

易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47

7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金	
基金简称	易方达悦安一年持有债券	
基金主代码	011298	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 4 月 6 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	249,005,843.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
下属分级基金的交易代码	011298	011299
报告期末下属分级基金的份额总额	120,611,260.35 份	128,394,583.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过在可投范围内的多类资产间的动态配置，在做好风险管理的基础上，运用多样化的投资策略追求基金资产的稳定增值。1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的配置比例。2、本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资；本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。3、本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。4、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。5、本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的风险等。
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率×2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	易方达基金管理有限公司		平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	潘琦
	联系电话	020-85102688	0755-22168257
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话	400 881 8088		95511-3
传真	020-38798812		0755-82080387
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层		广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
办公地址	广东省广州市天河区珠江西路 21号52层；广东省广州市天河 区珠江东路30号42层；广东省 珠海市横琴新区荣粤道188号6 层		广东省深圳市福田区益田路 5023号平安金融中心B座
邮政编码	510627；510623；519031		518001
法定代表人	吴欣荣		谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	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	广东省广州市天河区珠江西路 21 号 52 层； 广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层； 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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
本期已实现收益	8,558,578.23	8,819,967.02
本期利润	11,570,429.06	12,040,665.46
加权平均基金份额本期利润	0.0908	0.0866
本期加权平均净值利润率	8.19%	7.96%

本期基金份额净值增长率	8.52%	8.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
期末可供分配利润	11,586,126.28	9,370,950.40
期末可供分配基金份额利润	0.0961	0.0730
期末基金资产净值	140,278,259.40	146,226,821.69
期末基金份额净值	1.1631	1.1389
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
基金份额累计净值增长率	16.31%	13.89%

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

易方达悦安一年持有债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.15%	0.36%	1.84%	0.13%	5.31%	0.23%
过去六个月	8.52%	0.31%	2.16%	0.12%	6.36%	0.19%
过去一年	10.58%	0.25%	3.34%	0.11%	7.24%	0.14%
过去三年	15.79%	0.22%	14.60%	0.11%	1.19%	0.11%
过去五年	15.60%	0.19%	20.51%	0.11%	-4.91%	0.08%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.31%	0.18%	21.89%	0.11%	-5.58%	0.07%

易方达悦安一年持有债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.04%	0.36%	1.84%	0.13%	5.20%	0.23%
过去六个月	8.30%	0.31%	2.16%	0.12%	6.14%	0.19%
过去一年	10.13%	0.25%	3.34%	0.11%	6.79%	0.14%
过去三年	14.39%	0.22%	14.60%	0.11%	-0.21%	0.11%

过去五年	13.31%	0.19%	20.51%	0.11%	-7.20%	0.08%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	13.89%	0.18%	21.89%	0.11%	-8.00%	0.07%

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

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

(2021 年 4 月 6 日至 2026 年 6 月 30 日)

易方达悦安一年持有债券 A



易方达悦安一年持有债券 C



§ 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 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		
汪子冲	本基金的基金经理，易方达裕富债券、易方达磐固六个月持有混合、易方达新益混合、易方达瑞选混合、易方达瑞祺混合、易方达裕鑫债券、易方达鑫转增利混合、易方达鑫转招利混合、易方达瑞川混合、易方达瑞安混合、易方达瑞康混合、易方达磐恒九个月持有混合、易方达	2025-05-17	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任泰康资产管理有限责任公司固定收益研究高级经理。

	招易一年持有混合、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合、易方达瑞弘混合、易方达稳健添利混合的基金经理助理				
包正钰	本基金的基金经理，易方达价值精选混合、易方达红利混合、易方达科鑫量化选股股票发起式、易方达科智量化选股股票发起式、易方达瑞祺混合、易方达研究智选股票的基金经理，研究部总经理助理、行业研究员	2025-09-12	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。
胡文伯	本基金的基金经理助理，易方达裕鑫债券、易方达鑫转招利混合、易方达磐固六个月持有混合的基金经理，易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达磐恒九个月持有混合、易方达悦享一年持有混合、易方达安盈回报混合、易方达安心回报债券的基金经理助理	2023-06-16	-	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固定收益研究员，易方达双债增强债券、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合的基金经理。

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/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.自 2026 年 8 月 5 日起，胡文伯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》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，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 64 次，均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。

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

2026 年上半年，国内经济延续温和修复但结构分化的格局：出口与财政投放形成支撑，制造业 PMI 自 3 月起回升至扩张区间附近，内生需求修复仍偏缓，5 月社会消费品零售总额同比小幅转负。债券市场方面，上半年资金面平稳偏松，收益率中枢温和下行，十年期国债收益率从年初 1.85% 附近回落至 6 月末 1.73% 附近，信用利差维持低位，票息资产表现稳健；权益市场先抑后扬、结构化显著，人工智能产业链相关行业涨幅居前，传统行业多数回调。

权益操作方面，组合延续多策略混合模式，依据风险收益特征动态分配风险预算。一季度围绕多策略再平衡进行结构优化；二季度权益市场结构性机会较多，权益子策略对组合形成正贡献，在部分方向涨幅较大后，我们按照既定规则进行了再平衡，控制单一方向的风险集中度。报告期内组合各项风险指标处于既定范围。

债券操作方面，组合整体以偏高久期运行。节奏上，考虑到资金面对债券形成较强支撑以及国内高频数据边际走弱，组合阶段性通过利率债调节了久期。结构上，底仓品种仍以高等级信用债和银行资本补充工具为主以获取票息收益，并持续对期限结构及持仓个券进行优化。

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 1.1631 元，本报告期份额净值增长率为 8.52%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%；C 类基金份额净值为 1.1389 元，本报告期份额净值增长率为 8.30%，同期业绩比较基准收益率为 2.16%。

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，权益市场方面，我们总体保持积极的看法：成长方向仍是重要主线，结构性机会有望延续，但部分方向涨幅较大后波动可能加剧，其他低位方向亦存在轮动修复行情的可能性。组合将继续通过多策略协同与动态再平衡把握权益的结构性机会，严格控制回撤与波动，力争以相对平滑的净值路径为持有人积累可持续的回报。债券市场方面，中期维度利率低位震荡的格局暂时难以改变，将重点参与各类结构性机会：一方面，内生需求较弱叠加居民信贷不佳，抑制了利率的上

行风险；另一方面，政策利率进一步明显下调的动力也不强，制约了利率的下行空间；操作计划方面，组合将继续聚焦在债券收益率曲线上有价值的品种和期限，持续获取结构性超额机会，同时密切关注基本面各类因素的变化，以防利率区间震荡格局打破的可能。

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程序和技术，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达悦安一年持有债券 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达悦安一年持有债券 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，

未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,188,185.00	1,205,640.90
结算备付金		4,079,026.64	3,443,834.30
存出保证金		1,516,270.57	51,724.32
交易性金融资产	6.4.7.2	368,890,982.09	429,509,921.77
其中：股票投资		55,325,070.99	65,847,586.19
基金投资		-	-
债券投资		313,565,911.10	344,127,356.16
资产支持证券投资		-	19,534,979.42
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		1,116,770.92	997,645.24
应收股利		4,649.87	-
应收申购款		96,279.37	144.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		376,892,164.46	435,208,911.46
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		88,016,441.07	114,010,214.16

应付清算款		193,201.48	5,549.44
应付赎回款		1,660,422.97	1,436,951.49
应付管理人报酬		141,745.27	165,905.75
应付托管费		35,436.30	41,476.45
应付销售服务费		48,080.23	57,043.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,562.85	14,251.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	278,193.20	131,029.02
负债合计		90,387,083.37	115,862,421.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	249,005,843.74	300,918,497.47
未分配利润	6.4.7.8	37,499,237.35	18,427,992.90
净资产合计		286,505,081.09	319,346,490.37
负债和净资产总计		376,892,164.46	435,208,911.46

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1631 元，C 类基金份额净值 1.1389 元；基金份额总额 249,005,843.74 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 120,611,260.35 份，C 类基金份额总额 128,394,583.39 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		25,834,260.00	12,219,966.89
1.利息收入		21,155.02	26,815.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	21,155.02	23,984.71
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,830.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,580,555.71	13,090,670.31
其中：股票投资收益	6.4.7.10	13,940,306.25	-4,441,920.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,404,733.11	16,582,430.88
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	245,330.13	486,730.08
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	612,664.13	-403,608.31

股利收益	6.4.7.14	377,522.09	867,037.77
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	6,232,549.27	-897,518.51
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		2,223,165.48	4,592,864.63
1. 管理人报酬		871,815.28	1,599,271.52
2. 托管费		217,953.80	399,817.92
3. 销售服务费		300,327.66	570,910.11
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		724,330.66	1,893,266.90
其中：卖出回购金融资产支出		724,330.66	1,893,266.90
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		11,471.26	15,333.99
8. 其他费用	6.4.7.18	97,266.82	114,264.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,611,094.52	7,627,102.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,611,094.52	7,627,102.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		23,611,094.52	7,627,102.26

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	300,918,497.47	18,427,992.90	319,346,490.37
二、本期期初净资产	300,918,497.47	18,427,992.90	319,346,490.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-51,912,653.73	19,071,244.45	-32,841,409.28
（一）、综合收益总额	-	23,611,094.52	23,611,094.52
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	-51,912,653.73	-4,539,850.07	-56,452,503.80

资产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	9,384,116.05	1,193,023.23	10,577,139.28
2.基金赎回款	-61,296,769.78	-5,732,873.30	-67,029,643.08
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	249,005,843.74	37,499,237.35	286,505,081.09
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	629,751,929.75	16,813,762.01	646,565,691.76
二、本期期初净资产	629,751,929.75	16,813,762.01	646,565,691.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-189,011,668.90	1,886,234.68	-187,125,434.22
(一)、综合收益总额	-	7,627,102.26	7,627,102.26
(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)	-189,011,668.90	-5,740,867.58	-194,752,536.48
其中：1.基金申购款	572,923.82	19,757.47	592,681.29
2.基金赎回款	-189,584,592.72	-5,760,625.05	-195,345,217.77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	440,740,260.85	18,699,996.69	459,440,257.54

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：吴欣荣，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

易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3701号《关于准予易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金基金合同》于2021年4月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为14,039,630,220.97份基金份额，其中认购资金利息折合26,329.71份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告2023年第39号

《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[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》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》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。资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。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。

至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（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及金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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。

(5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,188,185.00
等于：本金	1,187,915.70
加：应计利息	269.30
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	1,188,185.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	51,452,601.46	-	55,325,070.99	3,872,469.53
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所 市场	55,497,801.71	388,655.77	56,210,655.65	324,198.17
	银行间 市场	252,694,961.10	2,325,655.45	257,355,255.45	2,334,638.90
	合计	308,192,762.81	2,714,311.22	313,565,911.10	2,658,837.07
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		359,645,364.27	2,714,311.22	368,890,982.09	6,531,306.60

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	40,516,400.00	-	-	-
TL2609	40,516,400.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	40,516,400.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
TL2609	TL2609	36	40,950,000.00	433,600.00
合计	-	-	-	433,600.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	433,600.00
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2026 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	199,545.08
其中：交易所市场	187,252.08
银行间市场	12,293.00
应付利息	-
预提费用	78,648.12
合计	278,193.20

6.4.7.7 实收基金

易方达悦安一年持有债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	143,487,238.92	143,487,238.92
本期申购	7,792,112.75	7,792,112.75
本期赎回（以“-”号填列）	-30,668,091.32	-30,668,091.32
本期末	120,611,260.35	120,611,260.35

易方达悦安一年持有债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	157,431,258.55	157,431,258.55
本期申购	1,592,003.30	1,592,003.30
本期赎回（以“-”号填列）	-30,628,678.46	-30,628,678.46
本期末	128,394,583.39	128,394,583.39

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达悦安一年持有债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,114,366.31	6,188,104.31	10,302,470.62
本期期初	4,114,366.31	6,188,104.31	10,302,470.62
本期利润	8,558,578.23	3,011,850.83	11,570,429.06
本期基金份额交易产生的变动数	-1,086,818.26	-1,119,082.37	-2,205,900.63
其中：基金申购款	578,637.50	448,378.26	1,027,015.76
基金赎回款	-1,665,455.76	-1,567,460.63	-3,232,916.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,586,126.28	8,080,872.77	19,666,999.05

易方达悦安一年持有债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,433,348.08	6,692,174.20	8,125,522.28
本期期初	1,433,348.08	6,692,174.20	8,125,522.28
本期利润	8,819,967.02	3,220,698.44	12,040,665.46
本期基金份额交易产生的变动数	-882,364.70	-1,451,584.74	-2,333,949.44
其中：基金申购款	75,459.80	90,547.67	166,007.47
基金赎回款	-957,824.50	-1,542,132.41	-2,499,956.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,370,950.40	8,461,287.90	17,832,238.30

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,647.31
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	16,396.74
其他	110.97
合计	21,155.02

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	13,940,306.25
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	13,940,306.25

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	352,388,794.57
减：卖出股票成本总额	337,925,699.27
减：交易费用	522,789.05
买卖股票差价收入	13,940,306.25

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,262,071.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,142,662.10
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	4,404,733.11

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交	257,466,240.92

总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	254,285,272.61
减：应计利息总额	2,030,203.71
减：交易费用	8,102.50
买卖债券差价收入	1,142,662.10

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 2026年1月1日至2026年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	116,270.79
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	129,059.34
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	245,330.13

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	19,709,430.98
减：卖出资产支持证券成本总额	19,415,405.26
减：应计利息总额	164,966.38
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	129,059.34

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
国债期货投资收益	612,664.13

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	377,522.09
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	377,522.09

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	5,798,949.27
——股票投资	2,150,125.28
——债券投资	3,699,418.73
——资产支持证券投资	-50,594.74
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	433,600.00
——权证投资	-
——期货投资	433,600.00
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	6,232,549.27

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	19,140.75
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
港股通证券组合费	18.70
其他	600.00
合计	97,266.82

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、关联关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	871,815.28	1,599,271.52

其中：应支付销售机构的客户维护费	387,683.51	714,379.46
应支付基金管理人的净管理费	484,131.77	884,892.06

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	217,953.80	399,817.92

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券C	合计
易方达基金管理有限公司	-	306.72	306.72
平安银行	-	294,225.61	294,225.61
易方达财富	-	26.77	26.77
合计	-	294,559.10	294,559.10

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达悦安一年持有债券A	易方达悦安一年持有债券C	合计
易方达基金管理有限公司	-	335.01	335.01
平安银行	-	560,959.35	560,959.35
合计	-	561,294.36	561,294.36

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

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。

若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2026年1月1日至2026年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行	4,897,939.64	16,135,187.73	-	-	-	-
上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行	29,724,427.81	37,729,382.	-	-	-	-

		11				
--	--	----	--	--	--	--

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固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达悦安一年持有债券 A

无。

易方达悦安一年持有债券 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期存款	1,188,185.00	4,647.31	1,537,993.42	4,759.02

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
平安证券股份有限公司	920136	永励精密	新股发行	300	5,784.00
上年度可比期间					

2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：平安证券股份有限公司为本基金托管人平安银行股份有限公司的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达悦安一年持有债券 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达悦安一年持有债券 C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	1,500	15,165.00	15,165.00	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118070	南芯转债	2026-06-22	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.28	-
118071	华峰转债	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.04	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688121	卓然股份	2026-05-06	重大事项停牌	6.48	2026-07-07	5.18	6,249	65,591.80	40,493.52	-

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 2026 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 65,016,441.07 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
102381649	23 诚通控股 MTN001B	2026-07-01	114.27	100,000	11,427,200.00
102584121	25 华能新能 MTN004	2026-07-01	102.92	100,000	10,292,200.55
102680559	26 华远陆港 MTN001	2026-07-01	101.83	100,000	10,183,200.00
232580016	25 农行二级资本债 01A(BC)	2026-07-01	100.75	100,000	10,074,922.19
232580022	25 工行二级资本债 03BC	2026-07-01	102.28	127,000	12,989,614.97
232580017	25 农行二级资本债 01B(BC)	2026-07-06	99.94	50,000	4,997,221.92
232580026	25 建行二级资本债 02A(BC)	2026-07-06	102.50	92,000	9,429,995.46
232680007	26 兴业银行二级资本债 01	2026-07-06	100.71	17,000	1,712,133.25
合计				686,000	71,106,488.34

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 2026 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 23,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场

主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、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 101.07%(2025 年 12 月 31 日：108.49%)。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	15,253,119.46	27,341,406.03
合计	15,253,119.46	27,341,406.03

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企业发行的债券。

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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	217,910,009.32	185,312,662.74
AAA 以下	9,000.32	10,100,821.91
未评级	80,393,782.00	121,372,465.48
合计	298,312,791.64	316,785,950.13

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、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	19,534,979.42
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	19,534,979.42

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 2026年6月30日	上年度末 2025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 2026 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约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 2026 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	1,188,185.00	-	-	-	1,188,185.00
结算备付金	4,079,026.64	-	-	-	4,079,026.64
存出保证金	1,516,270.57	-	-	-	1,516,270.57
交易性金融资产	15,253,119.46	168,364,723.01	129,948,068.63	55,325,070.99	368,890,982.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,116,770.92	1,116,770.92

应收股利	-	-	-	4,649.87	4,649.87
应收申购款	-	-	-	96,279.37	96,279.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,036,601.67	168,364,723.01	129,948,068.63	56,542,771.15	376,892,164.46
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	88,016,441.07	-	-	-	88,016,441.07
应付清算款	-	-	-	193,201.48	193,201.48
应付赎回款	-	-	-	1,660,422.97	1,660,422.97
应付管理人报酬	-	-	-	141,745.27	141,745.27
应付托管费	-	-	-	35,436.30	35,436.30
应付销售服务费	-	-	-	48,080.23	48,080.23
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	13,562.85	13,562.85
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	278,193.20	278,193.20
负债总计	88,016,441.07	-	-	2,370,642.30	90,387,083.37
利率敏感度缺口	-65,979,839.40	168,364,723.01	129,948,068.63	54,172,128.85	286,505,081.09
上年度末 2025 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	1,205,640.90	-	-	-	1,205,640.90
结算备付金	3,443,834.30	-	-	-	3,443,834.30
存出保证金	51,724.32	-	-	-	51,724.32
交易性金融资产	27,341,406.03	241,584,369.55	94,736,560.00	65,847,586.19	429,509,921.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	997,645.24	997,645.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	144.93	144.93
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,042,605.55	241,584,369.55	94,736,560.00	66,845,376.36	435,208,911.46
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	114,010,214.16	-	-	-	114,010,214.16
应付清算款	-	-	-	5,549.44	5,549.44
应付赎回款	-	-	-	1,436,951.49	1,436,951.49
应付管理人报酬	-	-	-	165,905.75	165,905.75
应付托管费	-	-	-	41,476.45	41,476.45
应付销售服务费	-	-	-	57,043.12	57,043.12
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	14,251.66	14,251.66
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	131,029.02	131,029.02
负债总计	114,010,214.16	-	-	1,852,206.93	115,862,421.09
利率敏感度缺口	-81,967,608.61	241,584,369.55	94,736,560.00	64,993,169.43	319,346,490.37

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	4,318,938.12	3,472,074.28
	2.市场利率上升 25 个基点	-4,168,964.20	-3,399,953.04

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VaR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	55,325,070.99	19.31	65,847,586.19	20.62
交易性金融资产—债券投资	9,000.32	0.00	-	-
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	55,334,071.31	19.31	65,847,586.19	20.62

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	27,662,535.49	32,923,793.10
	2.业绩比较基准下降 5%	-27,662,535.49	-32,923,793.10

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	55,263,628.47
第二层次	313,627,353.62
第三层次	-
合计	368,890,982.09

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	55,325,070.99	14.68
	其中：股票	55,325,070.99	14.68

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	313,565,911.10	83.20
	其中：债券	313,565,911.10	83.20
	资产支持证券	-	-
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	5,267,211.64	1.40
8	其他各项资产	2,733,970.73	0.73
9	合计	376,892,164.46	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	611,590.00	0.21
C	制造业	45,788,301.01	15.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,165.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,023,272.50	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	2,344,941.00	0.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,571,164.48	0.55
J	金融业	1,108,328.00	0.39
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	2,157,129.00	0.75
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	705,180.00	0.25
	合计	55,325,070.99	19.31

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	688686	奥普特	10,239	1,724,145.21	0.60
2	300014	亿纬锂能	25,700	1,671,271.00	0.58
3	002975	博杰股份	11,100	1,576,200.00	0.55
4	600176	中国巨石	20,800	1,515,904.00	0.53
5	603259	药明康德	11,400	1,419,414.00	0.50
6	300666	江丰电子	3,700	1,363,820.00	0.48
7	688183	生益电子	10,298	1,363,455.20	0.48
8	601636	旗滨集团	130,600	1,336,038.00	0.47
9	002384	东山精密	4,900	1,285,515.00	0.45
10	600060	海信视像	43,100	1,201,197.00	0.42
11	688409	富创精密	3,864	1,183,350.00	0.41
12	300433	蓝思科技	20,900	1,121,494.00	0.39
13	002484	江海股份	9,800	1,029,000.00	0.36
14	000657	中钨高新	10,000	957,200.00	0.33
15	300201	海伦哲	44,600	939,722.00	0.33
16	601211	国泰海通	48,900	889,980.00	0.31
17	300475	香农芯创	2,900	870,000.00	0.30
18	002837	英维克	10,900	867,204.00	0.30
19	920186	中科仪	7,482	858,933.60	0.30
20	002643	万润股份	40,700	852,665.00	0.30
21	002422	科伦药业	21,700	835,884.00	0.29
22	002001	新和成	29,400	835,548.00	0.29
23	300943	春晖智控	18,400	827,080.00	0.29
24	300285	国瓷材料	7,700	794,486.00	0.28
25	300136	信维通信	6,500	775,125.00	0.27
26	601872	招商轮船	42,300	743,211.00	0.26
27	300759	康龙化成	25,500	737,715.00	0.26
28	301018	申菱环境	6,200	716,782.00	0.25
29	603380	易德龙	15,800	712,422.00	0.25
30	600673	东阳光	21,000	705,180.00	0.25
31	300408	三环集团	4,000	667,600.00	0.23
32	301321	翰博高新	14,700	649,005.00	0.23
33	300308	中际旭创	500	635,000.00	0.22
34	002080	中材科技	6,900	621,000.00	0.22

35	002025	航天电器	8,003	609,988.66	0.21
36	688531	日联科技	3,132	556,994.88	0.19
37	601816	京沪高铁	120,400	545,412.00	0.19
38	301205	联特科技	1,600	534,560.00	0.19
39	601333	广深铁路	191,500	526,625.00	0.18
40	600346	恒力石化	29,500	522,445.00	0.18
41	603605	珀莱雅	8,600	515,312.00	0.18
42	002353	杰瑞股份	3,300	503,250.00	0.18
43	002821	凯莱英	3,100	502,200.00	0.18
44	600801	华新建材	31,300	488,280.00	0.17
45	000426	兴业银锡	14,000	461,440.00	0.16
46	002475	立讯精密	5,800	408,320.00	0.14
47	300976	达瑞电子	4,580	364,797.00	0.13
48	688200	华峰测控	645	338,689.50	0.12
49	688352	顾中科技	13,809	333,901.62	0.12
50	688521	芯原股份	864	320,664.96	0.11
51	301151	冠龙节能	17,700	292,050.00	0.10
52	688361	中科飞测	667	286,810.00	0.10
53	603811	诚意药业	36,120	271,622.40	0.09
54	688008	澜起科技	855	264,964.50	0.09
55	603062	麦加芯彩	6,300	252,945.00	0.09
56	000811	冰轮环境	4,300	241,746.00	0.08
57	603256	宏和科技	900	238,797.00	0.08
58	600549	厦门钨业	2,800	238,560.00	0.08
59	600522	中天科技	3,900	236,652.00	0.08
60	300502	新易盛	380	230,660.00	0.08
61	600732	爱旭股份	15,900	220,215.00	0.08
62	000938	紫光股份	7,600	219,336.00	0.08
63	600030	中信证券	7,600	218,348.00	0.08
64	603659	璞泰来	7,400	214,082.00	0.07
65	002957	科瑞技术	3,900	213,876.00	0.07
66	300432	富临精工	10,300	206,927.00	0.07
67	600160	巨化股份	3,800	201,438.00	0.07
68	002126	银轮股份	4,000	199,200.00	0.07
69	601233	桐昆股份	9,200	199,180.00	0.07
70	301396	宏景科技	600	198,960.00	0.07
71	002463	沪电股份	1,300	198,640.00	0.07
72	600004	白云机场	27,300	198,198.00	0.07
73	688313	仕佳光子	1,017	187,789.05	0.07
74	601138	工业富联	2,600	187,590.00	0.07
75	002245	蔚蓝锂芯	9,800	183,358.00	0.06
76	002595	豪迈科技	3,900	181,740.00	0.06
77	603308	应流股份	3,000	181,200.00	0.06
78	300866	安克创新	1,700	177,650.00	0.06

79	000729	燕京啤酒	17,500	177,275.00	0.06
80	603733	仙鹤股份	6,500	175,565.00	0.06
81	688775	影石创新	1,255	174,005.75	0.06
82	600690	海尔智家	8,500	173,485.00	0.06
83	600026	中远海能	9,600	172,224.00	0.06
84	300857	协创数据	500	169,950.00	0.06
85	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.06
86	601975	招商南油	42,700	159,271.00	0.06
87	300319	麦捷科技	5,300	157,039.00	0.05
88	688519	南亚新材	408	155,056.32	0.05
89	600487	亨通光电	1,400	153,076.00	0.05
90	000603	盛达资源	6,500	150,150.00	0.05
91	000338	潍柴动力	5,500	149,875.00	0.05
92	002735	王子新材	8,900	144,447.00	0.05
93	300737	科顺股份	20,400	134,028.00	0.05
94	300566	激智科技	3,500	129,325.00	0.05
95	301328	维峰电子	1,740	123,888.00	0.04
96	300613	富瀚微	1,500	120,120.00	0.04
97	688127	蓝特光学	1,228	119,852.80	0.04
98	688689	银河微电	1,800	116,496.00	0.04
99	002106	莱宝高科	6,000	105,120.00	0.04
100	688484	南芯科技	1,812	102,359.88	0.04
101	301379	天山电子	3,500	99,540.00	0.03
102	688403	汇成股份	2,463	97,781.10	0.03
103	688720	艾森股份	839	84,739.00	0.03
104	688550	瑞联新材	1,446	83,651.10	0.03
105	002925	盈趣科技	3,300	81,378.00	0.03
106	300590	移为通信	5,500	78,925.00	0.03
107	301577	美信科技	1,000	77,540.00	0.03
108	300481	濮阳惠成	4,000	76,080.00	0.03
109	301303	真兰仪表	4,300	73,745.00	0.03
110	002138	顺络电子	1,000	73,100.00	0.03
111	688798	艾为电子	956	70,093.92	0.02
112	688657	浩辰软件	1,851	66,210.27	0.02
113	688338	赛科希德	2,236	65,984.36	0.02
114	688591	泰凌微	1,905	65,493.90	0.02
115	001308	康冠科技	3,100	64,666.00	0.02
116	301106	骏成科技	3,080	63,879.20	0.02
117	300482	万孚生物	3,700	61,457.00	0.02
118	002396	星网锐捷	3,200	61,344.00	0.02
119	300193	佳士科技	7,500	61,050.00	0.02
120	002332	仙琚制药	7,500	60,450.00	0.02
121	688581	安杰思	1,142	59,052.82	0.02
122	000650	仁和药业	11,600	59,044.00	0.02

123	300406	九强生物	5,400	59,022.00	0.02
124	002609	捷顺科技	7,700	58,674.00	0.02
125	002111	威海广泰	6,500	58,500.00	0.02
126	002881	美格智能	1,600	58,304.00	0.02
127	688592	司南导航	1,396	57,850.24	0.02
128	300833	浩洋股份	1,900	57,342.00	0.02
129	300784	利安科技	1,300	55,081.00	0.02
130	300768	迪普科技	4,000	55,080.00	0.02
131	301195	北路智控	2,000	54,200.00	0.02
132	301208	中亦科技	1,900	54,131.00	0.02
133	301202	朗威股份	1,600	53,328.00	0.02
134	300847	中船汉光	4,100	53,054.00	0.02
135	301380	挖金客	1,900	52,421.00	0.02
136	002376	新北洋	9,100	52,325.00	0.02
137	688569	铁科轨道	3,236	52,261.40	0.02
138	300578	会畅科技	3,000	52,170.00	0.02
139	301185	鸥玛软件	3,500	52,010.00	0.02
140	000028	国药一致	2,750	52,002.50	0.02
141	688526	科前生物	4,266	51,618.60	0.02
142	002268	电科网安	4,000	51,600.00	0.02
143	002758	浙农股份	6,500	51,350.00	0.02
144	301491	汉桑科技	1,300	51,051.00	0.02
145	688439	振华风光	1,103	50,958.60	0.02
146	300925	法本信息	3,400	50,286.00	0.02
147	301339	通行宝	4,900	50,127.00	0.02
148	002441	众业达	6,400	49,920.00	0.02
149	688366	昊海生科	1,717	49,569.79	0.02
150	301503	智迪科技	1,800	49,518.00	0.02
151	002139	拓邦股份	5,200	49,504.00	0.02
152	300787	海能实业	5,400	49,248.00	0.02
153	300772	运达股份	4,000	49,200.00	0.02
154	301318	维海德	2,400	48,960.00	0.02
155	000703	恒逸石化	3,600	48,852.00	0.02
156	301359	东南电子	3,000	47,640.00	0.02
157	688579	地纬智能	6,243	47,384.37	0.02
158	688283	坤恒顺维	1,422	47,082.42	0.02
159	002777	久远银海	3,900	46,917.00	0.02
160	300525	博思软件	6,300	46,872.00	0.02
161	301006	迈拓股份	3,700	46,435.00	0.02
162	300638	广和通	2,500	46,275.00	0.02
163	300036	超图软件	4,100	46,207.00	0.02
164	301258	富士莱	2,000	45,540.00	0.02
165	000403	派林生物	5,100	44,829.00	0.02
166	002649	博彦科技	5,500	44,770.00	0.02

167	301589	诺瓦星云	300	44,694.00	0.02
168	688330	宏力达	1,283	43,403.89	0.02
169	000821	ST 京机	5,600	42,280.00	0.01
170	688121	卓然股份	6,249	40,493.52	0.01
171	688606	奥泰生物	868	35,657.44	0.01
172	002028	思源电气	200	34,600.00	0.01
173	603678	火炬电子	400	33,200.00	0.01
174	001248	华润新能源	1,500	15,165.00	0.01
175	600089	特变电工	300	6,750.00	0.00
176	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
177	688377	迪威尔	64	1,509.12	0.00
178	920522	纳科诺尔	43	1,019.10	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	600346	恒力石化	4,065,381.00	1.27
2	002422	科伦药业	2,909,155.84	0.91
3	300358	楚天科技	2,817,469.00	0.88
4	603083	剑桥科技	2,705,222.00	0.85
5	002078	太阳纸业	2,614,776.00	0.82
6	002837	英维克	2,507,596.50	0.79
7	600176	中国巨石	2,501,487.00	0.78
8	300432	富临精工	2,438,190.00	0.76
9	688686	奥普特	2,328,628.94	0.73
10	002384	东山精密	2,268,237.00	0.71
11	300731	科创新源	2,256,812.00	0.71
12	300014	亿纬锂能	2,240,329.00	0.70
13	601872	招商轮船	2,172,471.00	0.68
14	002371	北方华创	2,162,420.00	0.68
15	600469	风神股份	2,120,116.00	0.66
16	002353	杰瑞股份	2,111,861.00	0.66
17	300666	江丰电子	1,992,314.00	0.62
18	301205	联特科技	1,894,648.00	0.59
19	002961	瑞达期货	1,893,089.00	0.59
20	603259	药明康德	1,892,154.00	0.59

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				净值比例（%）
1	600346	恒力石化	3,475,537.00	1.09
2	603083	剑桥科技	3,428,339.00	1.07
3	002371	北方华创	2,800,623.00	0.88
4	300358	楚天科技	2,662,243.00	0.83
5	301396	宏景科技	2,641,076.00	0.83
6	300432	富临精工	2,633,890.00	0.82
7	688813	泰金新能	2,482,668.47	0.78
8	002078	太阳纸业	2,462,664.00	0.77
9	300731	科创新源	2,377,240.80	0.74
10	603678	火炬电子	2,258,901.00	0.71
11	688008	澜起科技	2,257,712.29	0.71
12	300274	阳光电源	2,194,197.00	0.69
13	600469	风神股份	2,150,591.00	0.67
14	002422	科伦药业	2,066,767.00	0.65
15	301013	利和兴	2,014,902.00	0.63
16	600230	沧州大化	1,985,891.00	0.62
17	688361	中科飞测	1,970,880.19	0.62
18	688596	正帆科技	1,924,406.47	0.60
19	600176	中国巨石	1,905,677.00	0.60
20	688002	睿创微纳	1,905,375.95	0.60

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	325,253,058.79
卖出股票收入（成交）总额	352,388,794.57

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	8,733,373.52	3.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	101,594,373.16	35.46
	其中：政策性金融债	15,253,119.46	5.32
4	企业债券	78,268,132.59	27.32

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	124,961,031.51	43.62
7	可转债（可交换债）	9,000.32	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	313,565,911.10	109.45

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	232580026	25 建行二 级资本债 02A(BC)	150,000	15,374,992.60	5.37
2	232580022	25 工行二 级资本债 03BC	150,000	15,342,064.93	5.35
3	220203	22 国开 03	120,000	12,215,046.58	4.26
4	2380173	23 铁道 10	100,000	11,759,477.26	4.10
5	102381649	23 诚通控 股 MTN001B	100,000	11,427,200.00	3.99

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的进行国债期货投资，主要选择流动性好的国债期货品种进行交易，调节组合的久期水平和期限结构。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金根据风险管理原则，以套期保值为主要目的进行国债期货投资，选择流动性好的国债期货品种进行交易，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。

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，国家开发银行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、中国人民银行的处罚。中国工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、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。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、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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	1,516,270.57
2	应收清算款	1,116,770.92
3	应收股利	4,649.87
4	应收利息	-
5	应收申购款	96,279.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,733,970.73

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达悦安一年持有债券 A	2,408	50,087.73	203,661.93	0.17%	120,407,598.42	99.83%
易方达悦安一年持有债券 C	2,251	57,038.91	0.00	0.00%	128,394,583.39	100.00%
合计	4,659	53,446.20	203,661.93	0.08%	248,802,181.81	99.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达悦安一年持有债券 A	2,782,206.21	2.3068%
	易方达悦安一年持有债券 C	0.99	0.0000%
	合计	2,782,207.20	1.1173%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达悦安一年持有债券 A	>100
	易方达悦安一年持有债券 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达悦安一年持有债券 A	0
	易方达悦安一年持有债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达悦安一年持有债券 A	易方达悦安一年持有债券 C
基金合同生效日（2021 年 4 月 6 日）基金份额总额	6,367,393,958.47	7,672,236,262.50
本报告期期初基金份额总额	143,487,238.92	157,431,258.55
本报告期基金总申购份额	7,792,112.75	1,592,003.30
减：本报告期基金总赎回份额	30,668,091.32	30,628,678.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	120,611,260.35	128,394,583.39

§ 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 2026 年 1 月 5 日发布公告，自 2026 年 1 月 3 日起高松凡先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	2	130,977,275.18	19.33%	57,106.34	19.37%	-
国泰海通	1	205,026,766.39	30.26%	89,393.93	30.33%	-
华创证券	1	9,681,551.01	1.43%	3,533.79	1.20%	-
浙商证券	1	331,903,939.78	48.98%	144,710.00	49.10%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 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 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券	15,375,310.00	13.21%	60,744,000.00	3.27%	-	-
国泰海通	35,111,315.00	30.16%	96,003,000.00	5.17%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	65,925,466.0	56.63%	1,699,700,	91.56%	-	-

	0		000.00			
--	---	--	--------	--	--	--

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高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
3	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-15
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-01-22
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
6	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-21
7	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
8	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报	2026-03-31
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-04-22
11	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
12	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
13	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
14	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23

15	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-27
----	----------------------------	-----------------------------	------------

§ 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§ 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悦安一年持有期债券型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

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

二〇二六年八月三十一日