

易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	41
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	41
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	42
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	42

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12	投资组合报告附注	42
§ 8	基金份额持有人信息	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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	44
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	44
§ 9	开放式基金份额变动	44
§ 10	重大事件揭示	45
10.1	基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8	其他重大事件	47
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	47
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	47
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12	备查文件目录	49
12.1	备查文件目录	49
12.2	存放地点	49
12.3	查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	易方达恒兴 3 个月定开债券发起式
基金主代码	007451
交易代码	007451
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 15 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,900,907,770.90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，管理人主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在封闭运作期与开放运作期采取不同的投资策略。封闭运作期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。在对资金面进行综合分析的基础上，本基金将比较债券收益率、存款利率和融资成本，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。开放运作期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债新综合指数（全价）收益率
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。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	龚小武
	联系电话	020-85102688	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95561

传真	020-38798812	021-62159217
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	福建省福州市台江区江滨中大 道398号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路167号4 楼
邮政编码	510620； 519031	200120
法定代表人	刘晓艳	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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）
本期已实现收益	134,775,941.23
本期利润	209,624,554.48
加权平均基金份额本期利润	0.0276
本期加权平均净值利润率	2.70%
本期基金份额净值增长率	2.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	117,112,779.08
期末可供分配基金份额利润	0.0132
期末基金资产净值	9,145,675,663.61
期末基金份额净值	1.0275

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	16.89%

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。

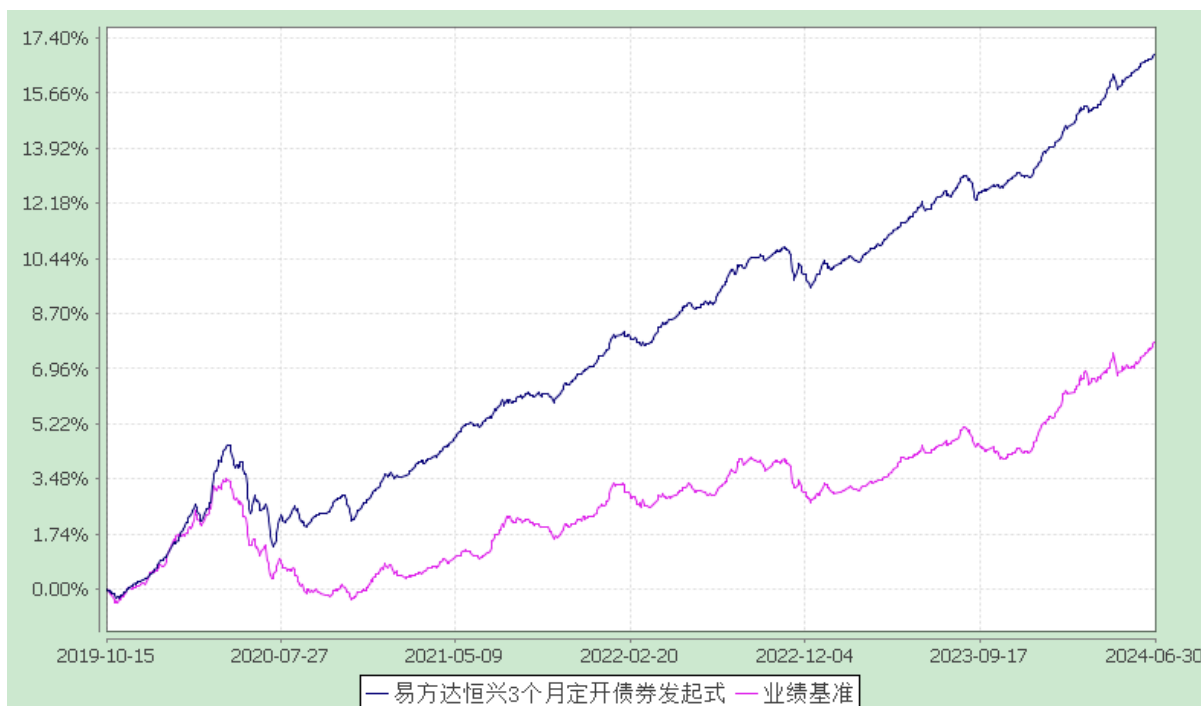
3.2 基金净值表现

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

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	0.42%	0.01%	0.65%	0.03%	-0.23%	-0.02%
过去三个月	1.38%	0.04%	1.06%	0.07%	0.32%	-0.03%
过去六个月	2.72%	0.04%	2.42%	0.07%	0.30%	-0.03%
过去一年	4.24%	0.04%	3.27%	0.06%	0.97%	-0.02%
过去三年	10.92%	0.05%	6.58%	0.05%	4.34%	0.00%
自基金合同生效起至今	16.89%	0.06%	7.80%	0.06%	9.09%	0.00%

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

易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金
 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
 （2019 年 10 月 15 日至 2024 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 16.89%，同期业绩比较基准收益率为 7.80%。

§ 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		
王晓晨	本基金的基金经理，易方达增强回报债券、易方达投资级信用债债券、易方达双债增强债券、易方达安瑞短债债券（自 2018 年 11 月 14 日至 2024 年 06 月 19 日）、易方达裕祥	2019-10-15	-	21 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集中交易室债券交易员、债券交易主管、固定收益总部总经理助理、固定收益基金投资部副总经理、固定收益投资部

	回报债券、易方达安泽 180 天持有债券的基金经理，固定收益全策略投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员				副总经理，易方达货币、易方达保证金货币、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达保本一号混合、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达纯债债券、易方达恒益定开债券发起式、易方达新鑫混合、易方达恒安定开债券发起式、易方达富财纯债债券、易方达中债 1-3 年国开行债券指数、易方达中债 3-5 年国开行债券指数、易方达中债 1-3 年政金债指数、易方达中债 3-5 年政金债指数的基金经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）。
李一硕	本基金的基金经理助理，易方达永旭定期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕如混合、易方达安源中短债债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒春纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒实纯债一年定开债券发起式、易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达富惠纯债债券、易方达恒安定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式的基金经理，易方达裕惠定开混合发起式、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达稳丰 90 天滚动短债（自 2021 年 08 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日）的基金经理助理，固定收益特定策略投资部总经理	2019-10-30	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任瑞银证券有限公司研究员，中国国际金融有限公司研究员，易方达基金管理有限公司固定收益研究员、固定收益投资部总经理助理、固定收益特定策略投资部负责人，易方达瑞景混合、易方达富惠纯债债券、易方达新利混合、易方达新享混合、易方达恒信定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式、易方达聚盈分级债券发起式、易方达恒益定开债券发起式的基金经理。
刘琬姝	本基金的基金经理助理，易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债、易方达恒利 3 个月定开债券发起式的基金经理，易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒秋纯债一年定开债券	2020-12-22	-	12 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投资经理助理。

	发起式、易方达年年恒春纯债一年定开债券发起式、易方达安源中短债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达年年恒实纯债一年定开债券发起式、易方达稳丰 90 天滚动短债（自 2021 年 08 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日）、易方达富惠纯债债券、易方达恒固 18 个月封闭式债券、易方达恒惠定开债券发起式、易方达兴利 180 天持有债券的基金经理助理，固定收益研究员				
杨真	本基金的基金经理助理，易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达中债 1-3 年国开行债券指数、易方达中债 3-5 年国开行债券指数、易方达中债 1-3 年政金债指数、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达富财纯债债券、易方达裕华利率债 3 个月定开债券、易方达裕兴 3 个月定开债券、易方达裕浙 3 个月定开债券、易方达优选投资级信用指数发起式、易方达中债 0-3 年政金债指数、易方达中债 1-5 年政金债指数的基金经理	2021-08-07	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中信建投证券股份有限公司资产管理部交易员，易方达基金管理有限公司固定收益交易部交易员，易方达中债 3-5 年政金债指数的基金经理。

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/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.根据 2024 年 8 月 15 日《易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告》，自 2024 年 8 月 15 日起，王晓晨不再担任本基金的基金经理，聘任李一硕担任本基金的基金经理。

5.自 2024 年 8 月 15 日起，李一硕不再担任本基金的基金经理助理。

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

今年上半年实际 GDP（国内生产总值，下同）累计同比增长 5%，运行总体平稳。一季度开年经济起步良好，实际 GDP 同比增长 5.3%，较去年四季度回升，其中生产端稳中有升，规模以上工业增加值增速比去年同期提升 3.1 个百分点，较去年四季度提升 0.1 个百分点；进出口增长 5%，创 6 个季度以来新高，尤其出口数据延续了 2023 年 11 月份以来的回升，全球制造业周期回升拉动中国出口特别是电子产品出口。二季度实际 GDP 同比增长 4.7%，较一季度增速回落，有极端天气、雨涝灾害多发等短期因素的影响，但从产销率和通胀指标来看，国内的供求关系仍待改善，反映出当前经济运行中的困难挑战有所增多，特别是国内有效需求不足的问题比较突出，国内大循环不够顺畅等。整体上看，上半年宏观经济恢复曲折式前进。

政策方面，3 月全国两会提出今年国内 GDP 增长目标为 5% 左右，强调实现质的有效提升和量的合理增长。财政政策适当加力、注重提效，赤字率小幅上调至 3%，地方政府专项债规模扩大至

3.8 万亿元；货币政策强调稳健、灵活适度、精准有效，提出加强总量和结构双重调节，畅通货币政策传导机制，提高资金使用效率，保持人民币汇率在合理均衡水平上的基本稳定，坚决防范汇率超调风险，同时在经济回升过程中，也要关注长期收益率的变化。上半年，金融机构存款准备金率累计下调 0.5 个百分点，5 年期以上 LPR（贷款市场报价利率）下调 0.25 个百分点，整体平稳宽松。

在前述经济和政策组合下，债券市场上半年收益率整体下行。资金方面，R007（银行间 7 天质押式回购利率）月度中枢一二季度较去年四季度接连下行，银行间流动性较为充裕。现券方面，上半年大部分债券品种收益率下行 30-60bp 左右，信用级别偏低、期限偏长的品种下行幅度更大。下行节奏上看，1-2 月债券收益率基本呈现单边下行状态，3 月之后表现为 10BP 以内的窄幅震荡，4 月收益率呈现“V”字型波动，5 月中下旬之后收益率再次呈现低波动的下行态势。6 月末 10 年国开收益率收于 2.29%，较去年底下行 39bp，10 年国债收益率收于 2.21%，较去年底下行 35bp；上半年受供求关系影响，信用利差整体波动下行，截至 6 月末，3 年 AAA 中短票收益率较去年底下行 58BP，3 年 AA 中短票收益率较去年底下行 81bp，5 年期 AA 中短票收益率较去年底下行 111bp。

操作上，组合以高等级信用债为主要配置资产，通过期限结构策略、品种类属策略及杠杆策略等多种方式力求获取超额收益。上半年组合久期边际有所提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0275 元，本报告期份额净值增长率为 2.72%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年 7 月 15 日至 18 日二十届三中全会在北京举行，全会审议通过《中共中央关于进一步全面深化改革、推进中国式现代化的决定》，对进一步全面深化改革做出系统部署，同时，全会分析了当前形势和任务，强调坚定不移实现全年经济社会发展目标，要落实好宏观政策，积极扩大国内需求，因地制宜发展新质生产力，加快培育外贸新动能，扎实推进绿色低碳发展。全会指出，要统筹好发展和安全，落实好防范化解房地产、地方政府债务、中小金融机构等重点领域风险的各项举措。展望未来，我们认为下半年外部环境不稳定性、不确定性上升，国内困难挑战依然不少，经济回升的动力需要进一步增强。

内需方面，国内有效需求不足的问题比较突出，国内大循环不够顺畅，有关部门已采取一系列措施加以解决。近期发改委、财政部宣布，安排 3000 亿元左右超长期特别国债资金，加力支持大规模设备更新和消费品以旧换新，同时提高设备更新贷款财政贴息比例。货币政策方面，央行 7 月下旬宣布公开市场 7 天期逆回购操作调整为固定利率、数量招标，且操作利率由此前的 1.80% 调整为

1.70%，为 2023 年 8 月以来首次调整，1 年期和 5 年期以上 LPR（贷款市场报价利率）、1 年期 MLF（中期借贷便利）利率也跟随下降。综合来看，下半年宏观政策或仍重视更好统筹稳增长和增后劲，促进经济持续健康发展。

另一方面，下半年经济供给强于需求的特点可能还将延续，经济修复进程仍面临一定的挑战，主要有如下原因：一，银行信用扩张乏力拖累基建投资，实物工作量仍偏弱；二，《中共中央关于进一步全面深化改革、推进中国式现代化的决定》提出加快建立租购并举的住房制度，加快构建房地产发展新模式，充分赋予各城市政府房地产市场调控自主权，因城施策，各省市地产政策继续围绕降低首付比例、提高公积金额度、以旧换新、收储等需求放松展开，房地产市场仍在磨底；三，产销率和价格水平回升偏慢指向当前国内的供求关系仍未得到实质性改善。

我国经济正处于转型升级的过程中，朝着实现质的有效提升和量的合理增长的目标迈进。尽管当前经济运行面临新的困难挑战，但经济恢复是一个波浪式发展、曲折式前进的过程，我国发展面临的有利条件强于不利因素，稳中向好、长期向好的发展态势不会改变。

综上，下半年债券市场总体风险可控，但需关注利率低位下波动加大的可能性，并结合组合风险收益特征做好预案和应对。组合将继续积极运用票息、杠杆、骑乘、期限结构、债券类属等策略，在整体中性配置的思路下结合市场情况调整组合久期，争取为投资者提供平稳持续的投资收益。

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

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 110,971,089.74 元。

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

自 2024 年 2 月 22 日至 2024 年 4 月 16 日，本基金均存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,884,958.23	1,321,210.38
结算备付金		88,493,353.51	108,338,344.77
存出保证金		79,721.89	386,689.65
交易性金融资产	6.4.7.2	12,354,767,481.39	9,231,226,906.02
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		11,739,356,143.74	8,497,737,385.27
资产支持证券投资		615,411,337.65	733,489,520.75
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		3,121,523.35	1,824,712.90
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		12,449,347,038.37	9,343,097,863.72
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
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		3,299,904,560.41	2,291,489,157.61
应付清算款		-	1,253,815.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,244,377.75	1,787,359.46
应付托管费		748,125.92	595,786.47
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		559,660.97	469,121.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	214,649.71	479,433.43
负债合计		3,303,671,374.76	2,296,074,674.12
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	8,900,907,770.90	6,935,693,061.96
未分配利润	6.4.7.8	244,767,892.71	111,330,127.64
净资产合计		9,145,675,663.61	7,047,023,189.60
负债和净资产总计		12,449,347,038.37	9,343,097,863.72

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值1.0275元，基金份额总额8,900,907,770.90份。

6.2 利润表

会计主体：易方达恒兴3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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
一、营业总收入		248,631,840.40	108,461,611.70
1.利息收入		994,596.15	365,741.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	758,566.94	283,817.51
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		236,029.21	81,924.08
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		172,788,631.00	76,638,553.78
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	161,794,949.27	76,579,400.81
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	10,993,681.73	59,152.97
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	-	-
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	74,848,613.25	31,457,316.33
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	-	-
减：二、营业总支出		39,007,285.92	23,330,238.88
1. 管理人报酬		11,571,998.23	6,379,591.28
2. 托管费		3,857,332.79	2,126,530.40
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		23,064,928.78	14,677,078.99

其中：卖出回购金融资产支出		23,064,928.78	14,677,078.99
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		360,139.69	6,149.32
8. 其他费用	6.4.7.18	152,886.43	140,888.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		209,624,554.48	85,131,372.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		209,624,554.48	85,131,372.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		209,624,554.48	85,131,372.82

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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	6,935,693,061.96	111,330,127.64	7,047,023,189.60
二、本期期初净资产	6,935,693,061.96	111,330,127.64	7,047,023,189.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,965,214,708.94	133,437,765.07	2,098,652,474.01
（一）、综合收益总额	-	209,624,554.48	209,624,554.48
（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）	1,965,214,708.94	34,784,300.33	1,999,999,009.27
其中：1.基金申购款	1,965,214,711.91	34,784,300.39	1,999,999,012.30
2.基金赎回款	-2.97	-0.06	-3.03
（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	-	-110,971,089.74	-110,971,089.74

减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	8,900,907,770.90	244,767,892.71	9,145,675,663.61
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	2,486,765,836.06	24,654,502.61	2,511,420,338.67
二、本期期初净资产	2,486,765,836.06	24,654,502.61	2,511,420,338.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,448,927,161.40	41,394,472.23	5,490,321,633.63
（一）、综合收益总额	-	85,131,372.82	85,131,372.82
（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）	5,448,927,161.40	51,070,915.03	5,499,998,076.43
其中：1.基金申购款	5,448,927,166.34	51,070,915.08	5,499,998,081.42
2.基金赎回款	-4.94	-0.05	-4.99
（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）	-	-94,807,815.62	-94,807,815.62
四、本期期末净资产	7,935,692,997.46	66,048,974.84	8,001,741,972.30

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

易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(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[2019]870 号《关于准予易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式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《易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 10 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,009,999,000.00 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	2,884,958.23
等于：本金	2,884,758.76
加：应计利息	199.47
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	2,884,958.23

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	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所		27,675,745.61		
	市场	2,774,178,844.40		2,815,116,745.61	13,262,155.60
	银行间		78,503,898.13		
	市场	8,776,937,969.88		8,924,239,398.13	68,797,530.12
	合计	11,551,116,814.28	106,179,643.74	11,739,356,143.74	82,059,685.72
资产支持证券	604,844,324.73	6,356,337.65	615,411,337.65	4,210,675.27	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	12,155,961,139.01	112,535,981.39	12,354,767,481.39	86,270,360.99	

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	105,748.19
其中：交易所市场	-
银行间市场	105,748.19
应付利息	-
预提费用	108,901.52
合计	214,649.71

6.4.7.7 实收基金

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	6,935,693,061.96	6,935,693,061.96
本期申购	1,965,214,711.91	1,965,214,711.91
本期赎回（以“-”号填列）	-2.97	-2.97
本期末	8,900,907,770.90	8,900,907,770.90

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

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	76,360,444.34	34,969,683.30	111,330,127.64
本期期初	76,360,444.34	34,969,683.30	111,330,127.64
本期利润	134,775,941.23	74,848,613.25	209,624,554.48
本期基金份额交易产生的变动数	16,947,483.25	17,836,817.08	34,784,300.33
其中：基金申购款	16,947,483.29	17,836,817.10	34,784,300.39
基金赎回款	-0.04	-0.02	-0.06
本期已分配利润	-110,971,089.74	-	-110,971,089.74

本期末	117,112,779.08	127,655,113.63	244,767,892.71
-----	----------------	----------------	----------------

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	14,915.35	
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	742,328.76	
其他	1,322.83	
合计	758,566.94	

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

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	138,750,441.64	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	23,044,507.63	
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	161,794,949.27	

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	8,404,839,203.13	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,300,407,764.16	
减：应计利息总额	81,278,756.34	
减：交易费用	108,175.00	
买卖债券差价收入	23,044,507.63	

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	11,707,734.26
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-714,052.53
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	10,993,681.73

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	192,288,147.44
减：卖出资产支持证券成本总额	185,631,400.82
减：应计利息总额	7,370,799.15
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-714,052.53

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

本基金本报告期无股利收益。

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	74,848,613.25
——股票投资	-
——债券投资	69,008,974.77
——资产支持证券投资	5,839,638.48
——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	74,848,613.25

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	49,229.18
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
银行汇划费	25,384.91
其他	600.00
合计	152,886.43

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
兴业银行股份有限公司	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	11,571,998.23	6,379,591.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	301,568.15	-
应支付基金管理人的净管理费	11,270,430.08	6,379,591.28

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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	3,857,332.79	2,126,530.40

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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
兴业银行	-	-	-	-	841,770,000.0 0	97,723.70
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
兴业银行	-	-	-	-	257,054,000.0 0	10,892.39

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

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
兴业银行-活期存款	2,884,958.23	14,915.35	2,021,974.38	36,017.90

注：本基金的上述银行存款由基金托管人兴业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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润分 配合计	备注
		场 内	场 外					
1	2024-03-18	-	2024-03-18	0.160	110,971,087. 34	2.40	110,971,089. 74	-
合计				0.160	110,971,087. 34	2.40	110,971,089. 74	-

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 2,274,887,932.73 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
092280139	22 交行二级 资本债 02A	2024-07-01	104.73	426,000	44,613,555.35
102100937	21 陕煤化 MTN003(可持 续挂钩)	2024-07-01	104.84	406,000	42,565,062.25
102103364	21 鲁能源 MTN009B(高 成长债)	2024-07-01	105.68	400,000	42,270,518.03
102281640	22 浙江旅投 MTN002	2024-07-01	103.75	144,000	14,940,480.00
102381354	23 华光环保 MTN002	2024-07-01	100.96	200,000	20,192,545.75
102382134	23 中原环保 MTN001	2024-07-01	103.32	200,000	20,663,147.54
102382147	23 鲁高速股 MTN001	2024-07-01	103.52	300,000	31,054,967.21
102480080	24 凤凰传媒 MTN001	2024-07-01	102.93	300,000	30,880,177.05
102481911	24 吴中经发 MTN001	2024-07-01	100.92	200,000	20,184,704.66
190205	19 国开 05	2024-07-01	107.78	1,000,000	107,783,934.43
210220	21 国开 20	2024-07-01	117.07	50,000	5,853,519.13
220210	22 国开 10	2024-07-01	105.67	100,000	10,567,150.68
230022	23 付息国债 22	2024-07-01	104.21	600,000	62,526,885.25
230205	23 国开 05	2024-07-01	106.51	1,000,000	106,508,054.79
230210	23 国开 10	2024-07-01	104.35	500,000	52,174,520.55
230215	23 国开 15	2024-07-01	105.19	300,000	31,557,245.90
232380006	23 中行二级 资本债 01A	2024-07-01	105.64	400,000	42,257,032.33
232380084	23 中行二级 资本债 04A	2024-07-01	106.44	300,000	31,931,262.30

240202	24 国开 02	2024-07-01	102.25	200,000	20,449,606.56
102200158	22 中原环保 MTN001	2024-07-02	101.27	300,000	30,381,654.25
102282237	22 国兴投资 MTN001	2024-07-02	105.47	300,000	31,641,786.89
102380362	23 鲁国资 MTN002	2024-07-02	103.37	300,000	31,012,056.99
102380947	23 晋交投 MTN001	2024-07-02	101.53	300,000	30,459,000.00
102381697	23 光大水务 MTN002	2024-07-02	104.42	400,000	41,768,852.46
102381766	23 赣投 MTN002	2024-07-02	104.69	400,000	41,876,716.94
102382049	23 皖国资 MTN002	2024-07-02	104.44	300,000	31,331,888.52
102480116	24 瀚蓝 MTN001	2024-07-02	101.99	300,000	30,596,754.10
102480923	24 闽冶金 MTN001	2024-07-02	103.16	50,000	5,157,968.22
102480932	24 物产中大 MTN001	2024-07-02	101.48	300,000	30,443,506.85
102481766	24 先正达 MTN001A	2024-07-02	101.19	400,000	40,477,814.79
132380039	23 融和融资 GN004(碳中 和债)	2024-07-02	100.67	400,000	40,268,986.30
092280080	22 光大银行 二级资本债 01A	2024-07-03	105.46	500,000	52,730,109.29
102381203	23 中国中药 MTN001	2024-07-03	101.94	800,000	81,549,216.44
102381949	23 国新租赁 MTN002	2024-07-03	103.48	206,000	21,317,803.06
132380030	23 光大绿环 GN001	2024-07-03	102.26	600,000	61,355,786.30
102100320	21 徐州新盛 MTN003	2024-07-04	104.78	279,000	29,234,476.11
102280170	22 重庆水务 MTN001	2024-07-04	104.26	200,000	20,852,537.70
102281808	22 闽冶金 MTN001	2024-07-04	103.07	200,000	20,613,300.55
102282622	22 豫水利 MTN002	2024-07-04	102.76	200,000	20,552,032.79
102380228	23 鲁信	2024-07-04	103.18	179,000	18,468,750.49

	MTN001				
102380688	23 赣水投 MTN001	2024-07-04	102.77	300,000	30,831,044.38
102381177	23 重庆机场 MTN001	2024-07-04	101.96	200,000	20,392,838.36
102381928	23 粤环保 MTN003	2024-07-04	104.48	200,000	20,895,763.93
102382890	23 鲁高速 MTN009	2024-07-04	104.54	200,000	20,908,928.96
102383420	23 河南投资 MTN003	2024-07-04	103.44	200,000	20,688,963.93
102480124	24 福州左海 MTN001	2024-07-04	102.89	200,000	20,577,049.18
102480405	24 蜀道投资 MTN002	2024-07-04	103.35	200,000	20,670,918.03
102480901	24 四川机场 MTN003	2024-07-04	102.57	200,000	20,513,824.66
102481553	24 巨石 MTN001	2024-07-04	101.05	200,000	20,209,890.41
102481858	24 蜀道投资 MTN008	2024-07-04	101.21	200,000	20,241,041.10
212380032	24 浦发银行 债 01	2024-07-04	101.52	53,000	5,380,715.37
212400004	24 光大银行 小微债	2024-07-04	100.63	700,000	70,438,008.22
212480009	24 上海银行 债 01	2024-07-04	101.24	1,121,000	113,488,897.50
212480011	24 浙商银行 小微债 03	2024-07-04	100.64	1,000,000	100,639,945.21
232380052	23 农行二级 资本债 02A	2024-07-04	106.78	500,000	53,388,606.56
232480004	24 农行二级 资本债 01A	2024-07-04	103.46	6,000	620,764.72
092280134	22 工行二级 资本债 04A	2024-07-05	104.64	200,000	20,928,885.25
102282394	22 中建七局 MTN001	2024-07-05	102.65	400,000	41,058,518.03
102380968	23 中建七局 MTN001	2024-07-05	102.35	800,000	81,883,989.04
212380005	23 光大银行 债 01	2024-07-05	101.55	300,000	30,464,536.44
212380013	23 浙商银行 债 01	2024-07-05	103.58	500,000	51,791,415.30
212380032	24 浦发银行	2024-07-05	101.52	1,438,000	145,989,975.51

	债 01				
212400004	24 光大银行小微债	2024-07-05	100.63	500,000	50,312,863.01
212480005	24 光大银行债 01	2024-07-05	101.66	290,000	29,482,532.99
232380069	23 建行二级资本债 02A	2024-07-05	107.44	300,000	32,231,311.47
232480004	24 农行二级资本债 01A	2024-07-05	103.46	394,000	40,763,550.03
232480011	24 农行二级资本债 02A	2024-07-05	100.87	400,000	40,348,276.16
合计				24,942,000	2,576,208,422.55

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 1,025,016,627.68 元，于 2024 年 7 月 1 日、2024 年 7 月 5 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。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 126.62%(2023 年 12 月 31 日：117.44%)。

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	344,906,984.46	121,811,452.46
合计	344,906,984.46	121,811,452.46

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	上年度末
--------	-----	------

	2024年6月30日	2023年12月31日
AAA	5,251,615,938.95	3,805,824,303.65
AAA 以下	649,627,313.01	632,288,608.89
未评级	3,821,588,366.76	3,245,141,126.01
合计	9,722,831,618.72	7,683,254,038.55

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	575,211,370.53	646,102,594.44
AAA 以下	40,199,967.12	87,386,926.31
未评级	0.00	0.00
合计	615,411,337.65	733,489,520.75

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	1,671,617,540.56	692,671,894.26
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,671,617,540.56	692,671,894.26

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	2,884,958.23	-	-	-	2,884,958.23
结算备付金	88,493,353.51	-	-	-	88,493,353.51
存出保证金	79,721.89	-	-	-	79,721.89
交易性金融资产	3,447,780,350.39	7,848,625,960.60	1,058,361,170.40	-	12,354,767,48

					1.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	3,121,523.35	3,121,523.35
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,539,238,384.02	7,848,625,960.60	1,058,361,170.40	3,121,523.35	12,449,347,038.37
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	3,299,904,560.41	-	-	-	3,299,904,560.41
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,244,377.75	2,244,377.75
应付托管费	-	-	-	748,125.92	748,125.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	559,660.97	559,660.97
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	214,649.71	214,649.71
负债总计	3,299,904,560.41	-	-	3,766,814.35	3,303,671,374.76
利率敏感度缺口	239,333,823.61	7,848,625,960.60	1,058,361,170.40	-645,291.00	9,145,675,663.61
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,321,210.38	-	-	-	1,321,210.38
结算备付金	108,338,344.77	-	-	-	108,338,344.77

存出保证金	386,689.65	-	-	-	386,689.65
交易性金融资产	1,450,866,817.63	6,718,886,152.18	1,061,473,936.21	-	9,231,226,906.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,824,712.90	1,824,712.90
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,560,913,062.43	6,718,886,152.18	1,061,473,936.21	1,824,712.90	9,343,097,863.72
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	2,291,489,157.61	-	-	-	2,291,489,157.61
应付清算款	-	-	-	1,253,815.71	1,253,815.71
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,787,359.46	1,787,359.46
应付托管费	-	-	-	595,786.47	595,786.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	469,121.44	469,121.44
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	479,433.43	479,433.43
负债总计	2,291,489,157.61	-	-	4,585,516.51	2,296,074,674.12
利率敏感度缺口	-730,576,095.18	6,718,886,152.18	1,061,473,936.21	-2,760,803.61	7,047,023,189.60

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	上年度末

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	63,890,789.64	42,867,243.64
	2.市场利率上升 25 个基点	-63,243,889.58	-42,464,647.34

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。本基金不直接在二级市场买入股票、可转换债券、权证等资产，也不参与一级市场新股申购、新股增发、新可转换债券申购。

于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

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	-
第二层次	12,354,767,481.39
第三层次	-
合计	12,354,767,481.39

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应

属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,354,767,481.39	99.24
	其中：债券	11,739,356,143.74	94.30
	资产支持证券	615,411,337.65	4.94
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	91,378,311.74	0.73
8	其他各项资产	3,201,245.24	0.03
9	合计	12,449,347,038.37	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

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

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

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	62,526,885.25	0.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,066,687,411.69	44.47
	其中：政策性金融债	529,462,953.26	5.79
4	企业债券	1,732,703,173.99	18.95
5	企业短期融资券	10,340,524.59	0.11
6	中期票据	4,013,198,666.78	43.88
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,671,617,540.56	18.28

9	其他	182,281,940.88	1.99
10	合计	11,739,356,143.74	128.36

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	112417095	24 光大银行 CD095	2,000,000	196,514,454.79	2.15
2	112409170	24 浦发银行 CD170	2,000,000	196,261,078.36	2.15
3	112405209	24 建设银行 CD209	2,000,000	196,235,576.99	2.15
4	112408193	24 中信银行 CD193	2,000,000	196,194,246.58	2.15
5	212480005	24 光大银行债 01	1,900,000	193,161,423.01	2.11

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	260418	G 黄河优	1,200,000	124,856,061.37	1.37
2	180204	22 葛洲优	600,000	60,234,137.71	0.66
3	135002	22 上城优	500,000	50,427,865.76	0.55
4	180007	九江 2 优 B	500,000	46,623,398.91	0.51
5	180991	工鑫 15A	400,000	41,286,509.59	0.45
6	260255	耘睿 101A	400,000	40,478,218.08	0.44
7	260049	漳城 03 优	400,000	40,199,967.12	0.44
8	112333	百股 01 优	300,000	30,623,082.38	0.33
9	260258	耘睿 102A	300,000	30,429,833.42	0.33
10	180912	22 苏新优	300,000	30,390,775.89	0.33
11	180006	九江 2 优 A	300,000	28,914,342.33	0.32
12	149349	PR 皖新 1A	250,000	17,957,164.54	0.20
13	112139	中交 05A	500,000	17,399,249.13	0.19
14	199979	工投 3A2	200,000	15,065,346.59	0.16
15	112483	22 京置优	100,000	10,306,232.88	0.11

16	193933	和皖 A	100,000	10,249,777.05	0.11
17	183480	PR 铁置优	100,000	10,022,161.64	0.11
18	260124	TB17A302	100,000	9,947,213.26	0.11

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或原始权益人中,上海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上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。浙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浙江监管局、国家税务总局浙江省税务局第三税务分局的处罚。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。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中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。资产支持证券 G 黄河优的管理人中信建投证券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市分局、国家外汇管理局黑龙江省分局的处罚。

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和原始权益人出现本期

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 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

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	79,721.89
2	应收清算款	3,121,523.35
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,201,245.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 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

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
210	42,385,275.10	8,900,907,770.90	100.00%	0.00	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

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	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 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资金	-	-	10,000,000.00	0.1123%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,000,000.00	0.1123%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 10 月 15 日）基金份额总额	1,009,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	6,935,693,061.96
本报告期基金总申购份额	1,965,214,711.91
减：本报告期基金总赎回份额	2.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,900,907,770.90

§ 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	
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为兴业证券股份有限公司，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
德邦证券	-	-	-	-	-	-

东海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	6,905,285,000.00	6.80%	-	-
申万宏源	1,821,847,340.00	96.81%	86,145,542,000.00	84.88%	-	-
招商证券	60,026,160.00	3.19%	8,438,000,000.00	8.31%	-	-

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	易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金第十八个运作期开放申购、赎回和转换业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-10
2	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	证券时报	2024-01-19
3	易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-15
4	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	证券时报	2024-03-29
5	易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金第十九个运作期开放申购、赎回和转换业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-11
6	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	证券时报	2024-04-20
7	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	证券时报、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 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024 年 01 月 01 日~2024 年 06 月 30 日	4,448,927,085.73	0.00	0.00	4,448,927,085.73	49.98%

	2	2024 年 01 月 01 日 ~2024 年 06 月 30 日	2,486,76 5,775.70	0.00	0.00	2,486,76 5,775.70	27.94 %
	3	2024 年 04 月 30 日 ~2024 年 06 月 30 日	0.00	1,965,21 4,699.81	0.00	1,965,21 4,699.81	22.08 %

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付或延期办理赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形，且经与基金托管人协商一致，基金管理人有权终止基金合同，本基金面临终止清盘的风险；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、定期开放运作的风险

(1) 本基金以定期开放方式运作且不上市交易，投资者仅可在开放运作期申赎基金份额，在封闭运作期内无法申购赎回。若投资者在开放运作期末赎回基金份额，则需继续持有至下一封闭运作期结束才能赎回，投资者在封闭运作期内存在无法赎回基金份额的风险。

(2) 基金合同生效后的首个运作期为封闭运作期，自基金合同生效日至基金管理人规定的时间，首个封闭运作期可能少于或者超过 3 个月，投资者应仔细阅读相关法律文件及公告，并及时行使相关权利。

(3) 除首个运作期封闭运作外，本基金的运作期包含“封闭运作期”和“开放运作期”，运作期限 3 个月，基金管理人在每个封闭运作期结束前公布开放运作期和下一封闭运作期的具体时间安排，由于市场环境等因素的影响，本基金每次开放运作期和封闭运作期的时间及长度不完全一样，投资者应关注相关公告并及时行使权利，否则会面临无法申购/赎回基金份额的风险。

2、单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过 50% 的风险

(1) 本基金单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过 50%，单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者大额赎回时，可能会对本基金资产运作及净值表现产生较大影响。

(2) 巨额赎回的风险

相对于其他基金，本基金更可能因开放期内单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者集中大额赎回发生巨额赎回。当发生巨额赎回时，基金管理人可能根据基金当时的资产组合状况决定延缓支付赎回款，投资者面临赎回款被延缓支付的风险。

3、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同的风险

本基金的销售对象主要为机构投资者，不向个人投资者公开发售，基金持续营销可能受到影响。本基金基金合同生效满三年后继续存续的，若连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于 5000 万元情形，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。投资者面临转换基金运作方式、与其他基金合并或终止基金合同的风险。

《基金合同》生效满三年后的存续期内，若连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权终止基金合同。若管理人与托管人根据实际情况决定终止

基金合同，本基金面临终止清盘的风险。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 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。

12.3 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