

易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 易方达磐泰一年持有混合 |
| 基金主代码 | 009249 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 8 月 14 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,434,594,752.33 份 |
| 投资目标 | 本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | 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，确定资产的最优配置比例。 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、本基金将在行业分析、公司基本面分析及估值水平分析的基础上，进行股票组合的构建。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、交易活跃的股指期货、国债期货、股票期权合约进行交易,以对冲投资组合的风险。 | |
| 业绩比较基准 | 中债新综合指数（财富）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达磐泰一年持有混合 A | 易方达磐泰一年持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009249 | 009250 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,262,039,319.82 份 | 2,172,555,432.51 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| | |
|--------|---|
| 主要财务指标 | 报告期 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日) |
|--------|---|

| | 易方达磐泰一年持有 混合 A | 易方达磐泰一年持有 混合 C |
|----------------|-------------------|-------------------|
| 1.本期已实现收益 | 7,022,380.42 | 53,292.42 |
| 2.本期利润 | 25,985,474.06 | 9,163,704.04 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0055 | 0.0044 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,613,914,378.16 | 2,376,407,492.16 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1079 | 1.0938 |

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达磐泰一年持有混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.56% | 0.12% | -0.30% | 0.10% | 0.86% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.74% | 0.11% | 1.30% | 0.12% | 0.44% | -0.01% |
| 过去一年 | 2.19% | 0.10% | 1.74% | 0.12% | 0.45% | -0.02% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 10.79% | 0.15% | 6.86% | 0.13% | 3.93% | 0.02% |

易方达磐泰一年持有混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.40% | 0.12% | -0.30% | 0.10% | 0.70% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.44% | 0.11% | 1.30% | 0.12% | 0.14% | -0.01% |
| 过去一年 | 1.57% | 0.10% | 1.74% | 0.12% | -0.17% | -0.02% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 9.38% | 0.15% | 6.86% | 0.13% | 2.52% | 0.02% |

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

易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2020 年 8 月 14 日至 2022 年 9 月 30 日)

易方达磐泰一年持有混合 A



易方达磐泰一年持有混合 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 10.79%，同期业绩比较基准收益率为 6.86%；C 类基金份额净值增长率为 9.38%，同期业绩比较基准收益率为 6.86%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张雅君 | 本基金的基金经理，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，易方达安心回报 | 2020-08-14 | - | 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 |

| | | | | | |
|----|--|------------|---|------|--|
| | 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 | | | | 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。 |
| 林虎 | 本基金的基金经理，易方达安心回馈混合、易方达裕祥回报债券的基金经理，易方达稳泰一年持有混合（自 2021 年 05 月 22 日至 2022 年 07 月 06 日）的基金经理助理 | 2021-12-01 | - | 10 年 | 博士研究生，具有基金从业资格。曾任宏源证券研究所固定收益分析师，国信证券研究所宏观分析师。 |

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，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 8 次，其中 4 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，4 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度国内经济的修复比我们预想的更为疲弱。尽管财政支持和稳增长政策较为积极，但是疫情频发、地产销售增速持续低位以及出口下滑都加剧了对于未来经济增长的担忧。同时另外一个较大的不确定性来自于海外市场的剧烈波动。欧洲在能源危机以及货币紧缩的双重压力下，经济开始进入衰退。8 月中旬以来在美联储较为鹰派的反通胀表态以后，海外货币政策紧缩预期大幅升温，美国实际利率持续上行，这造成了全球金融市场的动荡和新兴市场货币的压力，目前来看这一过程仍然没有结束。在这一背景下，国内资本市场也受到一定影响，人民币汇率出现一定程度的贬值，国内风险偏好有所下降，但是和其他国家相比，国内资本市场受到的影响较为有限，仍然维持了较好的独立性。我们认为未来一段时间内海外通胀和货币紧缩的演进将是国内资本市场非常重要的不确定性来源，我们对此将保持密切的跟踪。

在国内经济担忧和海外风险的双重影响下，国内权益市场三季度表现弱势。如果拆分来看，在 8 月下旬之前，权益市场更多受到国内经济疲弱的影响，表现为和国内经济相关性更高的行业和指数下跌更多。8 月下旬以后则更多受到海外市场波动的影响，风险偏好影响较大的成长类行业跟随下跌。同样受到经济增长担忧的驱动和流动性宽裕的支持，三季度开始债券市场利率出现下行，8 月中旬央行降息后利率快速下行，从我们之前的研究来看，海外加息背景下国内较少会动用价格类的货币政策，这次降息超出我们的预期，也没有及时调整久期来应对。随后在国内经济疲弱已充分定价、资金面边际趋紧以及海外市场利率大幅上行的牵引下，债券市场利率出现回升，9 月底国债利率已经基本回到降息之前的水平，我们在谨慎评估了基本面的情况后，小幅提高久期水平接近中性。

报告期内本基金规模出现下降，由于风险预算相比二季度明显提高，在下跌的市场中组合小幅提高权益的风险暴露，同时为了应对当前复杂的宏观情景和不确定性，我们进一步优化了行业配置，一方面更加看重个股选择的边际安全性，另一方面也增

加了一些应对通胀和不确定性的配置来对组合进行保护。债券小幅提高了久期，仍然以高等级信用债为主要持仓，在债券久期的调整中我们一方面会跟随对于基本面和当前估值的判断，另外一方面也会注意债券和权益持仓的互补协同，发挥多资产的优势，平滑组合波动水平。

本基金以提高持有人体验为目标，注重波动和回撤控制，坚持分散和平衡，不断拓展组合的超额收益来源，改善组合的风险收益特征，努力以长期优异的业绩回报基金持有人。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.1079 元，本报告期份额净值增长率为 0.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.30%；C 类基金份额净值为 1.0938 元，本报告期份额净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准收益率为-0.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|---------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 659,941,055.82 | 8.47 |
| | 其中：股票 | 659,941,055.82 | 8.47 |
| 2 | 固定收益投资 | 6,766,721,925.87 | 86.85 |
| | 其中：债券 | 6,546,742,999.22 | 84.02 |
| | 资产支持证券 | 219,978,926.65 | 2.82 |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售 | - | - |

| | | | |
|---|--------------|------------------|--------|
| | 金融资产 | | |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 110,664,057.80 | 1.42 |
| 7 | 其他资产 | 254,302,185.59 | 3.26 |
| 8 | 合计 | 7,791,629,225.08 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 34,789,212.00 | 0.58 |
| B | 采矿业 | 183,713,806.79 | 3.07 |
| C | 制造业 | 95,510,799.55 | 1.59 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 37,671,300.00 | 0.63 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 151,365,621.96 | 2.53 |
| H | 住宿和餐饮业 | 13,271,030.00 | 0.22 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 192,610.55 | 0.00 |
| J | 金融业 | 59,368,188.72 | 0.99 |
| K | 房地产业 | 83,730,289.35 | 1.40 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 265,796.80 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 31,085.60 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 31,314.50 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 659,941,055.82 | 11.02 |

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产 净值比例 （%） |
|----|--------|------|------------|----------------|----------------------|
| 1 | 601816 | 京沪高铁 | 25,959,725 | 117,337,957.00 | 1.96 |
| 2 | 001979 | 招商蛇口 | 2,836,441 | 46,347,445.94 | 0.77 |
| 3 | 601001 | 晋控煤业 | 2,249,342 | 39,296,004.74 | 0.66 |
| 4 | 600188 | 兖矿能源 | 781,400 | 39,202,838.00 | 0.65 |
| 5 | 000975 | 银泰黄金 | 2,978,780 | 38,307,110.80 | 0.64 |
| 6 | 002714 | 牧原股份 | 638,100 | 34,789,212.00 | 0.58 |
| 7 | 601225 | 陕西煤业 | 1,450,101 | 33,018,799.77 | 0.55 |
| 8 | 600988 | 赤峰黄金 | 1,607,185 | 32,593,711.80 | 0.54 |
| 9 | 600048 | 保利发展 | 1,586,731 | 28,561,158.00 | 0.48 |
| 10 | 601628 | 中国人寿 | 902,800 | 28,555,564.00 | 0.48 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产 净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|------------------|
| 1 | 国家债券 | 49,936,779.89 | 0.83 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,634,001,074.00 | 43.97 |
| | 其中：政策性金融债 | 317,691,931.51 | 5.30 |
| 4 | 企业债券 | 1,505,872,484.92 | 25.14 |
| 5 | 企业短期融资券 | 50,594,413.70 | 0.84 |
| 6 | 中期票据 | 2,219,632,035.59 | 37.05 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 86,706,211.12 | 1.45 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 6,546,742,999.22 | 109.29 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金 资产净 |
|----|------|------|-------|---------|------------|
|----|------|------|-------|---------|------------|

| | | | | | 值比例 (%) |
|---|-----------|--------------------|-----------|----------------|------------|
| 1 | 2128047 | 21 招商银行永续 债 | 1,800,000 | 189,342,226.85 | 3.16 |
| 2 | 2228043 | 22 中国银行小微 债 01 | 1,800,000 | 182,546,630.14 | 3.05 |
| 3 | 220206 | 22 国开 06 | 1,750,000 | 176,096,890.41 | 2.94 |
| 4 | 092200008 | 22 农行二级资本 债 02A | 1,700,000 | 169,512,318.90 | 2.83 |
| 5 | 220301 | 22 进出 01 | 1,400,000 | 141,595,041.10 | 2.36 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净 值比例 (%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|-------------------|
| 1 | 193676 | 至博 03A1 | 300,000 | 31,078,800.00 | 0.52 |
| 2 | 193538 | 至博 01A1 | 200,000 | 20,687,923.29 | 0.35 |
| 3 | 183105 | 21 电 4A2 | 200,000 | 20,599,331.51 | 0.34 |
| 4 | 156659 | PR 产 1A | 200,000 | 20,312,704.09 | 0.34 |
| 5 | 136815 | 光汇 01 优 | 200,000 | 20,147,109.04 | 0.34 |
| 6 | 183148 | G 国电优 | 100,000 | 10,365,237.26 | 0.17 |
| 7 | 193933 | 和皖 A | 100,000 | 10,337,131.51 | 0.17 |
| 8 | 183243 | 21 国电投 | 100,000 | 10,327,986.30 | 0.17 |
| 9 | 136937 | 东华 012A | 100,000 | 10,176,088.77 | 0.17 |
| 10 | 183194 | 铁建 032A | 100,000 | 10,140,263.56 | 0.17 |

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，主要选择流动性好的国债期货合约进行交易，调节组合的久期水平及期限结构。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量 | 合约市值 | 公允价值变动 | 风险指标说明 |
|----|----|-----|------|--------|--------|
|----|----|-----|------|--------|--------|

| | | | | | |
|-------------------|---|-------|-----|-----|---------------|
| | | (买/卖) | (元) | (元) | |
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | - |
| 国债期货投资本期收益(元) | | | | | -3,783,160.00 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -191,500.00 |

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金根据风险管理原则，选择流动性好的国债期货合约进行交易，调节组合的久期水平和期限结构。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司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、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。国家开发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。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国进出口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。兴业银行股份有限公司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。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市场监督管理总局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。招商证券股份有限公司在本报告期内被中国证券监督管理委员会立案调查，在报告编制日前一年内曾受到中国证券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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 636,669.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | 252,022,091.70 |

| | | |
|---|-------|----------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,643,423.95 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 254,302,185.59 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1 | 110079 | 杭银转债 | 19,632,980.25 | 0.33 |
| 2 | 110085 | 通 22 转债 | 16,639,269.60 | 0.28 |
| 3 | 110053 | 苏银转债 | 15,311,014.39 | 0.26 |
| 4 | 113057 | 中银转债 | 12,458,690.80 | 0.21 |
| 5 | 132018 | G 三峡 EB1 | 8,370,528.36 | 0.14 |
| 6 | 127049 | 希望转 2 | 4,073,269.61 | 0.07 |
| 7 | 113037 | 紫银转债 | 2,597,939.38 | 0.04 |
| 8 | 113042 | 上银转债 | 2,035,883.65 | 0.03 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 易方达磐泰一年持有混合A | 易方达磐泰一年持有混合C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 6,002,340,037.61 | 1,962,528,154.28 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 51,196,892.04 | 234,030,399.67 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,791,497,609.83 | 24,003,121.44 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,262,039,319.82 | 2,172,555,432.51 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年十月二十六日