

# 易方达安心回报债券型证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 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
报告期末基金份额总额	5,197,032,212.04 份
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

	<p>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。</p>	
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。	
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	
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	4,368,607,754.39 份	828,424,457.65 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
	1.本期已实现收益	17,467,160.29
2.本期利润	183,815,764.71	33,440,103.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.0408	0.0395
4.期末基金资产净值	8,577,484,228.84	1,590,307,878.34
5.期末基金份额净值	1.9634	1.9197

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

##### 易方达安心回报债券 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	2.40%	0.37%	0.96%	0.01%	1.44%	0.36%
过去六个月	4.04%	0.32%	1.91%	0.01%	2.13%	0.31%
过去一年	3.96%	0.31%	3.81%	0.01%	0.15%	0.30%
过去三年	0.30%	0.33%	11.42%	0.01%	-11.12%	0.32%
过去五年	29.06%	0.41%	19.03%	0.01%	10.03%	0.40%
自基金合同生效起至今	275.47%	0.67%	58.21%	0.01%	217.26%	0.66%

##### 易方达安心回报债券 B

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	2.29%	0.37%	0.96%	0.01%	1.33%	0.36%
过去六个月	3.82%	0.31%	1.91%	0.01%	1.91%	0.30%
过去一年	3.53%	0.31%	3.81%	0.01%	-0.28%	0.30%
过去三年	-0.87%	0.32%	11.42%	0.01%	-12.29%	0.31%
过去五年	26.47%	0.41%	19.03%	0.01%	7.44%	0.40%
自基金合同生效起至今	258.22%	0.67%	58.21%	0.01%	200.01%	0.66%

### 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

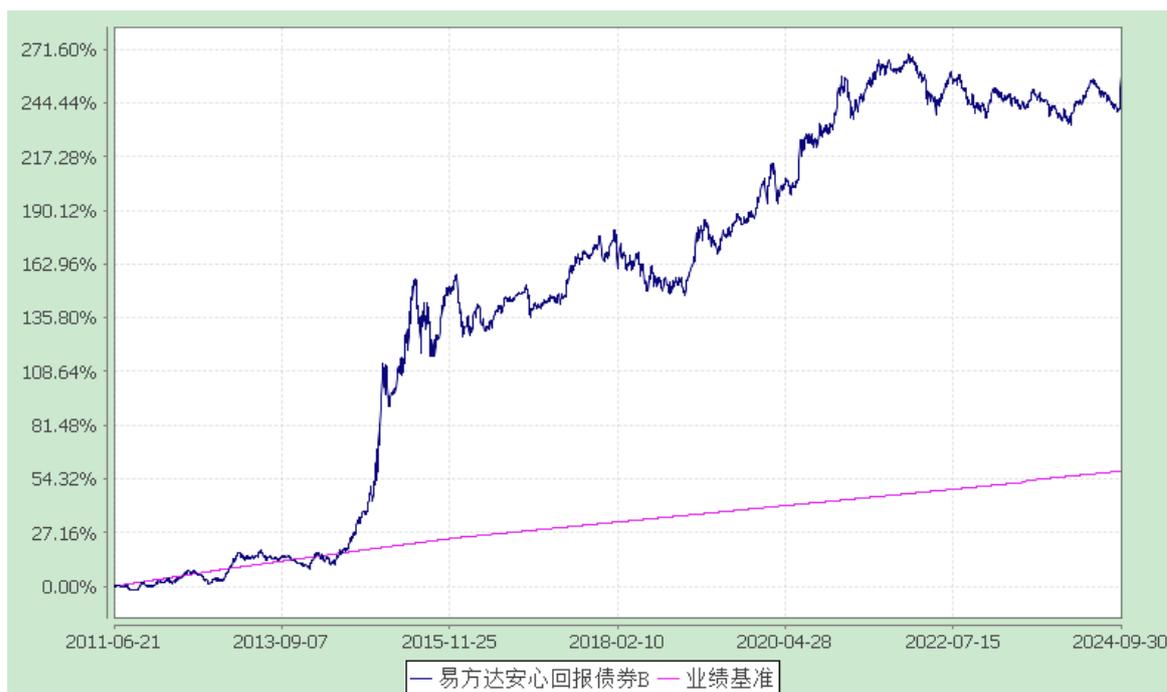
易方达安心回报债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2011 年 6 月 21 日至 2024 年 9 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275.47%，同期业绩比较基准收益率为58.21%；B类基金份额净值增长率为258.22%，同期业绩比较基准收益率为58.21%。

## § 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、易方达悦兴一年持有混合、易方达全球配置混合（QDII）的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益及多资产投资决策委员会委员	2013-12-23	-	17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、易方达新收益混合、易方达安心回馈混合、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、易方达新亨混合、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、易方达丰华债券、易方达磐固六个月持有混合的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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，“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，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 28 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，2 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

三季度经济基本面延续疲弱态势，地产销售低迷、投资维持低位、消费整体仍在回落，财政投放未明显加速、基建投资亦高位回落。内需持续拖累，外需是为数不多的亮点。在需求疲软、价格偏弱的背景下，全年经济增速的目标面临较大的考验，上证指数跌破 2700，十年期国债收益率接近 2%，反映市场的信心较为悲观。9 月下旬金融监管总局、央行和证监会联合出台一系列宽松政策，且 9 月政治局会议讨论了经济问题，强调“抓住重点、主动作为，有效落实存量政策，加力推出增量政策”，表明政策基调整体发生了比较重大的变化。受到政策表态提振，市场风险偏好明显提升，市场对于经济悲观的定价快速修正，一周之内，资产价格大幅波动，十年期国债收益率上行超过 20 个基点，上证指数上涨约 23%。

股票市场三季度整体先跌后涨，9 月中旬之前受到基本面持续下滑的影响，市场风险偏好疲弱，市场资金集中在偏防御的高股息板块如银行、石油石化、公共事业等。直至 9 月下旬，一系列宽松政策相继落地，股市隐含的悲观预期得到快速修正，市场连续大涨。9 月最后一周指数大涨收复年内全部跌幅。

债券收益率先下后上，波动剧烈。9 月 23 日之前，收益率维持震荡下行态势，经济基本面疲弱、机构配置需求强烈、美联储开启降息周期，债券整体处于牛市环境，央行多次通过官媒提示长债风险并在银行间市场开展国债借入操作，收益率震荡下行但节奏克制。直至 9 月 24 日，稳增长政策集中大规模输出，货币政策虽有超预期的降准降息出台，但市场对财政等经济刺激政策加码的预期更强，市场风险偏好迅速扭转，债券市场长端收益率大幅上行。整个季度，债券收益率曲线走陡，1 年、10 年和 30 年期国债收益率较二季度末分别下行 17bp、5bp 和 7bp，信用利差有所走阔。

转债走势基本跟随股票市场，但表现稍差。9 月中旬之前信用风险的持续发酵导致低价券跌幅较多，超半数转债跌破债底，尤其是银行转债跌破债底显示市场已经出现超调；9 月最后一周随权益市场反弹，转债情绪亦有所修复，但反弹力度远不及股票，表现出滞涨特征，转债溢价率有所压缩。

报告期内，本基金规模有所下降。股票方面，仓位小幅上升，减持受价格及内需

影响较大的化工、计算机等行业，部分涨幅较多的银行等红利个股择机止盈，小幅加仓供给格局清晰、分红率高的公用事业。转债方面，仓位有所提升，提升了平衡低估与偏股型转债的配置，同时配置了部分偏债高质量个券、市场价格及转股溢价率双低的新券，组合的绝对价格有所提升，依然维持对平衡型转债的超配。债券方面，三季度地产与消费等内生需求持续低迷，经济整体仍面临较大的下行压力，美联储降息操作打开了国内货币政策的操作空间，组合久期及仓位逐步提升至偏积极水平；季末政策积极程度显著提升，但考虑到政策效果尚待观察，同时货币政策宽松仍将继续落地，组合维持既有久期，进一步增强了长端利率债操作的灵活性，在信用利差偏低的期间，组合提高利率品种的配置比例，期限上偏向哑铃型配置。

#### 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 1.9634 元，本报告期份额净值增长率为 2.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.96%；B 类基金份额净值为 1.9197 元，本报告期份额净值增长率为 2.29%，同期业绩比较基准收益率为 0.96%。

#### 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	1,672,097,704.31	12.09
	其中：股票	1,672,097,704.31	12.09
2	固定收益投资	11,683,791,085.66	84.51
	其中：债券	11,324,841,579.61	81.91
	资产支持证券	358,949,506.05	2.60
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	93,047,737.14	0.67
7	其他资产	376,370,252.01	2.72
8	合计	13,825,306,779.12	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	-	-
B	采矿业	110,899,345.44	1.09
C	制造业	843,511,387.58	8.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	195,170,818.55	1.92
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	101,108,350.66	0.99
J	金融业	345,141,705.04	3.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	21,352,814.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	54,913,283.04	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,672,097,704.31	16.45

## 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	600486	扬农化工	3,837,807	237,944,034.00	2.34
2	000858	五粮液	1,169,799	190,104,035.49	1.87
3	600036	招商银行	4,810,400	180,919,144.00	1.78
4	600519	贵州茅台	68,880	120,402,240.00	1.18
5	600028	中国石化	15,933,814	110,899,345.44	1.09
6	601658	邮储银行	20,173,100	106,110,506.00	1.04
7	688188	柏楚电子	479,846	101,108,350.66	0.99
8	600886	国投电力	5,807,389	98,435,243.55	0.97
9	600900	长江电力	2,529,200	76,002,460.00	0.75
10	002415	海康威视	2,341,325	75,601,384.25	0.74

## 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	2,431,997,248.13	23.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,969,659,049.78	39.04
	其中：政策性金融债	734,410,990.12	7.22
4	企业债券	306,241,878.92	3.01
5	企业短期融资券	51,351,849.83	0.51
6	中期票据	1,526,913,953.38	15.02
7	可转债（可交换债）	3,038,677,599.57	29.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,324,841,579.61	111.38

## 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	230023	23 付息国债 23	10,800,000	1,247,024,655.74	12.26
2	240011	24 付息国债 11	10,600,000	1,079,246,777.17	10.61
3	2228006	22 中国银行二级 01	3,700,000	386,143,322.40	3.80
4	240304	24 进出 04	3,250,000	327,257,369.86	3.22
5	113050	南银转债	2,090,720	262,811,981.43	2.58

#### 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	260418	G 黄河优	500,000	50,942,334.00	0.50
2	156659	PR 产 1A	500,000	46,093,059.62	0.45
3	135755	22 吉电优	400,000	41,742,734.54	0.41
4	112561	22 和闽优	400,000	41,399,724.90	0.41
5	112592	G 重庆优	300,000	31,407,978.08	0.31
6	199694	G23XH 优	300,000	30,660,800.82	0.30
7	199204	23 华兴优	300,000	25,185,064.80	0.25
8	199670	23 中公 1A	200,000	20,523,484.93	0.20
9	193933	和皖 A	100,000	10,289,339.51	0.10
10	183148	G 国电优	100,000	10,263,406.58	0.10

#### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 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，南京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国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总

局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	165,267.91
2	应收证券清算款	74,431,297.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	301,773,686.20
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	376,370,252.01

### 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	113050	南银转债	262,811,981.43	2.58
2	110059	浦发转债	206,884,554.58	2.03
3	123107	温氏转债	145,433,353.89	1.43
4	110079	杭银转债	128,187,047.40	1.26
5	113065	齐鲁转债	101,874,489.52	1.00
6	113056	重银转债	76,393,348.81	0.75
7	127040	国泰转债	75,354,355.40	0.74
8	110073	国投转债	69,915,888.50	0.69
9	128129	青农转债	68,323,168.70	0.67
10	113037	紫银转债	65,840,107.53	0.65
11	113052	兴业转债	65,675,589.04	0.65

12	113060	浙 22 转债	61,251,237.13	0.60
13	110067	华安转债	52,981,849.66	0.52
14	110068	龙净转债	48,963,551.36	0.48
15	113068	金铜转债	48,162,612.25	0.47
16	113042	上银转债	48,054,575.07	0.47
17	113033	利群转债	46,217,130.08	0.45
18	127049	希望转 2	43,264,663.15	0.43
19	123190	道氏转 02	42,372,887.88	0.42
20	113058	友发转债	41,121,061.51	0.40
21	110074	精达转债	36,717,952.67	0.36
22	127095	广泰转债	36,380,237.60	0.36
23	123228	震裕转债	36,031,863.57	0.35
24	132026	G 三峡 EB2	35,532,812.76	0.35
25	127086	恒邦转债	34,395,896.20	0.34
26	111017	蓝天转债	32,284,178.52	0.32
27	127050	麒麟转债	32,032,334.02	0.32
28	128081	海亮转债	31,564,971.45	0.31
29	127027	能化转债	30,058,448.31	0.30
30	113647	禾丰转债	28,776,600.48	0.28
31	127032	苏行转债	27,643,335.47	0.27
32	123213	天源转债	27,191,949.87	0.27
33	111018	华康转债	26,965,203.03	0.27
34	132020	19 蓝星 EB	25,797,408.62	0.25
35	113682	益丰转债	25,648,303.78	0.25
36	110094	众和转债	24,993,384.83	0.25
37	127103	东南转债	23,578,626.45	0.23
38	113053	隆 22 转债	23,503,768.04	0.23
39	128128	齐翔转 2	23,295,870.37	0.23
40	123194	百洋转债	23,201,875.23	0.23
41	127045	牧原转债	20,332,645.97	0.20
42	127084	柳工转 2	20,284,232.57	0.20
43	113021	中信转债	19,962,861.09	0.20
44	113069	博 23 转债	19,707,753.74	0.19
45	123187	超达转债	19,586,544.38	0.19
46	118042	奥维转债	19,559,051.37	0.19
47	110084	贵燃转债	19,246,403.92	0.19
48	123188	水羊转债	18,701,896.13	0.18
49	118022	锂科转债	17,889,405.69	0.18
50	123225	翔丰转债	17,822,055.81	0.18
51	128130	景兴转债	17,226,956.15	0.17
52	110081	闻泰转债	16,962,276.29	0.17
53	118028	会通转债	16,864,901.73	0.17
54	127039	北港转债	16,622,054.38	0.16

55	113066	平煤转债	16,025,433.61	0.16
56	110090	爱迪转债	15,961,457.88	0.16
57	113051	节能转债	15,062,658.15	0.15
58	113044	大秦转债	14,911,261.36	0.15
59	111002	特纸转债	14,388,777.53	0.14
60	118034	晶能转债	14,365,519.72	0.14
61	118031	天 23 转债	13,340,926.50	0.13
62	111007	永和转债	12,920,295.17	0.13
63	128049	华源转债	12,915,420.48	0.13
64	111005	富春转债	12,773,287.28	0.13
65	113054	绿动转债	12,758,703.63	0.13
66	123211	阳谷转债	12,423,615.98	0.12
67	113632	鹤 21 转债	12,418,525.49	0.12
68	111011	冠盛转债	12,408,194.26	0.12
69	123203	明电转 02	12,156,888.77	0.12
70	123178	花园转债	11,730,661.11	0.12
71	128083	新北转债	10,236,521.95	0.10
72	118030	睿创转债	10,182,759.55	0.10
73	113648	巨星转债	10,030,360.99	0.10
74	110095	双良转债	9,926,076.06	0.10
75	123085	万顺转 2	9,720,900.90	0.10
76	113609	永安转债	8,890,848.63	0.09
77	128141	旺能转债	8,600,110.00	0.08
78	113664	大元转债	8,479,269.30	0.08
79	127078	优彩转债	8,439,009.78	0.08
80	113059	福莱转债	8,408,143.37	0.08
81	127067	恒逸转 2	8,339,255.78	0.08
82	113628	晨丰转债	8,163,786.30	0.08
83	113652	伟 22 转债	8,128,361.69	0.08
84	113676	荣 23 转债	7,468,450.88	0.07
85	113631	皖天转债	6,996,826.49	0.07
86	118009	华锐转债	6,956,826.49	0.07
87	110087	天业转债	6,893,884.78	0.07
88	123158	宙邦转债	6,183,008.62	0.06
89	113653	永 22 转债	6,061,273.52	0.06
90	110085	通 22 转债	5,863,567.32	0.06
91	123191	智尚转债	5,809,165.32	0.06
92	127022	恒逸转债	5,800,722.72	0.06
93	111012	福新转债	5,709,946.48	0.06
94	113670	金 23 转债	4,905,556.77	0.05
95	110077	洪城转债	4,627,971.99	0.05
96	111015	东亚转债	4,014,425.44	0.04
97	113062	常银转债	2,615,794.24	0.03

98	127082	亚科转债	1,854,183.87	0.02
99	113661	福 22 转债	1,403,016.76	0.01
100	127030	盛虹转债	966,157.78	0.01
101	123174	精锻转债	322.80	0.00

#### 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	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B
报告期期初基金份额总额	4,673,782,829.48	902,428,960.09
报告期期间基金总申购份额	267,419,917.13	31,531,070.22
减：报告期期间基金总赎回份额	572,594,992.22	105,535,572.66
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	4,368,607,754.39	828,424,457.65

### § 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。

## 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

二〇二四年十月二十五日