

易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金

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	易方达恒盛 3 个月定开混合发起式
基金主代码	007884
交易代码	007884
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 6 日
报告期末基金份额总额	1,734,130,909.28 份
投资目标	在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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。封闭期本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场因素、估值及流动性因素、政策因素等分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。债券投资上主要通过久期配置、

	<p>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。股票方面本基金将通过分析行业景气度、行业竞争格局等因素，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置的基础上，本基金将基于公司基本面分析和估值水平分析进行个股投资策略。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。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。</p>
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§ 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)
1.本期已实现收益	33,770,936.82
2.本期利润	35,849,078.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0207
4.期末基金资产净值	1,959,293,902.55

5.期末基金份额净值	1.1298
------------	--------

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

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	1.86%	0.33%	2.40%	0.13%	-0.54%	0.20%
过去六个月	3.72%	0.27%	3.79%	0.11%	-0.07%	0.16%
过去一年	6.97%	0.23%	6.57%	0.10%	0.40%	0.13%
过去三年	13.67%	0.22%	11.43%	0.11%	2.24%	0.11%
过去五年	34.36%	0.20%	23.14%	0.12%	11.22%	0.08%
自基金合同生效起至今	34.10%	0.20%	22.82%	0.12%	11.28%	0.08%

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

易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金
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

（2019年9月6日至2024年9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 34.10%，同期业绩比较基准收益率为 22.82%。

§ 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		
胡剑	本基金的基金经理，易方达稳健收益债券、易方达裕惠定开混合发起式、易方达岁丰添利债券（LOF）、易方达恒利3个月定开债券发起式（自2019年04月04日至2024年09月20日）、易方达恒益定开债券发起式（自2019年07月12日至2024年09月20日）、易方达恒信定开债券发起式（自2021年06月30日至2024年09月20日）、易方达	2019-09-06	-	18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债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、固定收益投资业务总部总经理，易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达纯债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达信用债债券、易方达纯债1年定期开放债券、易方达裕惠回报债

	高等级信用债债券、易方达瑞财混合的基金经理，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、基础设施资产管理委员会委员				券、易方达瑞财混合、易方达裕景添利6个月定期开放债券、易方达高等级信用债债券、易方达丰惠混合、易方达瑞富混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合、易方达3年封闭战略配售混合（LOF）、易方达富惠纯债债券、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、易方达恒惠定开债券发起式、易方达科润混合（LOF）的基金经理。
纪玲云	本基金的基金经理，易方达信用债债券、易方达瑞财混合（自2019年01月11日至2024年09月20日）、易方达恒利3个月定开债券发起式、易方达恒裕一年定开债券发起式、易方达裕华利率债3个月定开债券（自2021年11月26日至2024年07月19日）、易方达裕兴3个月定开债券（自2022年02月28日至2024年07月19日）、易方达恒固18个月封闭式债券、易方达兴利180天持有债券的基金经理，易方达稳健收益债券的基金经理助理，固定收益分类资产管理部总经理	2019-09-06	-	15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、投资经理助理、固定收益研究部总经理助理、固定收益分类资产管理部负责人、投资经理，易方达3年封闭战略配售混合（LOF）、易方达科润混合（LOF）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了需求相对不足的情况。固定资产投资持续受到地产行业的拖累，基建和制造业投资的回升持续性不强，而消费端自6月份开始显现出加速回落的迹象，这使得市场对基本面走势的悲观预期有所加强。出口数据依然保持在高位，但随着全球制造业周期的回落，电子周期有见顶迹象，后续出口数据回落的可能性在增加。生产方面，工业增加值的增长也略显疲弱，显示企业在产销率走低、价格疲软的环境里生产动能有所减弱。

政策面在三季度进行了积极的调整，带动资本市场波动加大。在经济持续走弱的大背景下，债券市场利率在三季度大部分时间呈现震荡下行的走势，10年期国债收益率自三季度以来截至9月23日下行至2.04%，创历史新低。8月上旬央

行对长期限国债的关注带来债券市场的回调，10年国债日间利率波动一度接近10BP，之后随着经济基本面预期的下行而重回下行通道。另一个更加重要的政策调整是在9月最后一周，决策层公布了一揽子的大力度宽松政策，包含降息、降准、降低存量房贷利率、支持收购房企存量土地、创设新型货币政策工具支持股市等一系列支持实体经济以及股市、房市的政策措施。上述政策的发布在极短时间内迅速扭转了资本市场的风险偏好，股票市场大幅上涨，沪深300指数连续5个工作日累计涨幅约23%，同期10年国债收益率上升11BP，而国庆期间房地产市场也出现一定程度的回暖。未来随着相关政策的持续推出，我们预计经济基本面有望出现企稳回升的局面。

今年以来债券市场收益率整体震荡下行，债券组合的持有期收益中包含了较多的资本利得收益，这使得债券基金的年化收益水平较难在未来持续。从市场指数来看，中债综合财富指数截至9月底的收益率为4.69%，其中票息收益贡献了1.82%，资本利得收益贡献了2.87%；中债优选投资级财富指数的收益率为3.35%，其中票息收益贡献了1.84%，资本利得收益贡献了1.51%。资本利得收益波动性相对较大，建议投资者理性看待债券基金的投资收益。

操作上，组合积极进行债券结构调整，持续降低信用债券仓位和信用利差久期，替换为利率久期，总久期水平先升后降，在出现政策转向后积极降低组合总久期至基准以下。权益方面组合保持了中性的股票和较高的可转债仓位，在9月最后一周的反弹行情中获得了较好的收益增厚。总体看本组合在三季度积极进行总量和结构层面的调整，既把握了部分利率下行带来的资本利得收益，保持了较好的灵活性，降低了信用利差扩大带来的损失，同时保留偏高的转债仓位获取了较好的收益弹性，组合净值在三季度总体获得了较好的投资回报。

4.5 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1.1298元，本报告期份额净值增长率为1.86%，同期业绩比较基准收益率为2.40%。

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	177,937,389.59	7.38
	其中：股票	177,937,389.59	7.38
2	固定收益投资	2,199,994,435.78	91.28
	其中：债券	2,122,408,956.37	88.06
	资产支持证券	77,585,479.41	3.22
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	13,812,862.19	0.57
7	其他资产	18,395,128.32	0.76
8	合计	2,410,139,815.88	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	4,340,728.92	0.22
B	采矿业	6,274,040.00	0.32
C	制造业	122,500,796.42	6.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,691,220.00	0.09
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	21,544,295.00	1.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,077,055.45	0.36
J	金融业	806,344.00	0.04
K	房地产业	1,945,132.00	0.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,738,706.52	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	19,071.28	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	177,937,389.59	9.08

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	002472	双环传动	471,400	12,991,784.00	0.66
2	300347	泰格医药	132,200	9,120,478.00	0.47
3	600660	福耀玻璃	154,600	8,997,720.00	0.46
4	600150	中国船舶	174,796	7,301,228.92	0.37
5	600873	梅花生物	665,300	7,251,770.00	0.37
6	601088	中国神华	143,900	6,274,040.00	0.32
7	603596	伯特利	126,980	6,211,861.60	0.32
8	002920	德赛西威	47,100	5,642,109.00	0.29
9	300760	迈瑞医疗	18,900	5,537,700.00	0.28
10	603806	福斯特	308,638	5,450,547.08	0.28

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	476,379,463.69	24.31

2	央行票据	-	-
3	金融债券	480,609,664.57	24.53
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	116,423,832.43	5.94
5	企业短期融资券	71,539,408.08	3.65
6	中期票据	564,411,825.04	28.81
7	可转债（可交换债）	413,044,762.56	21.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,122,408,956.37	108.33

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	240006	24 付息国 债 06	2,000,000	204,953,698.63	10.46
2	2400002	24 特别国 债 02	1,400,000	144,413,994.57	7.37
3	230023	23 付息国 债 23	1,100,000	127,011,770.49	6.48
4	23248005 2	24 浦发银 行二级资 本债 01A	1,000,000	98,698,783.56	5.04
5	23248000 4	24 农行二 级资本债 01A	800,000	82,532,642.62	4.21

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	199272	23 北辰 A	200,000	20,617,041.10	1.05
2	199311	23 即墨	150,000	15,582,801.37	0.80

		A2			
3	144164	24 光水 07	110,000	11,011,334.52	0.56
4	260418	G 黄河优	100,000	10,188,466.80	0.52
5	199430	23 济建优	100,000	10,116,054.80	0.52
6	262283	汴二 05 优	100,000	10,069,780.82	0.51

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，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。苏州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江苏监管局的处罚。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。

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	102,346.80
2	应收证券清算款	18,292,781.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	18,395,128.32

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	123194	百洋转债	10,624,129.46	0.54
2	123220	易瑞转债	8,100,142.80	0.41
3	123188	水羊转债	6,726,557.37	0.34
4	123107	温氏转债	6,454,918.62	0.33
5	111000	起帆转债	6,339,871.13	0.32
6	113632	鹤21转债	6,313,980.09	0.32
7	113069	博23转债	6,305,146.25	0.32
8	127045	牧原转债	6,300,367.28	0.32
9	127103	东南转债	6,226,093.55	0.32
10	123196	正元转02	6,107,863.70	0.31
11	111018	华康转债	6,050,739.32	0.31
12	118037	上声转债	5,801,741.37	0.30
13	123119	康泰转2	5,770,938.35	0.29
14	123171	共同转债	5,664,005.90	0.29
15	127049	希望转2	5,388,803.55	0.28
16	110090	爱迪转债	5,175,538.67	0.26
17	128132	交建转债	5,059,908.25	0.26
18	110094	众和转债	4,972,939.93	0.25
19	113051	节能转债	4,841,403.27	0.25
20	127086	恒邦转债	4,454,041.80	0.23
21	127082	亚科转债	4,373,119.96	0.22
22	128081	海亮转债	4,265,582.05	0.22
23	123185	能辉转债	4,228,379.06	0.22
24	127101	豪鹏转债	4,070,718.94	0.21
25	118030	睿创转债	4,027,180.87	0.21
26	113649	丰山转债	3,979,693.68	0.20
27	113651	松霖转债	3,839,565.60	0.20
28	123190	道氏转02	3,733,980.55	0.19
29	118003	华兴转债	3,731,858.96	0.19
30	113030	东风转债	3,604,418.85	0.18
31	123035	利德转债	3,589,968.14	0.18

32	123052	飞鹿转债	3,545,541.16	0.18
33	123158	宙邦转债	3,433,381.16	0.18
34	128144	利民转债	3,417,459.99	0.17
35	123078	飞凯转债	3,412,384.10	0.17
36	128049	华源转债	3,403,364.67	0.17
37	127040	国泰转债	3,373,868.94	0.17
38	113574	华体转债	3,351,360.61	0.17
39	123237	佳禾转债	3,332,055.28	0.17
40	110093	神马转债	3,291,437.10	0.17
41	113039	嘉泽转债	3,283,592.31	0.17
42	123101	拓斯转债	3,242,478.38	0.17
43	123228	震裕转债	3,230,023.89	0.16
44	118031	天23转债	3,220,725.50	0.16
45	127054	双箭转债	3,204,186.65	0.16
46	128063	未来转债	3,203,379.78	0.16
47	128143	锋龙转债	3,075,605.50	0.16
48	123150	九强转债	3,052,150.38	0.16
49	128070	智能转债	3,049,813.14	0.16
50	113577	春秋转债	3,032,958.17	0.15
51	113673	岱美转债	2,998,852.22	0.15
52	113664	大元转债	2,995,952.11	0.15
53	113648	巨星转债	2,942,837.05	0.15
54	113058	友发转债	2,814,231.69	0.14
55	118043	福立转债	2,775,236.71	0.14
56	123130	设研转债	2,727,030.23	0.14
57	110095	双良转债	2,715,307.57	0.14
58	123212	立中转债	2,707,253.79	0.14
59	127055	精装转债	2,661,982.97	0.14
60	128066	亚泰转债	2,657,435.55	0.14
61	123222	博俊转债	2,632,838.79	0.13
62	123120	隆华转债	2,577,141.64	0.13
63	123187	超达转债	2,549,727.67	0.13
64	123072	乐歌转债	2,542,388.67	0.13
65	113676	荣23转债	2,487,933.51	0.13
66	123217	富仕转债	2,484,237.51	0.13
67	123224	宇邦转债	2,483,471.40	0.13
68	127099	盛航转债	2,451,129.01	0.13
69	127088	赫达转债	2,420,988.31	0.12
70	113675	新23转债	2,401,890.45	0.12
71	123087	明电转债	2,395,850.45	0.12
72	118012	微芯转债	2,369,315.93	0.12
73	123145	药石转债	2,361,215.86	0.12
74	113656	嘉诚转债	2,343,660.44	0.12

75	127081	中旗转债	2,332,302.13	0.12
76	123050	聚飞转债	2,299,645.10	0.12
77	127052	西子转债	2,293,670.23	0.12
78	123138	丝路转债	2,280,440.54	0.12
79	123240	楚天转债	2,268,367.19	0.12
80	123232	金现转债	2,264,497.31	0.12
81	123184	天阳转债	2,225,831.39	0.11
82	118013	道通转债	2,209,055.65	0.11
83	127061	美锦转债	2,167,255.89	0.11
84	123200	海泰转债	2,151,062.16	0.11
85	111002	特纸转债	2,135,247.37	0.11
86	123202	祥源转债	2,109,754.49	0.11
87	127075	百川转2	2,074,865.89	0.11
88	123191	智尚转债	2,052,389.63	0.10
89	123063	大禹转债	2,027,877.78	0.10
90	127076	中宠转2	2,007,543.32	0.10
91	127042	嘉美转债	1,997,701.88	0.10
92	128130	景兴转债	1,965,511.36	0.10
93	123146	中环转2	1,919,773.18	0.10
94	123229	艾录转债	1,910,335.58	0.10
95	128141	旺能转债	1,908,101.17	0.10
96	123172	漱玉转债	1,881,471.70	0.10
97	118029	富淼转债	1,874,644.08	0.10
98	123160	泰福转债	1,853,486.87	0.09
99	113640	苏利转债	1,817,696.08	0.09
100	111009	盛泰转债	1,795,375.34	0.09
101	123092	天壕转债	1,731,070.08	0.09
102	113628	晨丰转债	1,711,369.86	0.09
103	128128	齐翔转2	1,623,090.49	0.08
104	123216	科顺转债	1,611,422.24	0.08
105	127027	能化转债	1,595,402.16	0.08
106	127068	顺博转债	1,583,279.73	0.08
107	123048	应急转债	1,551,688.95	0.08
108	123227	雅创转债	1,542,004.61	0.08
109	111008	沿浦转债	1,435,727.93	0.07
110	111013	新港转债	1,418,033.34	0.07
111	111015	东亚转债	1,412,730.42	0.07
112	113597	佳力转债	1,406,608.77	0.07
113	127100	神码转债	1,396,042.68	0.07
114	118011	银微转债	1,364,802.11	0.07
115	123219	宇瞳转债	1,291,390.10	0.07
116	123173	恒锋转债	1,270,684.88	0.06
117	127051	博杰转债	1,167,139.86	0.06

118	128083	新北转债	1,164,641.92	0.06
119	123211	阳谷转债	1,094,666.52	0.06
120	113668	鹿山转债	1,090,271.48	0.06
121	127069	小熊转债	1,022,896.33	0.05
122	113629	泉峰转债	1,021,335.57	0.05
123	123213	天源转债	1,000,017.54	0.05
124	113549	白电转债	991,054.97	0.05
125	123235	亿田转债	896,412.15	0.05
126	110081	闻泰转债	874,207.44	0.04
127	123162	东杰转债	844,870.48	0.04
128	127015	希望转债	829,442.74	0.04
129	123147	中辰转债	712,089.11	0.04
130	127043	川恒转债	640,768.82	0.03
131	123233	凯盛转债	613,183.88	0.03
132	123193	海能转债	601,498.73	0.03
133	113627	太平转债	580,463.54	0.03
134	123204	金丹转债	579,468.36	0.03
135	123149	通裕转债	570,221.94	0.03
136	127091	科数转债	568,439.85	0.03
137	127078	优彩转债	566,179.70	0.03
138	113665	汇通转债	550,361.22	0.03
139	123186	志特转债	543,583.90	0.03
140	127071	天箭转债	515,067.94	0.03
141	123163	金沃转债	449,976.83	0.02
142	113637	华翔转债	447,429.38	0.02
143	127053	豪美转债	447,092.59	0.02
144	118038	金宏转债	434,655.69	0.02
145	118040	宏微转债	416,220.44	0.02
146	127035	濮耐转债	393,145.27	0.02
147	127070	大中转债	359,262.28	0.02
148	123178	花园转债	353,488.44	0.02
149	123152	润禾转债	331,113.81	0.02
150	113068	金铜转债	318,886.11	0.02
151	118020	芳源转债	312,959.97	0.02
152	127039	北港转债	305,169.58	0.02
153	128120	联诚转债	217,874.81	0.01
154	123144	裕兴转债	216,583.70	0.01
155	111005	富春转债	210,155.73	0.01
156	127087	星帅转2	202,951.17	0.01
157	113679	芯能转债	202,455.38	0.01
158	113663	新化转债	181,158.54	0.01
159	123175	百畅转债	177,514.72	0.01
160	123085	万顺转2	162,939.76	0.01

161	118036	力合转债	143,751.87	0.01
162	123170	南电转债	84,321.65	0.00
163	128090	汽模转2	64,468.85	0.00
164	123166	蒙泰转债	62,683.86	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

报告期期初基金份额总额	1,734,130,909.28
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	1,734,130,909.28

§ 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 报告期末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	0.5767%	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	0.5767%	-

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 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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07月01日~2024年09月30日	1,071,522,408.48	0.00	0.00	1,071,522,408.48	61.79%
	2	2024年07月01日~2024年09月30日	659,608,304.15	0.00	0.00	659,608,304.15	38.04%

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部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，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；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，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权终止基金合同；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。

9.2 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未赎回基金份额，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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金注册的文件；

2.《易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3.《易方达恒盛3个月定期开放混合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。

10.2 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。

10.3 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