

# 易方达丰和债券型证券投资基金

## 2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 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：二〇二五年一月二十一日

## § 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 2025 年 1 月 17 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 易方达丰和债券   |
| 基金主代码      | 002969  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2016 年 11 月 23 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 3,168,520,803.47 份  |
| 投资目标       | 本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，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       | 1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。<br>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 |

|                 |   |                         |
|-----------------|---|-------------------------|
|                 | <p>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，通过杠杆操作放大组合收益。3、本基金将适度参与股票资产投资。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、本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，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,以对冲投资组合的系统性风险。</p> |                         |
| 业绩比较基准          | <p>沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%</p>   |                         |
| 风险收益特征          | <p>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。</p>  |                         |
| 基金管理人           | <p>易方达基金管理有限公司</p>  |                         |
| 基金托管人           | <p>中国银行股份有限公司</p>   |                         |
| 下属分级基金的基金简称     | <p>易方达丰和债券 A</p>  | <p>易方达丰和债券 C</p>        |
| 下属分级基金的交易代码     | <p>002969</p>   | <p>016699</p>           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | <p>2,994,968,858.40 份</p>   | <p>173,551,945.07 份</p> |

注：自 2022 年 9 月 28 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 9 月 29 日。

## § 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<br>(2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日) |                |
|----------------|---|----------------|
|                | 易方达丰和债券 A                                 | 易方达丰和债券 C      |
| 1.本期已实现收益      | 13,920,451.92                             | 443,024.75     |
| 2.本期利润         | 96,561,747.52                             | 4,592,351.86   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0287                                    | 0.0326         |
| 4.期末基金资产净值     | 4,219,882,335.04                          | 242,309,565.54 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.4090                                    | 1.3962         |

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

## 易方达丰和债券 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    | 2.23%  | 0.37%     | 2.03%      | 0.26%         | 0.20%  | 0.11% |
| 过去六个月    | 5.09%  | 0.35%     | 5.20%      | 0.23%         | -0.11% | 0.12% |
| 过去一年     | 7.66%  | 0.29%     | 8.57%      | 0.19%         | -0.91% | 0.10% |
| 过去三年     | 3.54%  | 0.26%     | 9.96%      | 0.17%         | -6.42% | 0.09% |
| 过去五年     | 21.84% | 0.30%     | 21.17%     | 0.18%         | 0.67%  | 0.12% |
| 自基金合同生效起 | 52.31% | 0.29%     | 36.76%     | 0.18%         | 15.55% | 0.11% |

|    |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 至今 |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|

易方达丰和债券 C

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 2.13%  | 0.37%     | 2.03%      | 0.26%         | 0.10%  | 0.11% |
| 过去六个月      | 4.88%  | 0.35%     | 5.20%      | 0.23%         | -0.32% | 0.12% |
| 过去一年       | 7.24%  | 0.29%     | 8.57%      | 0.19%         | -1.33% | 0.10% |
| 过去三年       | -      | -         | -          | -             | -      | -     |
| 过去五年       | -      | -         | -          | -             | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 6.64%  | 0.25%     | 10.98%     | 0.16%         | -4.34% | 0.09% |

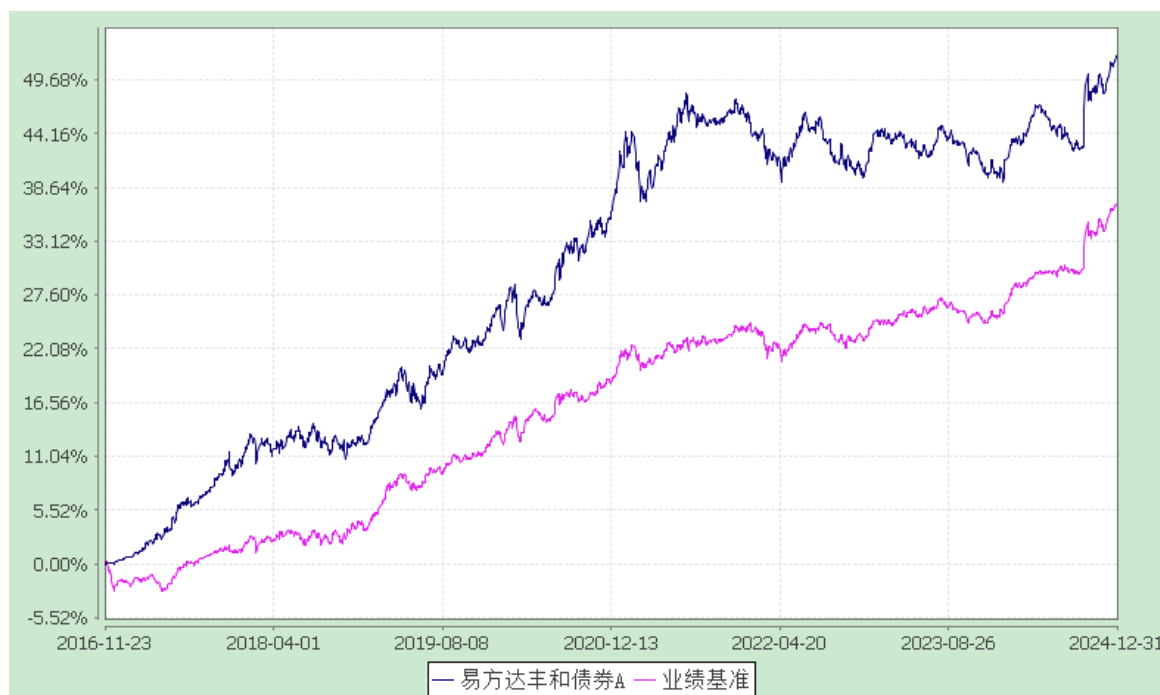
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达丰和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

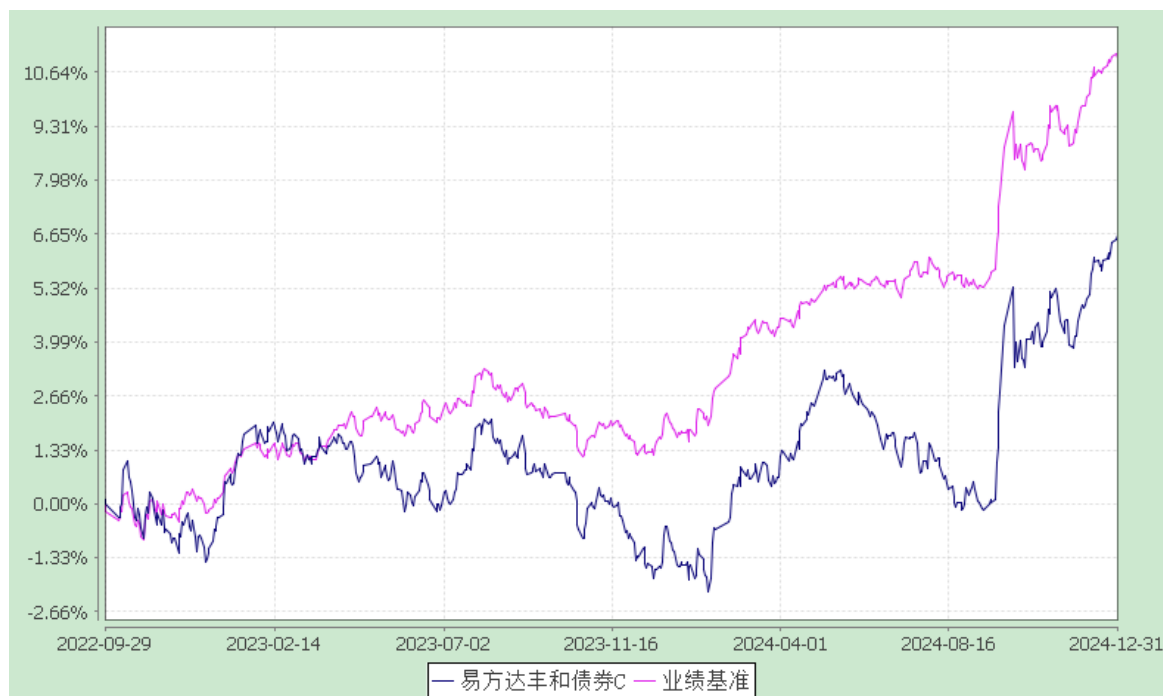
易方达丰和债券 A

(2016 年 11 月 23 日至 2024 年 12 月 31 日)



## 易方达丰和债券 C

(2022 年 9 月 29 日至 2024 年 12 月 31 日)



注: 1. 自 2022 年 9 月 28 日起, 本基金增设 C 类份额类别, 份额首次确认日为 2022 年 9 月 29 日, 增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2. 自基金合同生效至报告期末, A 类基金份额净值增长率为 52.31%, 同期业绩比较基准收益率为 36.76%; C 类基金份额净值增长率为 6.64%, 同期业绩比较基准收益率为 10.98%。

## § 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, 易方达安心回报债券、易方达裕丰回报债券、易方达安盈回报混合、易方达新收益混合、易方达悦兴一年 | 2016-11-23  | -    | 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 |

|  |   |  |  |   |
|--|---|--|--|---|
|  | 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 |  |  | 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、易方达新享混合、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 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 23 次，其中 21 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

四季度经济基本面的改善主要来自政策拉动。自 9 月中共中央政治局会议对经济增长的政策要求显著提升后，各项稳增长政策相继落地。随着政府投资、以旧换新、地产等实体领域的政策支持效果逐渐显现，四季度经济环比改善，预计全年可以实现 5% 的经济增长目标。但我们也观察到，经济的改善中仍然存在诸多结构性问题，通胀偏低的宏观背景尚未显著改善，复苏的持续性和强度有较大不确定性。受到财政支持的提振，四季度基建同比维持高位，相关实物工作量也保持韧性，但 12 月以来的高频数据显示政策拉动力度有所走弱。地产政策带来交易量的改善，二手房成交环比有所走弱而同比仍在大幅增长，但随着房价脉冲逐渐减弱，交易量的修复恐怕难以维持至库存充分去化，房价仍面临压力。出口方面，出于对特朗普上台后对中国加征关税的担忧，四季度经济可能经历了一轮抢出口的短期脉冲，但这一拉动因素在未来存在较大变数。假设 2025 年全球贸易战能够避免各国普遍加税的高烈度情景，那么在现有的国内政策组合下，我们预计经济增长将运行在合理区间，但在居民和企业内生需求承压的情况下，难以表现出较强的向上弹性。内生需求压力的缓解需要后续更大程度的政策力度支持，尤其是聚焦在房地产和居民消费方面的政策。

债券市场表现强势，四季度收益率的下行幅度从历史来看都极为少见。自 9 月中共中央政治局会议后，各项经济刺激政策陆续落地、市场风险偏好回升、权益大涨、地方政府债券供给放量冲击市场，多重利空因素对债市情绪形成阶段性扰动，但市场整体仍表现出较强的配置力量，收益率数次调整但幅度都较小，整体仍维持震荡走势；11 月以后，6 万亿增量财政政策落地、政策进入观察窗口期，市场情绪缓和，下旬非银同业存款利率自律管理机制的落地打开了短端利率的下行空间，收益率再度下行，直至中共中央政治局会议对明年货币政策的定调从维持数年的“稳健”调整为“适度宽



松”，这强化了市场降准降息预期，收益率大幅下行，抢跑行情甚至透支了部分明年的降息预期。整个季度，长短端利率均大幅下行，1 年内国债收益率跌破 1%、10 年期国债收益率跌破 1.7%，收于全年最低点。

股票市场四季度维持区间波动。9 月底中共中央政治局会议释放的稳增长政策预期经过国庆假期发酵，在节后第一天市场情绪达到顶点，随后展开震荡调整。行业层面，在证券、基金、保险公司互换便利（SFISF）以及回购增持再贷款等利好权益市场的政策带动下，信用预期修复、估值扩张，同时叠加海外降息周期及国内货币政策宽松预期，这些对前期估值调整充分的成长板块最为利好，小盘表现好于大盘。

转债走势跟随股票市场，前期涨幅滞后于股票，但随着信用冲击的修复、风险偏好的回升及债市大幅上涨后的债底抬升，整个四季度转债估值持续拉升，在纯债收益率大幅走低的背景下，纯债替代需求资金涌入，推升转债估值回到接近年内高位水平。

报告期内，本基金规模有所下降。债券方面，四季度组合整体保持较高的杠杆及久期水平，在利率债上进行了较为积极的波段操作，国庆节后考虑到稳增长政策逐步落地、市场风险偏好抬升，组合久期有所下降，但在地产、消费等经济内生增长动能尚未出现明显改善之前，整体仍保持超配基准的久期水平；11 月，随着市场调整趋于缓和、年内新增地方政府债发行高峰结束、非银同业存款利率自律管理机制落地、中共中央政治局会议对明年货币政策定调“适度宽松”，基于对短端利率下行空间的乐观判断，组合久期逐步提升至较高水平。信用债底仓方面，组合年底把握信用利差相对较好的时点进行类属调整，持仓仍以高等级信用债和金融债为主获取票息收益，提升信用久期的同时改善持仓流动性。股票方面，组合仓位降低，减持部分与经济增长相关性较高的 TMT（数字新媒体产业）、医药、食品饮料、化工等个股，同时对涨幅较多的银行、石化等红利板块择机止盈，小幅加仓基本面有望底部改善、同时具备较好分红率的交运、家电等龙头个股。转债方面，组合仓位先升后降，主要基于期权价值从低估到中性定价的市场变化，同时考虑到转债市场整体波动率的提升，组合保持合理仓位来控制对组合波动率的影响，策略上仍然注重凸性价格区间的变化，个券注重考量个股空间和转债溢价率的均衡。

#### 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 1.4090 元，本报告期份额净值增长

率为 2.23%，同期业绩比较基准收益率为 2.03%；C 类基金份额净值为 1.3962 元，本报告期份额净值增长率为 2.13%，同期业绩比较基准收益率为 2.03%。

#### 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              | 666,643,455.82   | 11.01        |
|    | 其中：股票             | 666,643,455.82   | 11.01        |
| 2  | 固定收益投资            | 5,337,996,697.16 | 88.13        |
|    | 其中：债券             | 5,060,966,082.13 | 83.56        |
|    | 资产支持证券            | 277,030,615.03   | 4.57         |
| 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      | 44,524,969.43    | 0.74         |
| 7  | 其他资产              | 7,800,035.49     | 0.13         |
| 8  | 合计                | 6,056,965,157.90 | 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              | 9,047,766.00   | 0.20  |
| C | 制造业              | 348,055,020.96 | 7.80  |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 102,640,674.90 | 2.30  |
| E | 建筑业              | -              | -     |
| F | 批发和零售业           | -              | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 24,687,780.00  | 0.55  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 44,789,388.00  | 1.00  |
| J | 金融业              | 123,955,454.96 | 2.78  |
| K | 房地产业             | -              | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | 13,467,371.00  | 0.30  |
| M | 科学研究和技术服务业       | -              | -     |
| 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               | 666,643,455.82 | 14.94 |

### 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 | 2,248,570 | 130,124,745.90 | 2.92         |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 540,401   | 75,677,756.04  | 1.70         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 1,915,500 | 75,279,150.00  | 1.69         |
| 4  | 600900 | 长江电力 | 1,795,200 | 53,048,160.00  | 1.19         |
| 5  | 300408 | 三环集团 | 1,327,302 | 51,114,400.02  | 1.15         |
| 6  | 601658 | 邮储银行 | 8,569,772 | 48,676,304.96  | 1.09         |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 31,670    | 48,265,080.00  | 1.08         |
| 8  | 688188 | 柏楚电子 | 230,576   | 44,789,388.00  | 1.00         |
| 9  | 600886 | 国投电力 | 1,767,895 | 29,382,414.90  | 0.66         |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 10 | 002352 | 顺丰控股 | 612,600 | 24,687,780.00 | 0.55 |
|----|--------|------|---------|---------------|------|

## 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      | 915,818,482.76   | 20.52        |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,074,491,433.00 | 46.49        |
|    | 其中：政策性金融债 | 234,053,929.31   | 5.25         |
| 4  | 企业债券      | 224,909,927.12   | 5.04         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 1,407,825,658.29 | 31.55        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 437,920,580.96   | 9.81         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 5,060,966,082.13 | 113.42       |

## 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      | 3,900,000 | 482,402,142.86 | 10.81        |
| 2  | 092280069 | 22 华夏银行二级资本债 01 | 2,200,000 | 229,892,284.93 | 5.15         |
| 3  | 240017    | 24 付息国债 17      | 2,000,000 | 209,399,293.48 | 4.69         |
| 4  | 2128042   | 21 兴业银行二级 02    | 1,800,000 | 186,936,420.82 | 4.19         |
| 5  | 2128033   | 21 建设银行二级 03    | 1,700,000 | 176,711,926.03 | 3.96         |

## 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 | 51,621,962.35 | 1.16 |
| 2  | 112561 | 22 和闽优   | 500,000 | 49,534,735.87 | 1.11 |
| 3  | 199204 | 23 华兴优   | 400,000 | 33,973,928.52 | 0.76 |
| 4  | 135755 | 22 吉电优   | 300,000 | 31,515,209.01 | 0.71 |
| 5  | 199694 | G23XH 优  | 300,000 | 30,983,479.12 | 0.69 |
| 6  | 112592 | G 重庆优    | 200,000 | 21,145,761.10 | 0.47 |
| 7  | 199670 | 23 中公 1A | 200,000 | 20,472,876.71 | 0.46 |
| 8  | 112060 | 二发 A     | 200,000 | 18,390,324.82 | 0.41 |
| 9  | 183480 | PR 铁置优   | 100,000 | 9,942,559.04  | 0.22 |
| 10 | 112887 | G 中交泰 A  | 100,000 | 9,449,778.49  | 0.21 |

#### 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，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。中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 308,453.37   |
| 2  | 应收证券清算款 | 6,417,766.01 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 1,073,816.11 |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 其他    | -            |
| 8 | 合计    | 7,800,035.49 |

## 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<br>净值比例(%) |
|----|--------|---------|---------------|------------------|
| 1  | 110081 | 闻泰转债    | 48,960,934.30 | 1.10             |
| 2  | 127089 | 晶澳转债    | 46,515,905.52 | 1.04             |
| 3  | 113641 | 华友转债    | 46,380,003.76 | 1.04             |
| 4  | 110079 | 杭银转债    | 21,220,007.85 | 0.48             |
| 5  | 118034 | 晶能转债    | 18,302,263.69 | 0.41             |
| 6  | 113069 | 博 23 转债 | 15,617,700.01 | 0.35             |
| 7  | 113685 | 升 24 转债 | 13,912,632.05 | 0.31             |
| 8  | 110073 | 国投转债    | 13,862,362.52 | 0.31             |
| 9  | 113049 | 长汽转债    | 10,051,795.97 | 0.23             |
| 10 | 123190 | 道氏转 02  | 9,521,194.72  | 0.21             |
| 11 | 123119 | 康泰转 2   | 9,388,810.53  | 0.21             |
| 12 | 127050 | 麒麟转债    | 8,894,765.42  | 0.20             |
| 13 | 123225 | 翔丰转债    | 8,404,589.84  | 0.19             |
| 14 | 110095 | 双良转债    | 8,402,005.50  | 0.19             |
| 15 | 113043 | 财通转债    | 7,889,255.10  | 0.18             |
| 16 | 128119 | 龙大转债    | 6,689,589.44  | 0.15             |
| 17 | 110062 | 烽火转债    | 6,459,811.15  | 0.14             |
| 18 | 118043 | 福立转债    | 6,240,870.85  | 0.14             |
| 19 | 127091 | 科数转债    | 6,209,034.78  | 0.14             |
| 20 | 123240 | 楚天转债    | 5,912,174.33  | 0.13             |
| 21 | 123174 | 精锻转债    | 5,841,861.52  | 0.13             |
| 22 | 113654 | 永 02 转债 | 5,786,092.98  | 0.13             |
| 23 | 123210 | 信服转债    | 5,770,299.03  | 0.13             |
| 24 | 113050 | 南银转债    | 5,589,417.70  | 0.13             |
| 25 | 118030 | 睿创转债    | 5,491,735.08  | 0.12             |
| 26 | 123221 | 力诺转债    | 5,240,799.02  | 0.12             |
| 27 | 123194 | 百洋转债    | 5,117,449.57  | 0.11             |
| 28 | 113056 | 重银转债    | 4,934,369.94  | 0.11             |
| 29 | 113670 | 金 23 转债 | 4,855,221.39  | 0.11             |
| 30 | 127081 | 中旗转债    | 4,482,777.34  | 0.10             |
| 31 | 123145 | 药石转债    | 4,214,715.80  | 0.09             |
| 32 | 127095 | 广泰转债    | 4,147,155.04  | 0.09             |

|    |        |         |              |      |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 33 | 127102 | 浙建转债    | 3,767,975.90 | 0.08 |
| 34 | 123204 | 金丹转债    | 3,655,131.40 | 0.08 |
| 35 | 118037 | 上声转债    | 3,423,442.59 | 0.08 |
| 36 | 111018 | 华康转债    | 3,211,858.78 | 0.07 |
| 37 | 113584 | 家悦转债    | 3,122,007.34 | 0.07 |
| 38 | 123237 | 佳禾转债    | 2,742,644.85 | 0.06 |
| 39 | 123233 | 凯盛转债    | 2,496,059.11 | 0.06 |
| 40 | 113667 | 春 23 转债 | 2,438,214.44 | 0.05 |
| 41 | 113679 | 芯能转债    | 2,309,029.01 | 0.05 |
| 42 | 123178 | 花园转债    | 2,191,738.16 | 0.05 |
| 43 | 127103 | 东南转债    | 1,838,550.01 | 0.04 |
| 44 | 127101 | 豪鹏转债    | 1,768,576.09 | 0.04 |
| 45 | 123131 | 奥飞转债    | 1,644,209.40 | 0.04 |
| 46 | 123182 | 广联转债    | 1,625,061.70 | 0.04 |
| 47 | 111007 | 永和转债    | 1,612,468.78 | 0.04 |
| 48 | 123161 | 强联转债    | 1,480,711.52 | 0.03 |
| 49 | 127100 | 神码转债    | 982,951.60   | 0.02 |
| 50 | 123152 | 润禾转债    | 867,407.34   | 0.02 |
| 51 | 113062 | 常银转债    | 270,181.25   | 0.01 |

#### 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                        | 易方达丰和债券A         | 易方达丰和债券C       |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 4,031,636,462.28 | 78,431,141.41  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 56,708,134.27    | 97,405,249.47  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 1,093,375,738.15 | 2,284,445.81   |
| 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               | 2,994,968,858.40 | 173,551,945.07 |

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达丰和债券型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达丰和债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达丰和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

二〇二五年一月二十一日