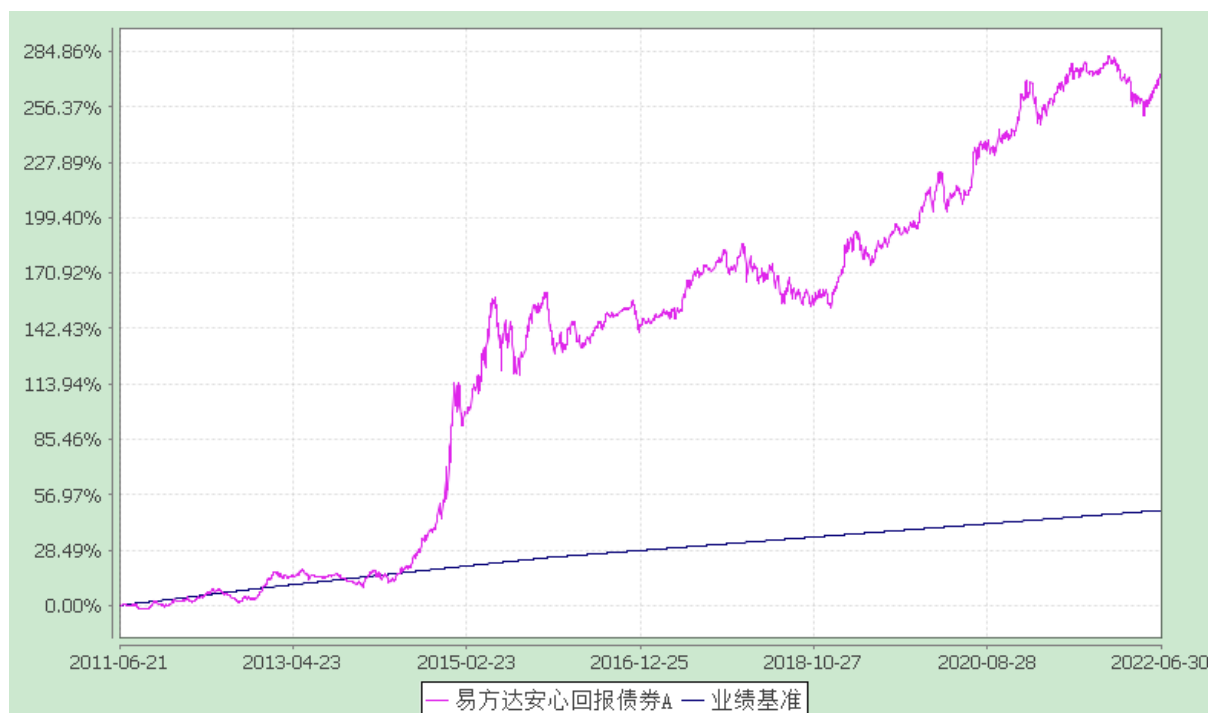
自基金合同生效起至今	259.59%	0.72%	48.92%	0.01%	210.67%	0.71%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

### 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

易方达安心回报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

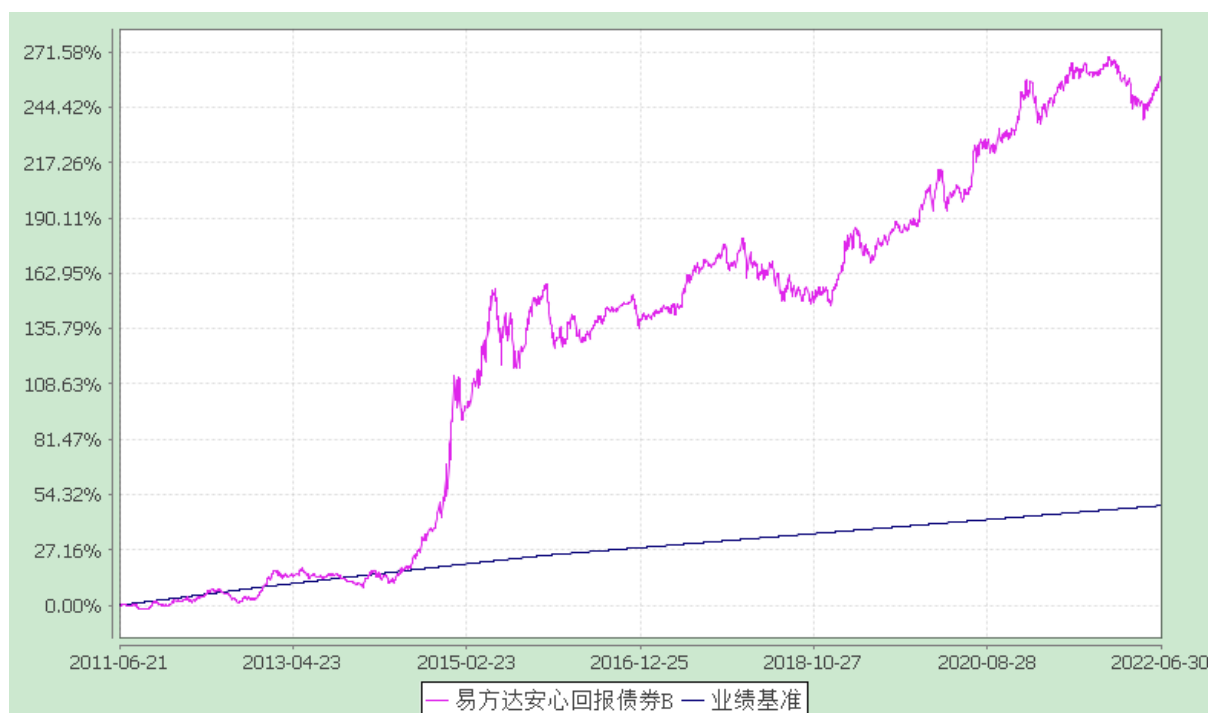
(2011年6月21日至2022年6月30日)

易方达安心回报债券 A



易方达安心回报债券 B





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 273.48%，同期业绩比较基准收益率为 48.92%；B 类基金份额净值增长率为 259.59%，同期业绩比较基准收益率为 48.92%。

## §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。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，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		
张清华	本基金的基金经理，易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达安盈回报混合、易方达新收益混合、易方达丰华债券（自 2019 年 02 月	2013-12-23	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经

	19 日至 2022 年 03 月 21 日)、易方达悦兴一年持有混合的基金经理, 副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员				理、固定收益基金投资部总经理、混合资产投资部总经理、多资产投资业务总部总经理, 易方达裕如混合、易方达安心回报混合、易方达瑞选混合、易方达裕祥回报债券、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、易方达裕鑫债券、易方达瑞通混合、易方达瑞程混合、易方达瑞弘混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达鑫转添利混合、易方达鑫转增利混合、易方达鑫转招利混合、易方达磐固六个月持有混合的基金经理。
张雅君	本基金的基金经理助理, 易方达纯债债券、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、易方达磐泰一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、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, 易方达丰和债券、易方达磐固六个月持有混合(自 2020 年 09 月 15 日至 2022 年 05 月 24 日)、易方达悦兴一年持有混合(自 2020 年 12 月 01 日至 2022 年 05 月 19 日)的基金经理助理, 多资产公募投资部总经理	2015-02-17	-	13 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。
杨康	本基金的基金经理助理, 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(自 2020 年 04 月 22 日至 2022 年 05 月 23 日)、易方达瑞锦混合发起式(自 2020 年 07 月 07 日至 2022 年 05 月 23 日)、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达裕富债券的基金经理, 易方达安盈回报混合、易方达丰华债券、易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达招易一年持有混合(自 2020 年 07 月 09 日至 2022 年 05 月 24 日)、易方达磐恒九个月持有混合(自 2020 年 08 月 11 日至 2022 年 05 月 24 日)、易方达磐泰一年持有混合(自 2020 年 08 月 20 日至 2022 年 05 月 24 日)、	2019-06-19	-	7 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部研究员、投资经理助理, 易方达基金管理有限公司投资经理。

	易方达磐固六个月持有混合（自 2020 年 09 月 15 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦享一年持有混合（自 2020 年 09 月 24 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦兴一年持有混合（自 2020 年 12 月 01 日至 2022 年 05 月 19 日）、易方达悦通一年持有混合（自 2020 年 12 月 18 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达鑫转添利混合（自 2021 年 01 月 22 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦盈一年持有混合（自 2021 年 02 月 05 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦弘一年持有混合（自 2021 年 02 月 25 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达宁易一年持有混合（自 2021 年 04 月 30 日至 2022 年 05 月 24 日）的基金经理助理				
周琼	本基金的基金经理助理，易方达鑫转添利混合、易方达鑫转招利混合、易方达高等级信用债债券（自 2019 年 09 月 05 日至 2022 年 05 月 19 日）、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券（自 2019 年 09 月 05 日至 2022 年 05 月 19 日）、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、易方达裕鑫债券、易方达鑫转增利混合、易方达纯债债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新益混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞选混合、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、易方达裕富债券、易方达瑞川混合发起式、易方达丰惠混合、易方达招易一年持有混合、易方达瑞锦混合发起式、易方达磐恒九个月持有混合、易方达磐泰一年持有混合、易方达磐固六个月持有混合、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、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方	2019-10-11	-	8 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。

达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合、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的基金经理助理				
--	--	--	--	--

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/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 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 22 次，其中 14 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，8 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

上半年资本市场持续受到国内和海外市场风险因素的影响。海外方面，年初以来始终存在高通胀担忧，而地缘风险事件的爆发进一步推升了大宗商品价格，全球通胀加速上升、货币政策持续收紧，这引发海外经济放缓甚至衰退预期，10 年期美债收益率从年初的 1.5% 大幅冲高至 3.5% 并最终回落至 3.0% 附近。国内方面，年初稳增长力度较大，货币财政政策积极，经济和金融数据均出现一定程度改善，但 3 月以后全国各地疫情复发打断了经济复苏节奏，生产、物流、消费活动受到影响，地产销售也大幅下滑，房地产企业风险事件频发引发市场担忧，直至 5 月末疫情影响逐步消退，经济开始修复。上半年来看，国内经济受到疫情影响，稳增长压力始终较大，但政策力度相对克制，并未出台大规模刺激政策，经济疫后修复的节奏和幅度都相对温和。

债券方面，年初经济增长压力较大，货币政策率先发力，在宽松预期的推动下债券收益率快速下行至年内低点。但随着财政发力、各地地产政策陆续出台，宽信用预期渐起，10 年期国债收益率一路上行至年内高点，信用利差也大幅走扩。4 月以来随着疫情再度复发与扩散，央行将银行间资金利率维持在大幅低于政策利率的水平，这带动收益率曲线陡峭化下行，信用利差也显著压缩。直至 5 月末疫情得到控制后，经济环比改善，债券再度回调。整个上半年，受偏低资金价格的带动，1 年期国债收益率大幅下行约 30bp，而在弱经济与稳增长预期期间来回摇摆的 10 年期国债收益率始终未突破 2.68-2.85% 的震荡区间。

权益方面，今年前 4 个月在俄乌冲突、国内疫情、海外加息等多重因素的共振下指数加速探底，成长股受美债利率飙升影响跌幅更大。5 月以来随着疫后复产复工逐步推进、中央和地方稳增长政策密集推出且开始强调落实、流动性环境保持宽松，市场极度悲观的情绪有所回暖，汽车、电力设备等成长板块在政策带动和高景气支撑下领涨本轮修复行情。

转债同样跟随股市先下后上，在经历去年的“双击”行情后，转债资产年初估值已经处于历史高位，随着债券的调整尤其是权益市场的大幅波动，一季度转债大幅下跌，估值也回到了历史中枢位置。二季度随着权益市场企稳并迅速反弹，转债随之估值与平价再度“双击”，收复年内主要跌幅。结构方面，大盘转债表现相对稳健，一季度大幅领先，小盘转债在二季度再度活跃，推升了整体市

场的热度和情绪。

报告期内，本基金规模有所下降。经过前 4 个月的快速下跌，市场风险得到了较大的释放，从中长期维度考虑，很多优质公司已经进入相对合理甚至低估的位置，赔率具备吸引力，因此组合在赎回的过程中选择被动提升股票仓位，二季度维持较高仓位运作，6 月在市场反弹过程中对涨幅较大的成长股适当止盈。上半年组合持续对持仓结构进行调整，降低了受到政策不确定性影响较大的医药行业占比，加仓了稳增长相关的顺周期行业，并对食品饮料持仓进行个股调整。转债方面整体维持较高仓位，一季度考虑转债资产整体估值过高，股性转债平价、溢价率双高现象较为突出，减持了部分高价转债；在转债出现显著调整且估值有效压缩后，4 月、5 月组合重新提高了转债仓位，加仓了小盘转债与股性转债，同时积极配置新上市个券。债券方面，组合流动性主要由债券资产提供，持仓以高等级信用债为主获取票息收益，同时择机参与利率债波段操作，杠杆水平保持稳定。

#### 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 1.953 元，本报告期份额净值增长率为-2.11%，同期业绩比较基准收益率为 1.86%；B 类基金份额净值为 1.927 元，本报告期份额净值增长率为-2.28%，同期业绩比较基准收益率为 1.86%。

#### 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，随着疫情缓解、稳增长政策推进落实，经济环比持续修复，但考虑到经济增长仍面临多方面制约，下半年预计修复高度有限。海外方面，全球央行同时处于加息通道，经济增长将明显走弱，这将对下半年国内出口形成拖累。国内方面，疫情扩散的可能性依然存在，预计对生产、消费及物流活动带来持续影响，同时地产的恢复仍然较为缓慢。海外加息环境制约我国货币政策进一步放松的空间，国内经济对冲的手段更多集中在财政和基建领域。在当前政策力度下，预计下半年经济增速较二季度回升，但高度可能有限，呈现弱复苏格局。

考虑到经济温和回升，企业盈利预期逐步企稳，但是大幅上行的可能性较低，流动性开始出现好转，预计权益市场仍以结构性行情为主。短期疫情对经济的影响逐渐缓解，货币政策未来将逐步回归正常化，经济环比改善，债券收益率下行空间有限，但考虑到经济增长尚未回到潜在增速水平，货币政策亦不会大幅收紧，基本面弱复苏格局下，预计债券收益率整体仍维持震荡态势。

本基金债券部分仍将以中高等级信用债为主，保持一定的杠杆水平，以获取票息收益为主，同时保持较高的流动性，积极参与利率波段及债券类属品种的交易机会；转债部分考虑到目前估值重回高位，大盘转债估值更为合理，后续将兑现部分双高转债与小盘转债，控制整体仓位与弹性；权益部分将根据市场情况，适度加大自上而下资产配置的作用，并优化个股持仓。与此同时，组合保

持灵活性，根据市场变化及时调仓，力争以长期稳健的业绩回报基金持有人。

#### 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

易方达安心回报债券 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达安心回报债券 B: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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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：易方达安心回报债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,459,910.65	1,118,596.59
结算备付金		308,053,971.02	170,276,894.08
存出保证金		539,483.00	390,219.20
交易性金融资产	6.4.7.2	25,114,592,803.04	34,576,108,950.61
其中：股票投资		4,023,951,827.52	4,832,229,708.43
基金投资		-	-
债券投资		20,306,402,745.09	28,613,116,242.18
资产支持证券投资		784,238,230.43	1,130,763,000.00
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		129,893,484.78	751,920,815.14
应收股利		-	-
应收申购款		18,453,319.84	36,327,482.95



递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	317,136,260.95
资产总计		25,572,992,972.33	35,853,279,219.52
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
负债：			
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		4,793,011,203.48	7,242,994,810.00
应付清算款		105,369.61	752,035,468.08
应付赎回款		154,844,945.06	28,052,820.28
应付管理人报酬		12,021,625.32	16,405,803.27
应付托管费		3,434,750.06	4,687,372.39
应付销售服务费		995,100.74	1,367,669.84
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,086,407.69	1,629,702.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	931,528.88	1,175,938.23
负债合计		4,966,430,930.84	8,048,349,584.85
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	10,573,239,990.70	13,960,726,987.16
未分配利润	6.4.7.8	10,033,322,050.79	13,844,202,647.51
净资产合计		20,606,562,041.49	27,804,929,634.67
负债和净资产总计		25,572,992,972.33	35,853,279,219.52

注：1.报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.953 元，B 类基金份额净值 1.927 元；基金份额总额 10,573,239,990.70 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 9,012,596,075.24 份，B 类基金份额总额 1,560,643,915.46 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达安心回报债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-583,380,572.99	1,066,673,993.92
1.利息收入		2,113,923.93	231,657,069.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,089,751.99	1,782,069.76
债券利息收入		-	219,879,574.00
资产支持证券利息收入		-	9,540,149.43
买入返售金融资产收入		24,171.94	455,276.19
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		704,900,048.53	103,553,556.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	185,045,552.04	63,056,732.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	475,484,719.87	24,325,935.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	16,731,024.38	-513.07
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	27,638,752.24	16,171,401.33
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	-1,292,217,337.64	722,772,609.74
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	1,822,792.19	8,690,758.15
<b>减：二、营业总支出</b>		176,649,695.77	127,274,585.02
1. 管理人报酬		81,936,871.77	71,394,974.19
2. 托管费		23,410,534.77	20,398,564.03
3. 销售服务费		6,671,520.45	8,227,666.59
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		63,602,623.20	23,874,215.39
其中：卖出回购金融资产支出		63,602,623.20	23,874,215.39
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		854,100.15	685,366.32
8. 其他费用	6.4.7.18	174,045.43	2,693,798.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-760,030,268.76</b>	<b>939,399,408.90</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-760,030,268.76</b>	<b>939,399,408.90</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>-760,030,268.76</b>	<b>939,399,408.90</b>

注：上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号&lt;年度报告和

中期报告》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达安心回报债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	13,960,726,987.16	-	13,844,202,647.51	27,804,929,634.67
二、本期期初净资产（基金净值）	13,960,726,987.16	-	13,844,202,647.51	27,804,929,634.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,387,486,996.46	-	-3,810,880,596.72	-7,198,367,593.18
（一）、综合收益总额	-	-	-760,030,268.76	-760,030,268.76
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,387,486,996.46	-	-3,050,850,327.96	-6,438,337,324.42
其中：1.基金申购款	730,378,443.76	-	678,397,440.89	1,408,775,884.65
2.基金赎回款	-4,117,865,440.22	-	-3,729,247,768.85	-7,847,113,209.07
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	10,573,239,990.70	-	10,033,322,050.79	20,606,562,041.49
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	7,355,563,033.68	-	7,415,846,749.13	14,771,409,782.81
二、本期期初净资产（基金净值）	7,355,563,033.68	-	7,415,846,749.13	14,771,409,782.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,713,435,961.37	-	5,003,510,999.17	8,716,946,960.54
（一）、综合收益总额	-	-	939,399,408.90	939,399,408.90
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,713,435,961.37	-	4,064,111,590.27	7,777,547,551.64
其中：1.基金申购款	9,295,083,757.98	-	9,881,226,057.16	19,176,309,815.14
2.基金赎回款	-5,581,647,796.61	-	-5,817,114,466.89	-11,398,762,263.50
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	11,068,998,995.05	-	12,419,357,748.30	23,488,356,743.35

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：王永铨

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达安心回报债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]665号《关于核准易方达安心回报债券型证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达安心回报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，《易方达安心回报债券型证券投资基金基金合同》于2011年6月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,790,229,532.54份基金份额，其中认购资金利息折合786,926.23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，基金托管人为中国工商银行股份有限公

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基金净值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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相

关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉

入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 6.4.4.4 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线

法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,118,596.59 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 183.01 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,118,779.60 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 170,276,894.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 76,624.60 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面



价值为人民币 170,353,518.68 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 390,219.20 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 175.60 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 390,394.80 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 317,136,260.95 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 183.01 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 76,624.60 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 175.60 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 317,059,277.74 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 34,576,108,950.61 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 317,059,277.74 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 34,893,168,228.35 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,242,994,810.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 117,961.53 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,243,112,771.53 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 117,961.53 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 117,961.53 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 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。

##### (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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,459,910.65
等于：本金	1,459,745.21
加：应计利息	165.44
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	1,459,910.65

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,868,544,082.00	-	4,023,951,827.52	155,407,745.52

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,402,985,291.25	86,833,900.47	10,836,788,007.05	346,968,815.33
	银行间市场	9,263,486,351.71	143,498,738.04	9,469,614,738.04	62,629,648.29
	合计	19,666,471,642.96	230,332,638.51	20,306,402,745.09	409,598,463.62
	资产支持证券	771,696,972.60	8,780,230.43	784,238,230.43	3,761,027.40
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		24,306,712,697.56	239,112,868.94	25,114,592,803.04	568,767,236.54

#### 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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	79,938.06
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	736,990.67
其中：交易所市场	578,749.57

银行间市场	158,241.10
应付利息	-
预提费用	114,600.15
合计	931,528.88

## 6.4.7.7 实收基金

## 易方达安心回报债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,945,143,015.60	11,945,143,015.60
本期申购	600,346,025.18	600,346,025.18
本期赎回（以“-”号填列）	-3,532,892,965.54	-3,532,892,965.54
本期末	9,012,596,075.24	9,012,596,075.24

## 易方达安心回报债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,015,583,971.56	2,015,583,971.56
本期申购	130,032,418.58	130,032,418.58
本期赎回（以“-”号填列）	-584,972,474.68	-584,972,474.68
本期末	1,560,643,915.46	1,560,643,915.46

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

## 易方达安心回报债券 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	1,628,771,245.58	10,255,728,700.37	11,884,499,945.95
本期利润	462,061,978.82	-1,111,991,649.25	-649,929,670.43
本期基金份额交易产生的变动数	-454,002,034.86	-2,193,613,158.80	-2,647,615,193.66
其中：基金申购款	88,799,220.32	471,770,128.27	560,569,348.59
基金赎回款	-542,801,255.18	-2,665,383,287.07	-3,208,184,542.25

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,636,831,189.54	6,950,123,892.32	8,586,955,081.86

## 易方达安心回报债券 B

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	246,990,049.57	1,712,712,651.99	1,959,702,701.56
本期利润	70,125,090.06	-180,225,688.39	-110,100,598.33
本期基金份额交易产生的变动数	-61,989,035.05	-341,246,099.25	-403,235,134.30
其中：基金申购款	17,500,040.08	100,328,052.22	117,828,092.30
基金赎回款	-79,489,075.13	-441,574,151.47	-521,063,226.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	255,126,104.58	1,191,240,864.35	1,446,366,968.93

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	65,388.37
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	2,019,937.99
其他	4,425.63
合计	2,089,751.99

## 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	185,045,552.04
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	185,045,552.04

## 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,141,374,072.88
减：卖出股票成本总额	953,488,544.69
减：交易费用	2,839,976.15

买卖股票差价收入	185,045,552.04
----------	----------------

#### 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
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	296,243,997.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	179,240,722.65
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	475,484,719.87

##### 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
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,005,439,936.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,633,488,103.57
减：应计利息总额	192,547,381.55
减：交易费用	163,728.36
买卖债券差价收入	179,240,722.65

#### 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
	2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	16,959,319.46
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-228,295.08
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	16,731,024.38

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	404,043,102.03
减：卖出资产支持证券成本总额	395,304,295.08
减：应计利息总额	8,967,102.03
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-228,295.08

**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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	27,638,752.24
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	27,638,752.24

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-1,292,217,337.64
——股票投资	-899,326,962.57
——债券投资	-392,889,670.15
——资产支持证券投资	-704.92
——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	-1,292,217,337.64

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元



项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	1,822,592.19
其他	200.00
合计	1,822,792.19

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	55,092.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	43,245.28
银行间账户维护费	15,600.00
其他	600.00
合计	174,045.43

#### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	118,526.95	0.01%	-	-

**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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	71.12	0.00%	18.27	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	81,936,871.77	71,394,974.19
其中：支付销售机构的客户维护费	14,165,071.84	9,398,093.61

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	23,410,534.77	20,398,564.03

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,883,680.68	1,883,680.68
中国工商银行	-	509,519.37	509,519.37
广发证券	-	219,260.49	219,260.49
合计	-	2,612,460.54	2,612,460.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		

关联方名称	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B	合计
易方达基金管理有限公司	-	3,759,825.32	3,759,825.32
中国工商银行	-	448,361.95	448,361.95
广发证券	-	163,561.57	163,561.57
合计	-	4,371,748.84	4,371,748.84

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金销售服务费按前一日 B 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 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 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。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 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固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

##### 易方达安心回报债券 A

无。

##### 易方达安心回报债券 B

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	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021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
中国工商银行-活期存款	1,459,910.65	65,388.37	764,355.38	122,900.68

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商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

##### 易方达安心回报债券 A

本报告期内未发生利润分配。

##### 易方达安心回报债券 B

本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022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 2022 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 2,238,990,285.68 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
101801032	18 陕煤化 MTN003	2022-07-01	106.55	355,000	37,824,174.30
101900726	19 武水务 MTN001	2022-07-01	103.32	300,000	30,997,397.26
102000900	20 鲁能源 MTN003	2022-07-01	100.62	400,000	40,247,338.08
102001015	20 闽能源 MTN001	2022-07-01	101.39	500,000	50,696,890.41
102001516	20 信达地产 MTN002	2022-07-01	104.34	200,000	20,868,487.67
102001930	20 京煤 MTN001	2022-07-01	104.16	200,000	20,831,802.74
102002060	20 泰山投资 MTN001	2022-07-01	104.11	80,000	8,328,697.86
102002159	20 金融街 MTN002	2022-07-01	104.20	700,000	72,941,438.36
102100347	21 川交投 MTN001	2022-07-01	102.99	400,000	41,197,139.73
102103042	21 蜀道投资 MTN005	2022-07-01	102.92	400,000	41,169,016.99
102103166	21 诚通控股 MTN007	2022-07-01	102.49	3,000	307,478.14
131656048	16 武汉地铁 GN002	2022-07-01	104.46	400,000	41,783,342.47
210312	21 进出 12	2022-07-01	101.67	89,000	9,048,434.93
2180445	21 闽能源债 01	2022-07-01	103.05	189,000	19,477,310.60
220201	22 国开 01	2022-07-01	101.06	3,500,000	353,701,945.21
220401	22 农发 01	2022-07-01	100.52	6,015,000	604,623,844.93
102101323	21 萧山国资 MTN001	2022-07-04	103.98	1,095,000	113,854,806.00
102101795	21 宝钢 MTN001(可持 续挂钩)	2022-07-04	102.77	500,000	51,386,460.27
102103191	21 陕煤化 MTN010	2022-07-04	102.41	500,000	51,204,849.32
2180445	21 闽能源债 01	2022-07-04	103.05	264,000	27,206,402.10
101801144	18 冀港集	2022-07-05	105.98	400,000	42,392,177.53

	MTN002				
101900298	19 金隅 MTN001	2022-07-05	103.92	700,000	72,742,484.93
101901206	19 川高速 MTN003	2022-07-05	105.74	800,000	84,590,956.71
102000321	20 川高速 MTN001	2022-07-05	102.31	400,000	40,922,656.44
102000345	20 中铝集 MTN001A	2022-07-05	101.69	700,000	71,183,306.85
102100485	21 川高速 MTN003(权益 出资)	2022-07-05	102.93	16,000	1,646,804.95
102101095	21 晋焦煤 MTN002	2022-07-05	102.07	200,000	20,413,002.74
102101445	21 渝富 MTN004	2022-07-05	103.45	416,000	43,036,861.72
102101948	21 华润 MTN001	2022-07-05	103.27	700,000	72,286,602.74
101900980	19 中煤能源 MTN001	2022-07-06	106.54	1,053,000	112,186,579.61
102002154	20 川交投 MTN001	2022-07-06	104.27	222,000	23,146,876.83
102101310	21 南京国投 MTN001	2022-07-06	104.77	600,000	62,859,780.82
102101445	21 渝富 MTN004	2022-07-06	103.45	1,084,000	112,144,130.06
合计				23,381,000	2,397,249,479.30

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 2022 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 2,554,020,917.80 元，于 2022 年 7 月 1 日、2022 年 7 月 4 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。本基金在日常经营活动中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 2022 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 97.07%(2021 年 12 月 31 日：96.46%)。

##### 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	51,044,334.79
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	1,108,792,412.06	1,870,715,221.36
合计	1,108,792,412.06	1,921,759,556.15

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 2022年6月30日	上年度末 2021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 2022年6月30日	上年度末 2021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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	16,419,995,794.76	20,888,783,672.29
AAA 以下	1,607,693,374.45	2,969,245,276.02
未评级	1,169,921,163.82	3,142,275,991.76
合计	19,197,610,333.03	27,000,304,940.07

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	784,238,230.43	1,138,874,023.70
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	784,238,230.43	1,138,874,023.70

#### 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	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 2022 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(所有者权益)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，期末除本报告“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 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,459,910.65	-	-	-	1,459,910.65
结算备付金	308,053,971.02	-	-	-	308,053,971.02
存出保证金	539,483.00	-	-	-	539,483.00
交易性金融资产	3,358,392,691.59	15,902,732,937.09	1,829,515,346.84	4,023,951,827.52	25,114,592,803.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	129,893,484.78	129,893,484.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	18,453,319.84	18,453,319.84
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,668,446,056.26	15,902,732,937.09	1,829,515,346.84	4,172,298,632.14	25,572,992,972.33
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	4,793,011,203.48	-	-	-	4,793,011,203.48
应付清算款	-	-	-	105,369.61	105,369.61
应付赎回款	-	-	-	154,844,945.06	154,844,945.06
应付管理人报酬	-	-	-	12,021,625.32	12,021,625.32
应付托管费	-	-	-	3,434,750.06	3,434,750.06
应付销售服务费	-	-	-	995,100.74	995,100.74
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,086,407.69	1,086,407.69
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	931,528.88	931,528.88
负债总计	4,793,011,203.48	-	-	173,419,727.36	4,966,430,930.84
利率敏感度缺口	-1,124,565,147.22	15,902,732,937.09	1,829,515,346.84	3,998,878,904.78	20,606,562,041.49
<b>上年度末 2021 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					
银行存款	1,118,596.59	-	-	-	1,118,596.59
结算备付金	170,276,894.08	-	-	-	170,276,894.08
存出保证金	390,219.20	-	-	-	390,219.20
交易性金融资产	4,449,485,613.40	21,762,642,890.74	3,531,750,738.04	4,832,229,708.43	34,576,108,950.61
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	751,920,815.14	751,920,815.14
应收利息	-	-	-	317,136,260.95	317,136,260.95
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	36,327,482.95	36,327,482.95
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,621,271,323.27	21,762,642,890.74	3,531,750,738.04	5,937,614,267.47	35,853,279,219.52
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	7,242,994,810.00	-	-	-	7,242,994,810.00
应付证券清算款	-	-	-	752,035,468.08	752,035,468.08
应付赎回款	-	-	-	28,052,820.28	28,052,820.28
应付管理人报酬	-	-	-	16,405,803.27	16,405,803.27

应付托管费	-	-	-	4,687,372.39	4,687,372.39
应付销售服务费	-	-	-	1,367,669.84	1,367,669.84
应付交易费用	-	-	-	811,496.36	811,496.36
应交税费	-	-	-	1,629,702.76	1,629,702.76
应付利息	-	-	-	117,961.53	117,961.53
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	246,480.34	246,480.34
负债总计	7,242,994,810.00	-	-	805,354,774.85	8,048,349,584.85
利率敏感度缺口	-2,621,723,486.73	21,762,642,890.74	3,531,750,738.04	5,132,259,492.62	27,804,929,634.67

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	71,130,693.18	117,669,121.33
2.市场利率上升25个基点	-70,565,460.42	-116,481,172.87	

#### 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 2022年6月30日	上年度末 2021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	4,023,951,827.52	19.53	4,832,229,708.43	17.38
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	4,023,951,827.52	19.53	4,832,229,708.43	17.38

#### 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	482,017,363.77	694,373,898.08
	2.业绩比较基准下降5%	-482,017,363.77	-694,373,898.08

注：股票投资业绩基准取上证 A 指。

#### 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
	2022年6月30日
第一层次	10,232,007,468.32
第二层次	14,882,585,334.72
第三层次	-

合计	25,114,592,803.04
----	-------------------

#### 6.4.14.2 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

本基金本报告期末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	4,023,951,827.52	15.74
	其中：股票	4,023,951,827.52	15.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,090,640,975.52	82.47
	其中：债券	20,306,402,745.09	79.41
	资产支持证券	784,238,230.43	3.07
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	309,513,881.67	1.21

8	其他各项资产	148,886,287.62	0.58
9	合计	25,572,992,972.33	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	2,889,408,109.51	14.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,474,084.50	0.31
E	建筑业	-	-
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	254,364,039.60	1.23
J	金融业	452,209,730.20	2.19
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	175,316,637.01	0.85
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	188,179,226.70	0.91
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,023,951,827.52	19.53

### 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	601012	隆基绿能	6,755,000	450,085,650.00	2.18
2	000661	长春高新	1,914,452	446,871,385.84	2.17
3	002415	海康威视	11,652,813	421,831,830.60	2.05
4	600486	扬农化工	2,677,959	356,918,375.52	1.73
5	688188	柏楚电子	1,155,990	254,364,039.60	1.23
6	600036	招商银行	5,567,200	234,935,840.00	1.14
7	002304	洋河股份	1,256,010	230,038,231.50	1.12
8	300628	亿联网络	2,775,755	211,373,743.25	1.03
9	000858	五粮液	879,400	177,577,242.00	0.86
10	603806	福斯特	2,695,968	176,639,823.36	0.86
11	603259	药明康德	1,685,899	175,316,637.01	0.85
12	603882	金城医学	2,061,394	170,168,074.70	0.83
13	300059	东方财富	5,760,733	146,322,618.20	0.71
14	300782	卓胜微	942,909	127,292,715.00	0.62
15	300558	贝达药业	1,830,770	111,310,816.00	0.54
16	002250	联化科技	6,348,596	103,926,516.52	0.50
17	000001	平安银行	4,736,400	70,951,272.00	0.34
18	600886	国投电力	6,140,389	64,474,084.50	0.31
19	000860	顺鑫农业	2,393,962	64,206,060.84	0.31
20	002044	美年健康	3,233,600	18,011,152.00	0.09
21	000301	东方盛虹	645,100	10,908,641.00	0.05
22	000333	美的集团	7,072	427,078.08	0.00

#### 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	002304	洋河股份	194,361,092.14	0.70
2	000858	五粮液	174,140,551.91	0.63
3	688188	柏楚电子	144,978,561.94	0.52
4	600036	招商银行	136,456,346.16	0.49
5	300059	东方财富	126,809,219.48	0.46
6	000001	平安银行	80,455,994.19	0.29
7	600426	华鲁恒升	75,696,687.86	0.27
8	600886	国投电力	71,076,764.75	0.26
9	603882	金城医学	27,604,009.40	0.10
10	000301	东方盛虹	12,250,879.00	0.04
11	000333	美的集团	542,141.52	0.00
12	600938	中国海油	43,200.00	0.00
13	835179	凯德石英	26,000.00	0.00

14	001308	康冠科技	24,420.00	0.00
15	873223	荣亿精密	14,124.00	0.00
16	871857	泓禧科技	12,000.00	0.00
17	833346	威贸电子	11,700.00	0.00
18	870204	沪江材料	9,340.00	0.00
19	831278	泰德股份	7,714.00	0.00
20	831689	克莱特	7,560.00	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	601012	隆基绿能	294,892,390.58	1.06
2	000596	古井贡酒	266,708,729.77	0.96
3	600426	华鲁恒升	210,967,988.45	0.76
4	600809	山西汾酒	92,936,361.04	0.33
5	603259	药明康德	92,189,676.63	0.33
6	000661	长春高新	51,524,387.00	0.19
7	600161	天坛生物	50,992,493.65	0.18
8	603806	福斯特	41,429,796.40	0.15
9	300132	青松股份	30,834,225.52	0.11
10	600886	国投电力	8,680,611.00	0.03
11	600938	中国海油	54,218.00	0.00
12	001308	康冠科技	30,606.89	0.00
13	835179	凯德石英	27,703.00	0.00
14	873223	荣亿精密	22,709.97	0.00
15	833346	威贸电子	16,640.00	0.00
16	870204	沪江材料	14,508.00	0.00
17	871857	泓禧科技	12,330.00	0.00
18	688223	晶科能源	10,398.00	0.00
19	831278	泰德股份	7,742.73	0.00
20	831689	克莱特	7,177.25	0.00

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	1,044,537,626.35
卖出股票收入（成交）总额	1,141,374,072.88

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,769,655,277.82	18.29
	其中：政策性金融债	1,088,297,071.23	5.28
4	企业债券	2,998,737,738.58	14.55
5	企业短期融资券	20,495,340.83	0.10
6	中期票据	6,321,763,061.88	30.68
7	可转债（可交换债）	7,195,751,325.98	34.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,306,402,745.09	98.54

## 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	132018	G 三峡 EB1	6,120,390	856,615,653.24	4.16
2	113011	光大转债	7,987,990	849,400,181.00	4.12
3	110059	浦发转债	7,733,390	819,729,805.66	3.98
4	110053	苏银转债	6,131,330	772,421,761.74	3.75
5	220401	22 农发 01	6,600,000	663,427,660.27	3.22

## 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	193797	21 工鑫 8A	700,000	72,123,803.84	0.35
2	189847	21LJZ 优	500,000	50,737,671.24	0.25
3	136594	荟柒 4A	500,000	50,287,616.44	0.24
4	193676	至博 03A1	400,000	41,064,000.00	0.20
5	193256	明远 03A3	300,000	30,596,827.40	0.15
6	136877	东华 011A	300,000	30,507,835.07	0.15
7	183244	G 电租 1A	300,000	25,845,762.20	0.13
8	137991	济建 1 优	200,000	20,737,685.48	0.10
9	193677	至博 03A2	200,000	20,503,178.08	0.10
10	193545	至通 01A1	200,000	20,479,254.79	0.10
11	193552	至博 02A1	200,000	20,421,254.79	0.10
12	183105	21 电 4A2	200,000	20,410,230.14	0.10
13	136852	国链 33A1	200,000	20,291,364.38	0.10
14	136882	链融 53A1	200,000	20,281,342.47	0.10
15	189668	纓云 01 优	200,000	20,089,643.84	0.10
16	183916	22 保置优	200,000	20,057,604.38	0.10
17	136815	光汇 01 优	200,000	20,013,109.04	0.10
18	179213	PR 华 01 优	400,000	14,961,435.78	0.07
19	168880	益行 04A1	100,000	10,393,928.22	0.05
20	169031	益行 06A1	100,000	10,388,778.08	0.05
21	168977	建借 1A	100,000	10,287,780.82	0.05
22	193553	至博 02A2	100,000	10,256,676.71	0.05
23	193546	至通 01A2	100,000	10,255,676.71	0.05
24	193538	至博 01A1	100,000	10,253,402.74	0.05
25	189773	2 天智 02A	100,000	10,252,566.03	0.05
26	136702	至泰 3A2	100,000	10,229,320.55	0.05
27	183148	G 国电优	100,000	10,203,814.25	0.05
28	193933	和皖 A	100,000	10,193,490.41	0.05
29	136820	瑞新 33A1	100,000	10,156,030.14	0.05
30	183194	铁建 032A	100,000	10,113,420.27	0.05
31	136685	荟享 083A	100,000	10,095,145.21	0.05
32	135065	曦月 1A	100,000	10,094,042.74	0.05
33	136339	荟享 067A	100,000	10,089,084.93	0.05
34	193601	百新 01 优	100,000	10,084,876.71	0.05
35	183208	铁建 033A	100,000	10,073,421.92	0.05
36	136444	荟享 055A	100,000	10,068,043.84	0.05
37	136045	荟享 057A	100,000	10,063,769.86	0.05
38	136077	荟享 061A	100,000	10,062,938.08	0.05
39	136781	荟享 085A	100,000	10,060,800.00	0.05
40	136142	荟享 065A	100,000	10,055,452.60	0.05
41	136418	特建发优	100,000	10,054,127.99	0.05
42	136550	荟柒 7A	100,000	10,053,864.11	0.05

43	183480	PR 铁置优	100,000	10,048,172.12	0.05
44	189980	华能 22 优	100,000	10,011,778.08	0.05
45	165814	PR 安吉 5A	300,000	928,207.95	0.00

## 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,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外汇管理局北京外汇管理部、中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会北京监管局的处罚。上海浦东发展银行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、中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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	539,483.00
2	应收清算款	129,893,484.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,453,319.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,886,287.62

## 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	132018	G 三峡 EB1	856,615,653.24	4.16
2	113011	光大转债	849,400,181.00	4.12
3	110059	浦发转债	819,729,805.66	3.98
4	110053	苏银转债	772,421,761.74	3.75
5	113050	南银转债	289,937,935.11	1.41
6	113021	中信转债	273,166,432.11	1.33
7	110073	国投转债	246,378,891.50	1.20
8	113052	兴业转债	244,741,567.89	1.19
9	113044	大秦转债	216,108,405.09	1.05
10	113043	财通转债	175,499,419.45	0.85
11	110079	杭银转债	166,625,606.58	0.81
12	127049	希望转 2	159,079,664.63	0.77
13	110063	鹰 19 转债	117,639,101.37	0.57
14	123107	温氏转债	110,434,755.20	0.54
15	127040	国泰转债	98,108,820.65	0.48
16	110061	川投转债	81,631,219.27	0.40
17	113013	国君转债	78,221,296.03	0.38
18	127027	靖远转债	76,531,038.88	0.37
19	132009	17 中油 EB	73,971,589.04	0.36
20	128129	青农转债	68,409,185.21	0.33

21	127005	长证转债	62,271,629.30	0.30
22	110083	苏租转债	54,864,261.37	0.27
23	127022	恒逸转债	43,919,971.19	0.21
24	127032	苏行转债	42,137,471.61	0.20
25	113048	晶科转债	38,075,425.96	0.18
26	123004	铁汉转债	34,424,432.58	0.17
27	113025	明泰转债	34,190,140.30	0.17
28	128128	齐翔转 2	28,589,081.21	0.14
29	132020	19 蓝星 EB	26,290,032.35	0.13
30	123085	万顺转 2	25,955,574.79	0.13
31	127039	北港转债	19,155,581.92	0.09
32	113623	凤 21 转债	16,480,970.39	0.08
33	128081	海亮转债	15,734,925.16	0.08
34	127018	本钢转债	15,271,824.76	0.07
35	113033	利群转债	14,598,983.20	0.07
36	110080	东湖转债	14,550,613.56	0.07
37	127042	嘉美转债	14,165,196.83	0.07
38	127047	帝欧转债	13,447,409.59	0.07
39	127029	中钢转债	11,537,569.63	0.06
40	127025	冀东转债	11,300,550.25	0.05
41	110077	洪城转债	10,637,065.14	0.05
42	113046	金田转债	10,073,472.32	0.05
43	127033	中装转 2	9,427,503.88	0.05
44	110045	海澜转债	8,346,656.40	0.04
45	128119	龙大转债	7,853,388.00	0.04
46	110064	建工转债	7,551,927.95	0.04
47	128109	楚江转债	7,363,650.16	0.04
48	113615	金诚转债	7,201,808.66	0.03
49	110052	贵广转债	6,837,762.15	0.03
50	113047	旗滨转债	6,077,006.33	0.03
51	128130	景兴转债	6,033,417.09	0.03
52	113622	杭叉转债	5,214,766.80	0.03
53	128121	宏川转债	4,038,758.37	0.02
54	128144	利民转债	3,687,818.23	0.02
55	118003	华兴转债	3,582,285.48	0.02
56	113042	上银转债	3,438,063.41	0.02
57	128141	旺能转债	3,368,604.54	0.02
58	123119	康泰转 2	3,310,444.44	0.02
59	113545	金能转债	3,252,564.41	0.02
60	128048	张行转债	3,171,090.56	0.02
61	113049	长汽转债	3,057,490.04	0.01
62	113628	晨丰转债	3,028,634.57	0.01
63	123086	海兰转债	3,013,309.99	0.01
64	123035	利德转债	3,002,739.44	0.01

65	128108	蓝帆转债	2,827,389.24	0.01
66	113588	润达转债	2,535,529.26	0.01
67	128078	太极转债	2,481,407.24	0.01
68	113037	紫银转债	2,346,673.34	0.01
69	127035	濮耐转债	2,327,307.47	0.01
70	127026	超声转债	2,309,366.22	0.01
71	128037	岩土转债	2,230,805.17	0.01
72	128134	鸿路转债	2,208,414.12	0.01
73	113631	皖天转债	2,171,567.26	0.01
74	128095	恩捷转债	2,121,831.56	0.01
75	128137	洁美转债	2,013,920.69	0.01
76	128090	汽模转 2	1,986,135.30	0.01
77	113519	长久转债	1,895,943.63	0.01
78	123121	帝尔转债	1,892,028.23	0.01
79	123115	捷捷转债	1,840,983.72	0.01
80	123050	聚飞转债	1,826,548.54	0.01
81	128044	岭南转债	1,779,914.51	0.01
82	113621	彤程转债	1,540,767.31	0.01
83	127045	牧原转债	1,398,358.22	0.01
84	113039	嘉泽转债	1,047,531.16	0.01
85	128023	亚太转债	662,664.01	0.00
86	113599	嘉友转债	407,984.98	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
易方达安心回报债券 A	233,830	38,543.37	4,659,009,869.42	51.69%	4,353,586,205.82	48.31%
易方达安心回报债券 B	42,045	37,118.42	572,908,399.45	36.71%	987,735,516.01	63.29%



合计	275,875	38,326.20	5,231,918,268. 87	49.48%	5,341,321,721. 83	50.52%
----	---------	-----------	----------------------	--------	----------------------	--------

## 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	易方达安心回报债券 A	2,631,625.05	0.0292%
	易方达安心回报债券 B	105,699.49	0.0068%
	合计	2,737,324.54	0.0259%

## 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的情况

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	易方达安心回报债券 A	10~50
	易方达安心回报债券 B	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达安心回报债券 A	0
	易方达安心回报债券 B	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
基金合同生效日（2011 年 6 月 21 日）基金份额总额	476,546,478.86	1,313,683,053.68
本报告期期初基金份额总额	11,945,143,015.60	2,015,583,971.56
本报告期基金总申购份额	600,346,025.18	130,032,418.58
减：本报告期基金总赎回份额	3,532,892,965.54	584,972,474.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	9,012,596,075.24	1,560,643,915.46

## §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

本基金管理人于 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

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

本报告期，基金管理人和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	
长江证券	1	562,896,929.47	26.44%	450,317.54	29.72%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	118,526.95	0.01%	71.12	0.00%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	39,724,810.65	1.87%	31,780.07	2.10%	-
华泰证券	2	379,257,944.78	17.81%	227,554.54	15.02%	-
申万宏源	1	432,406,554.63	20.31%	259,443.97	17.12%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	587,647,608.95	27.60%	470,119.67	31.02%	-
中信建投	1	126,849,651.34	5.96%	76,110.38	5.02%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增交易单元的证券公司为西南证券股份有限公司。

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。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、个股分析的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
长江证券	1,030,463,781.13	12.85%	56,891,300,000.00	19.53%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	872,819,943.35	10.88%	13,255,068,000.00	4.55%	-	-
华泰证券	2,146,957,503.74	26.76%	65,335,640,000.00	22.43%	-	-
申万宏源	3,249,396,816.10	40.51%	139,991,700,000.00	48.05%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	207,139,288.33	2.58%	10,783,779,000.00	3.70%	-	-
中信建投	407,978,925.91	5.09%	3,774,000,000.00	1.30%	-	-
中信证券	107,271,541.72	1.34%	1,287,000,000.00	0.44%	-	-

### 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关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-05
3	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
4	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-19
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-01-21
6	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-27
7	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-02-10
8	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-02-24
9	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂	中国证券报、基金管理人	2022-03-10

	停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
10	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-24
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证券报	2022-03-30
12	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-07
13	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
14	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
15	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-04-22
17	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-05
18	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
19	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-14
20	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-19
21	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-02
22	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-16
23	关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-30

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达安心回报债券型证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达安心回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达安心回报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

二〇二二年八月三十日