

# 易方达安盈回报混合型证券投资基金

## 2025 年年度报告

2025 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年三月三十一日

## § 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....                         | 6  |
| 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、基金净值表现及利润分配情况.....                | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 11 |
| § 4 管理人报告.....                               | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14 |
| 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.....             | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 16 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 17 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 18 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 19 |
| 4.9 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.....       | 19 |
| § 5 托管人报告.....                               | 19 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 19 |
| 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..... | 19 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 19 |
| § 6 审计报告.....                                | 19 |
| 6.1 审计意见.....                                | 20 |
| 6.2 形成审计意见的基础.....                           | 20 |
| 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....                     | 20 |
| 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....                     | 20 |
| § 7 年度财务报表.....                              | 21 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 21 |
| 7.2 利润表.....                                 | 23 |
| 7.3 净资产变动表.....                              | 24 |
| 7.4 报表附注.....                                | 26 |
| § 8 投资组合报告.....                              | 59 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 59 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 59 |
| 8.3 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.....       | 60 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 62 |

|             |   |           |
|-------------|---|-----------|
| 8.5         | 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 63        |
| 8.6         | 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 .....    | 64        |
| 8.7         | 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 ..... | 64        |
| 8.8         | 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 ..... | 64        |
| 8.9         | 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 .....    | 64        |
| 8.10        | 本基金投资股指期货的投资政策 .....                    | 64        |
| 8.11        | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....              | 64        |
| 8.12        | 投资组合报告附注 .....                          | 65        |
| <b>§ 9</b>  | <b>基金份额持有人信息</b> .....                  | <b>68</b> |
| 9.1         | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 68        |
| 9.2         | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 68        |
| 9.3         | 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 .....      | 68        |
| <b>§ 10</b> | <b>开放式基金份额变动</b> .....                  | <b>69</b> |
| <b>§ 11</b> | <b>重大事件揭示</b> .....                     | <b>69</b> |
| 11.1        | 基金份额持有人大会决议 .....                       | 69        |
| 11.2        | 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 .....       | 69        |
| 11.3        | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 69        |
| 11.4        | 基金投资策略的改变 .....                         | 70        |
| 11.5        | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 70        |
| 11.6        | 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....           | 70        |
| 11.7        | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                 | 70        |
| 11.8        | 其他重大事件 .....                            | 72        |
| <b>§ 12</b> | <b>备查文件目录</b> .....                     | <b>74</b> |
| 12.1        | 备查文件目录 .....                            | 74        |
| 12.2        | 存放地点 .....                              | 74        |
| 12.3        | 查阅方式 .....                              | 74        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 易方达安盈回报混合型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 易方达安盈回报混合        |                 |
| 基金主代码           | 001603           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2017 年 2 月 16 日  |                 |
| 基金管理人           | 易方达基金管理有限公司      |                 |
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 582,593,329.83 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 易方达安盈回报混合 A      | 易方达安盈回报混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 001603           | 017414          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 490,657,640.29 份 | 91,935,689.54 份 |

注：自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日。

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，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。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进行投资；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、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率 ×25%+中债新综合指数收益率 ×70%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%  |
| 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  |

|  |                   |
|--|-------------------|
|  | 金，高于债券型基金和货币市场基金。 |
|--|-------------------|

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人   | 基金托管人                         |
|-------------|------|---|-------------------------------|
| 名称          |      | 易方达基金管理有限公司   | 中国农业银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 王玉  | 任航                            |
|             | 联系电话 | 020-85102688  | 010-66060069                  |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn   | tgxxpl@abchina.com            |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088  | 95599                         |
| 传真          |      | 020-38798812  | 010-68121816                  |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区荣粤道<br>188号6层   | 北京市东城区建国门内大街69号               |
| 办公地址        |      | 广东省广州市天河区珠江西路21<br>号52层；广东省广州市天河区珠<br>江东路30号42层；广东省珠海市<br>横琴新区荣粤道188号6层 | 北京市西城区复兴门内大街28号<br>凯晨世贸中心东座F9 |
| 邮政编码        |      | 510627；510623；519031  | 100031                        |
| 法定代表人       |      | 吴欣荣   | 谷澍                            |

### 2.4 信息披露方式

|                     |                   |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报              |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.efunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人的办公地址        |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址  |
|--------|------------------|---|
| 会计师事务所 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26                       |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

## 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 | 2025 年           |                | 2024 年           |               | 2023 年           |              |
|---------------|------------------|----------------|------------------|---------------|------------------|--------------|
|               | 易方达安盈回报混合 A      | 易方达安盈回报混合 C    | 易方达安盈回报混合 A      | 易方达安盈回报混合 C   | 易方达安盈回报混合 A      | 易方达安盈回报混合 C  |
| 本期已实现收益       | 27,218,617.55    | 2,456,171.44   | -30,362,534.41   | -1,459,065.02 | -54,002,732.93   | -24,171.80   |
| 本期利润          | 126,727,169.29   | 8,301,050.72   | 97,285,387.26    | 3,345,856.32  | -130,689,627.87  | -298,354.52  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1961           | 0.1993         | 0.1044           | 0.1202        | -0.1201          | -0.1932      |
| 本期加权平均净值利润率   | 8.74%            | 8.51%          | 5.07%            | 5.89%         | -5.58%           | -9.09%       |
| 本期基金份额净值增长率   | 9.34%            | 9.03%          | 5.54%            | 5.11%         | -5.77%           | -8.50%       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2025 年末          |                | 2024 年末          |               | 2023 年末          |              |
|               | 易方达安盈回报混合 A      | 易方达安盈回报混合 C    | 易方达安盈回报混合 A      | 易方达安盈回报混合 C   | 易方达安盈回报混合 A      | 易方达安盈回报混合 C  |
| 期末可供分配利润      | 226,362,374.04   | 40,330,878.11  | 344,154,284.01   | 5,003,203.72  | 456,260,826.88   | 591,519.82   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4613           | 0.4387         | 0.4226           | 0.4081        | 0.4524           | 0.4458       |
| 期末基金资产净值      | 1,155,123,327.37 | 214,268,146.92 | 1,752,994,693.24 | 26,209,828.65 | 2,057,613,487.67 | 2,698,925.85 |
| 期末基金份额        | 2.354            | 2.331          | 2.153            | 2.138         | 2.040            | 2.034        |

| 净值                                      |                 |                 |                 |                 |                 |                 |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 3.1.3 累计<br>期末指标                        | 2025 年末         |                 | 2024 年末         |                 | 2023 年末         |                 |
|   | 易方达安盈<br>回报混合 A | 易方达安盈<br>回报混合 C | 易方达安盈<br>回报混合 A | 易方达安盈<br>回报混合 C | 易方达安盈<br>回报混合 A | 易方达安盈回<br>报混合 C |
| 基金份<br>额累<br>计<br>净<br>值<br>增<br>长<br>率 | 154.64%         | 4.86%           | 132.90%         | -3.82%          | 120.68%         | -8.50%          |

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。

4.自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

##### 易方达安盈回报混合 A

| 阶段             | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -4.04%       | 0.80%               | 0.37%          | 0.24%                 | -4.41%  | 0.56% |
| 过去六个月          | 6.90%        | 0.68%               | 3.97%          | 0.22%                 | 2.93%   | 0.46% |
| 过去一年           | 9.34%        | 0.55%               | 4.88%          | 0.23%                 | 4.46%   | 0.32% |
| 过去三年           | 8.73%        | 0.58%               | 15.25%         | 0.26%                 | -6.52%  | 0.32% |
| 过去五年           | 10.47%       | 0.74%               | 14.16%         | 0.28%                 | -3.69%  | 0.46% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 154.64%      | 0.88%               | 44.13%         | 0.29%                 | 110.51% | 0.59% |

##### 易方达安盈回报混合 C

| 阶段    | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -4.11%       | 0.80%               | 0.37%          | 0.24%                 | -4.48% | 0.56% |
| 过去六个月 | 6.73%        | 0.68%               | 3.97%          | 0.22%                 | 2.76%  | 0.46% |
| 过去一年  | 9.03%        | 0.55%               | 4.88%          | 0.23%                 | 4.15%  | 0.32% |
| 过去三年  | -            | -                   | -              | -                     | -      | -     |

|            |       |       |        |       |        |       |
|------------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去五年       | -     | -     | -      | -     | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 4.86% | 0.58% | 13.50% | 0.26% | -8.64% | 0.32% |

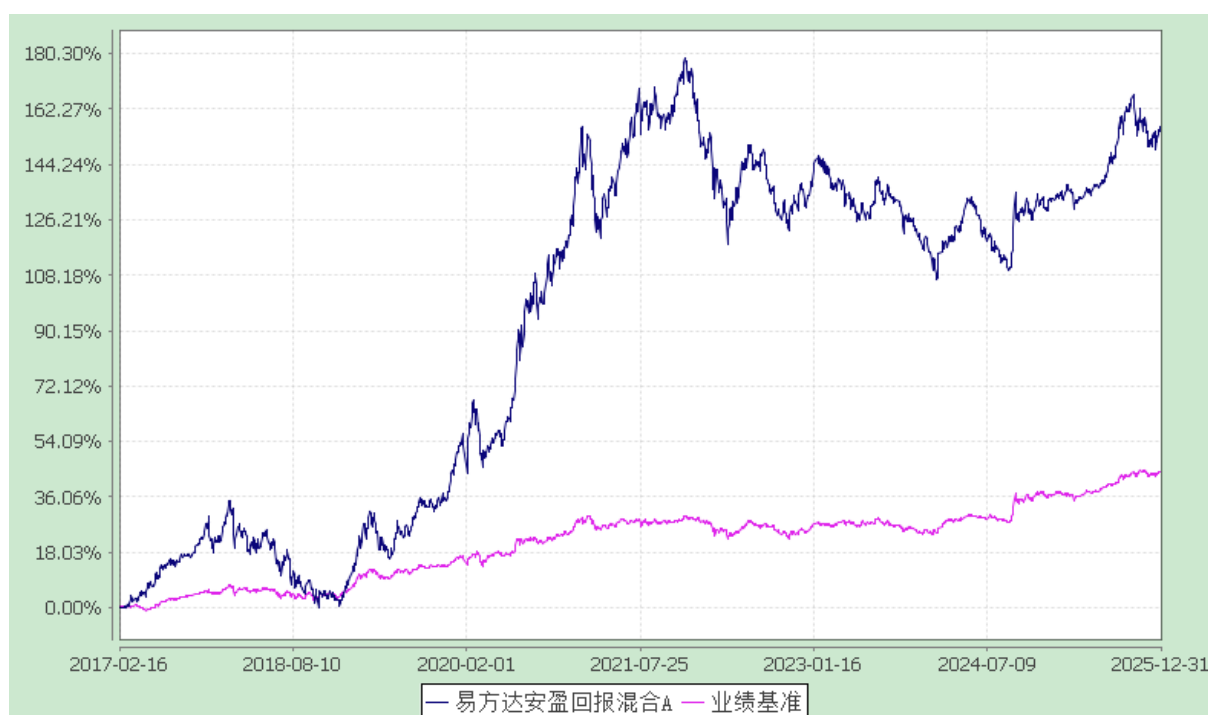
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达安盈回报混合型证券投资基金

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

易方达安盈回报混合 A

(2017 年 2 月 16 日至 2025 年 12 月 31 日)



易方达安盈回报混合 C

(2023 年 3 月 8 日至 2025 年 12 月 31 日)



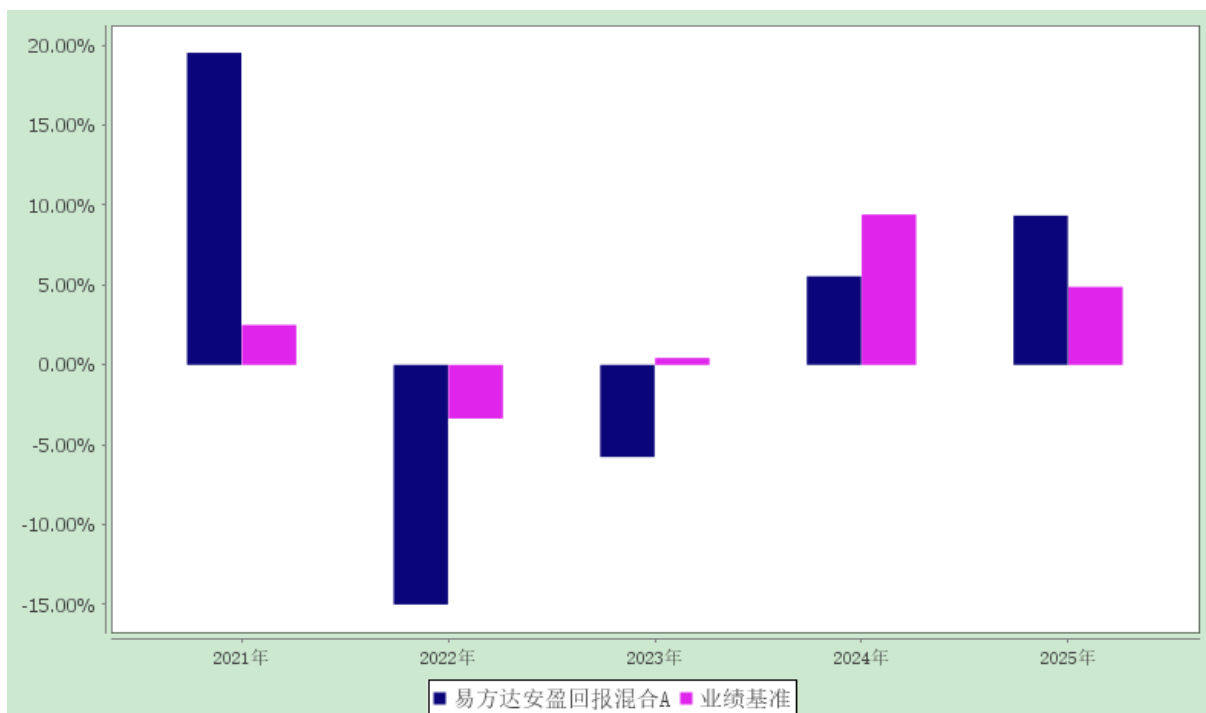
注：自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

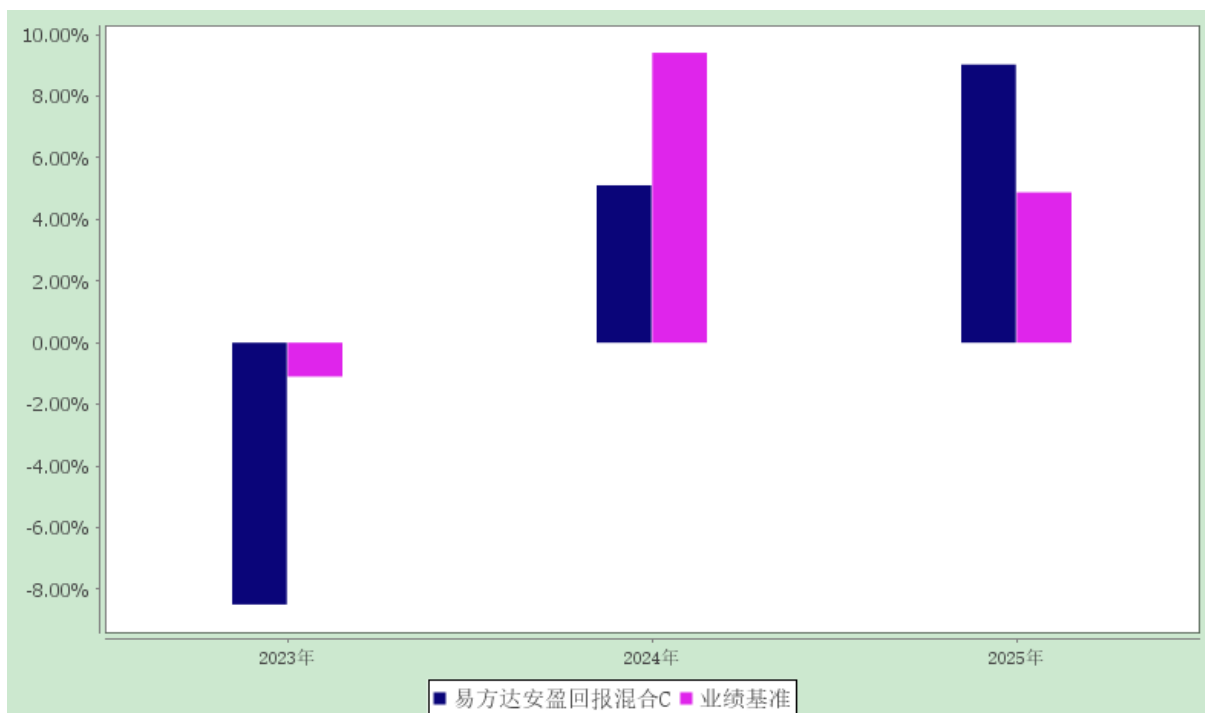
易方达安盈回报混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

#### 易方达安盈回报混合 A



#### 易方达安盈回报混合 C



注：自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 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<br>基金经理（助<br>理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明 |
|----|----|-------------------------|----------|----------------|----|
|    |    | 任职<br>日期                | 离任<br>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、易方达丰和债券、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，高级董事总经理、多资产投资决策委员会委员  | 2017-02-16 | - | 18 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、副总经理级高级管理人员，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。 |
| 杨康  | 本基金的基金经理助理，易方达鑫转增利混合、易方达裕富债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新益混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 04 月 08 日）、易方达新享混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 05 月 08 日）、易方达瑞景混合、易方达瑞信混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 05 月 08 日）、易方达瑞选混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 05 月 08 日）、易方达瑞和混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 05 月 08 日）、易方达瑞祺混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 05 月 08 日）、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达丰惠混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 05 月 08 日）、易方达瑞通混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 04 月 08 日）、易方达瑞弘混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 04 月 08 日）、易方达鑫转添利混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 04 月 08 日）、易方达瑞川混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2025 年 09 月 12 日）、易方达瑞锦混合的基金经理， | 2019-06-10 | - | 10 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部研究员、投资经理助理，易方达基金管理有限公司投资经理，易方达鑫转招利混合、易方达瑞川混合发起式、易方达瑞锦混合发起式、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达瑞富混合、易方达瑞祥混合、易方达裕鑫债券的基金经理。   |

|    |  |            |   |      |  |
|----|--|------------|---|------|--|
|    | 易方达安心回报债券、易方达招易一年持有混合（自 2022 年 07 月 09 日至 2025 年 08 月 20 日）、易方达悦通一年持有混合（自 2022 年 07 月 09 日至 2025 年 09 月 08 日）、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合的基金经理助理，多资产公募投资部总经理助理   |            |   |      |  |
| 周琼 | 本基金的基金经理助理，易方达鑫转添利混合、易方达裕丰回报债券、易方达丰华债券（自 2019 年 10 月 11 日至 2025 年 02 月 19 日）、易方达新收益混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达安心回报债券、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、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达丰惠混合、易方达瑞锦混合、易方达悦兴一年持有混合、易方达悦信一年持有混合（自 2021 年 06 月 04 日至 2025 年 02 月 19 日）、易方达悦夏一年持有混合（自 2021 年 07 月 05 日至 2025 年 02 月 19 日）、易方达悦丰一年持有混合（自 2021 年 09 月 28 日至 2025 年 03 月 18 日）、易方达悦融一年持有混合（自 2022 年 01 月 05 日至 2025 年 03 月 18 日）、易方达悦稳一年持有混合（自 2022 年 04 月 16 日至 2025 年 03 月 18 日）、易方达安心回馈混合（自 2022 年 04 月 30 日至 2025 年 02 月 19 日）、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合（自 2022 年 04 月 30 日至 2025 年 08 月 20 日）、易方达悦鑫一年持有混合（自 2022 年 06 月 18 日至 2025 年 03 月 18 日）、易方达全球配置混合（QDII）、易方达丰和债券的基金经理助理 | 2019-10-11 | - | 11 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任凯仁投资咨询（上海）有限公司客户经理，易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员。 |

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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 94 次，其中 80 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，14 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。

## 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

2025 年中国经济呈现出“外需强、内需弱”、“新经济强、旧经济弱”的分化格局。在全球 AI 科技革命的带动下，海外企业持续扩大资本开支，外需强劲，叠加我国价格优势的支撑，全年出口得以保持较好增速。但内需相关的投资和消费仍持续承压，上半年依靠财政政策靠前发力和“以旧换新”等消费补贴政策的带动，经济总量实现了较高增速，下半年随着补贴政策的退坡和新增政策资金接续的暂缓，内需相关行业增长均有所放缓。2025 年新旧经济动能切换加速，新经济的成长成为结构性亮点，虽然地产链的景气度仍在恶化，但经过数年的出清，当前其对经济增长的拖累已经不足一个百分点，而新经济占 GDP 的比重已经上升到接近 20%，“新动能”的增长在一定程度上对冲了“旧动能”的下滑，使得经济整体保持了相对稳定的增速。

经济增长总体稳定，政策重心在下半年开始偏向结构调整。“反内卷”政策改善了部分行业低价无序竞争的局面，推动价格的企稳回升预期。虽然供给收缩与经济增长之间的平衡使得产能利用率的上升与价格指数的改善幅度均相对温和，但物价指数触底修复的预期，对于企业盈利和居民收入的信心改善非常重要，亦对资本市场的风险偏好产生重要影响。

随着经济筑底企稳的预期增强，大类资产表现在 2025 年发生了根本性的切换，权益上涨、债券调整。春节期间 DeepSeek 的横空出世带来中国高端科技产业信心的提升，以科技为代表的新质生产力快速突破，带动权益市场风险偏好提升，也确定了全年科技成长领涨权益市场的主线行情。虽然在 4 月因超预期中美关税冲击而有所回调，但市场在很短的时间内就修复了全部跌幅，下半年更是走出了稳定向上的市场走势。与新旧经济结构分化相对应，权益市场也表现出分化格局。下半年在市场整体估值修复后，资金逐步集中到有景气度和盈利支撑的行业和板块，除了受益于海外资本开支扩大与盈利上修拉动的 AI 相关行业，还有受益于全球定价价格上涨的工业资源品，而内需相关的

消费和地产等行业全年维度仍是持续承压。

价格数据的预期改善扭转了中国经济中长期的通缩叙事，也结束了债券收益率单边下行趋势。全年来看，中短端信用品种在流动性充裕的环境下仍有大量的配置需求，信用利差始终维持在较低水平，而对基本面变化和市场风险偏好更为敏锐的超长债，下半年开始在估值偏贵与供需失衡的多重压力下持续调整，债券市场全年呈现“上行且陡峭化”行情。

转债市场在这一年亦展现出结构性的重大变化。剩余期限的减少、下修赎回概率的变化，导致转债市场在某种程度上不能简单用单一维度指标做历史比较，均值回复区间中枢有所上移。下半年随着风险偏好的抬升、供需格局的失衡，溢价率加速拉升，大部分转债价格所处区间使其获取收益难度较大，指数层面的波动率提升。

2025 年对投资而言是充满挑战的一年，无论是宏观叙事，还是产业趋势都发生了较大的变化。投资本身是对未来不确定性的定价，随着市场环境的变化，我们对市场的观点和产业趋势的判断都在逐步得到确认，组合的资产配置也随之进行了大幅度的调整，自上而下进行了较大比例的风格调整。不仅在股债资产之间进行了仓位调整，在股票行业内部也进行了较大比例的风格变化。以半年末为分界点，上半年组合的权益配置思路仍是基于赔率角度的考虑，虽然仓位在持续提升、也增加了一些科技板块持仓，但也持有不少红利资产，整体仍是维持了相对均衡的配置。下半年随着市场风险偏好的提升，股债相对价值拐点的出现，组合大幅提升权益仓位到较高水平，同时减持了类债思路配置的红利资产，置换为电子、新能源、医药等科技成长板块个股，四季度行业配置上更加集中于有盈利和高景气支撑的 AI 科技行业，减持内需相关个股。转债方面，根据组合的风险收益特征，在转债标的的选择上持续超配平衡低估型、低配债型转债，重点参与绝对价格在 120-140 元之间同时溢价率比较低、不对称性较好的个券投资机会，兑现了部分平价、溢价率双高的股性个券。纯债仓位仍以短久期信用债为主获取票息和骑乘收益，同时保持较好的流动性。

#### 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 2.354 元，本报告期份额净值增长率为 9.34%，同期业绩比较基准收益率为 4.88%；C 类基金份额净值为 2.331 元，本报告期份额净值增长率为 9.03%，同期业绩比较基准收益率为 4.88%。

#### 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 2026 年，海外经济预计将延续“总需求强劲、就业复苏温和”的非典型扩张周期，AI 产业趋势与财政政策将继续主导市场定价，在人民币汇率不出现大幅升值的前提下，外需的强劲和中国价格优势仍将对出口形成支撑。内需方面，随着 2025 年底政策性金融工具的资金投放和结存限额在 2026 年初落地使用，或将进一步形成实物工作量，对投资形成带动。新旧经济动能切换，地产经过

数年的价格下行已经逐步接近本轮周期底部，对经济的拖累逐渐趋缓；同时新经济占 GDP 的比重仍在持续上升，AI 产业趋势在全球范围内保持着较高景气度，对经济增长的向上拉动发挥着越来越重要的作用。整体而言，在外需稳定偏强的支撑下，国内经济持续多年的拖累因素正在逐步减弱，政策工具的投放和新经济的拉动能带来向上提振，预计经济整体实现平稳增长。供给侧“反内卷”持续推进，在当前偏温和的力度下，PPI 同比降幅预计将有所收窄，但年内能否回正仍取决于政策力度，核心 CPI 在劳动力成本提升和工业制成品价格上涨带动下也将有所提振。

基于上述判断，经济总量平稳、结构分化的环境预计会延续，新经济强、旧经济弱，出口强、内需弱。映射到资本市场上，股票仍是占优资产，在政策的呵护下，新股上市活跃、股市波动率下降，市场风险偏好提升、温和上行预期一致性较强，科技成长仍是中长期主线，有盈利支撑的出海、高端制造等新兴产业内部有众多较好的投资机会，同时供需格局改善的资源品也值得重视。债券市场机会与风险都不大，需要降低预期收益，优选中短期信用债以获取票息收益；转债市场需要结合估值水平与正股资质综合判断，适当左侧交易并聚焦个股，关注止盈时点。

后续组合将根据市场情况灵活调仓，自上而下把握资产配置机会，也注重分类资产内部结构性机会的挖掘，持续改善组合灵活性，为持有人提供更好的中长期回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人紧扣公募基金行业高质量发展主线，根据法律法规、最新监管要求和业务发展需要，围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程，强化对法规和制度执行情况的监督检查，保障旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作情况如下：

(1) 坚持投资者利益至上，大力培育良好的合规文化，严格落实从业人员廉洁从业、职业操守和道德规范相关要求，积极探索合规文化宣贯新形式，组织面向全体员工及不同部门的合规专项培训、考试及承诺函签署等工作，引导员工将合规意识内化于心、外化于行，自觉践行“五要五不”的中国特色金融文化。

(2) 通过系统升级，进一步优化投资交易的日常监控机制，提升投前、投中和投后全链条的合规风控效能。投资合规部门与研究、投资、交易业务部门协同完善内部制度和流程，进一步明确业务执行规范。根据监管要求和业务发展情况，加强程序化交易执行监控，持续巩固公平交易和异常交易管控措施。

(3) 持续优化各类法律文件审核流程，强化全流程合规管控。坚持以投资者为本，积极推进浮动费率基金等创新产品开发论证，审慎评估各项新业务方案，保障公司各项业务稳妥有序开展，更

好服务广大投资者财富管理需求。

(4) 严格遵守法律法规及监管规定，持续规范基金销售行为，强化对自媒体账号、社群运营等重点领域的合规管控。不断完善新型基金营销模式管控机制，支持创新业务与服务规范有序落地。积极探索运用数智化技术，开发宣传推介材料智能审核系统，提升合规审核效率。始终坚持以投资者利益为核心，健全投资者适当性管理长效机制，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的科学性与合理性。认真贯彻落实监管部门关于中小投资者保护工作要求，深入推进投诉溯源治理，妥善化解业务纠纷，切实维护投资者合法权益。

(5) 持续督促各部门落实法律法规、自律规则、基金法律文件中各项信息披露规定，优化完善相关制度流程；推进公司级信息披露平台和智能审核系统建设，深度探索人工智能技术在信息披露工作中的应用，以科技赋能有效应对持续增长的信息披露工作，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 深入贯彻落实新《反洗钱法》及配套法规制度要求，全面完善“基于风险”的洗钱风险管理体系，建立健全客户尽职调查和受益所有人识别机制，加强洗钱风险识别管控，推动科技赋能与数据治理，持续提升反洗钱工作有效性水平。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱、境内外子公司等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展年度内控评价、ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，全方位审视公司内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达安盈回报混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达安盈回报混合 C:本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—易方达基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，本托管人未发现有损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，易方达基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 审计报告

容诚审字[2026]200Z1252 号

易方达安盈回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了易方达安盈回报混合型证券投资基金财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达安盈回报混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于易方达安盈回报混合型证券投资基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达安盈回报混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达安盈回报混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达安盈回报混合型证券投资基金的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这

些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对易方达安盈回报混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达安盈回报混合型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

薛竞 周祎

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2026 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：易方达安盈回报混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产   | 附注号     | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：  |         |                         |                          |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 1,007,784.31            | 1,778,230.60             |

|               |            |                                 |                                  |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 结算备付金         |            | 4,783,483.13                    | 6,750,846.19                     |
| 存出保证金         |            | 301,126.48                      | 133,699.91                       |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 1,433,022,035.32                | 1,715,403,438.44                 |
| 其中：股票投资       |            | 648,810,498.12                  | 448,871,945.16                   |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 784,211,537.20                  | 1,266,531,493.28                 |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                               | 147,008,712.91                   |
| 应收清算款         |            | 16,082,048.31                   | 2,602,050.13                     |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | 303,206.24                      | 143,669.91                       |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>   |            | <b>1,455,499,683.79</b>         | <b>1,873,820,648.09</b>          |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                 |                                  |
| 短期借款          |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | 64,989,481.31                   | -                                |
| 应付清算款         |            | -                               | 1,254,602.29                     |
| 应付赎回款         |            | 19,224,286.19                   | 91,197,297.68                    |
| 应付管理人报酬       |            | 1,067,467.16                    | 1,430,050.61                     |
| 应付托管费         |            | 237,214.91                      | 317,789.01                       |
| 应付销售服务费       |            | 72,625.64                       | 8,851.86                         |

|                 |         |                         |                         |
|-----------------|---------|-------------------------|-------------------------|
| 应付投资顾问费         |         | -                       | -                       |
| 应交税费            |         | 20,186.55               | 15,855.71               |
| 应付利润            |         | -                       | -                       |
| 递延所得税负债         |         | -                       | -                       |
| 其他负债            | 7.4.7.6 | 496,947.74              | 391,679.04              |
| <b>负债合计</b>     |         | <b>86,108,209.50</b>    | <b>94,616,126.20</b>    |
| <b>净资产：</b>     |         |                         |                         |
| 实收基金            | 7.4.7.7 | 582,593,329.83          | 826,645,665.59          |
| 未分配利润           | 7.4.7.8 | 786,798,144.46          | 952,558,856.30          |
| <b>净资产合计</b>    |         | <b>1,369,391,474.29</b> | <b>1,779,204,521.89</b> |
| <b>负债和净资产总计</b> |         | <b>1,455,499,683.79</b> | <b>1,873,820,648.09</b> |

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 2.354 元，C 类基金份额净值 2.331 元；基金份额总额 582,593,329.83 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 490,657,640.29 份，C 类基金份额总额 91,935,689.54 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达安盈回报混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目              | 附注号      | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|------------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                  |          | 2025 年 1 月 1 日至<br>2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至<br>2024 年 12 月 31 日 |
| <b>一、营业总收入</b>   |          | <b>153,283,401.36</b>               | <b>122,899,093.44</b>               |
| 1.利息收入           |          | 358,292.13                          | 2,112,851.70                        |
| 其中：存款利息收入        | 7.4.7.9  | 40,404.54                           | 128,296.10                          |
| 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       |          | 317,887.59                          | 1,984,555.60                        |
| 其他利息收入           |          | -                                   | -                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 47,321,435.25                       | -11,841,744.54                      |
| 其中：股票投资收益        | 7.4.7.10 | -39,631,343.76                      | -75,269,655.91                      |

|                            |          |                       |                       |
|----------------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 基金投资收益                     |          | -                     | -                     |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.11 | 74,159,834.16         | 41,775,187.48         |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.12 | -                     | -                     |
| 贵金属投资收益                    |          | -                     | -                     |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.13 | -                     | -                     |
| 股利收益                       | 7.4.7.14 | 12,792,944.85         | 21,652,723.89         |
| 其他投资收益                     |          | -                     | -                     |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.15 | 105,353,431.02        | 132,452,843.01        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                     | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.16 | 250,242.96            | 175,143.27            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | <b>18,255,181.35</b>  | <b>22,267,849.86</b>  |
| 1. 管理人报酬                   |          | 13,983,555.74         | 17,782,677.12         |
| 2. 托管费                     |          | 3,107,456.92          | 3,951,706.03          |
| 3. 销售服务费                   |          | 390,025.37            | 229,306.02            |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                     | -                     |
| 5. 利息支出                    |          | 497,813.56            | 45,121.00             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 497,813.56            | 45,121.00             |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.17 | -                     | -                     |
| 7. 税金及附加                   |          | 23,682.86             | 14,790.78             |
| 8. 其他费用                    | 7.4.7.18 | 252,646.90            | 244,248.91            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>135,028,220.01</b> | <b>100,631,243.58</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>135,028,220.01</b> | <b>100,631,243.58</b> |
| 五、其他综合收益的税后净额              |          | -                     | -                     |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>135,028,220.01</b> | <b>100,631,243.58</b> |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：易方达安盈回报混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日      |                  |                  |
|--|---|------------------|------------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润            | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 826,645,665.59                              | 952,558,856.30   | 1,779,204,521.89 |
| 二、本期期初净资产                                | 826,645,665.59                              | 952,558,856.30   | 1,779,204,521.89 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -244,052,335.76                             | -165,760,711.84  | -409,813,047.60  |
| （一）、综合收益总额                               | -   | 135,028,220.01   | 135,028,220.01   |
| （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）      | -244,052,335.76                             | -300,788,931.85  | -544,841,267.61  |
| 其中：1.基金申购款                               | 168,666,208.96                              | 215,911,497.25   | 384,577,706.21   |
| 2.基金赎回款                                  | -412,718,544.72                             | -516,700,429.10  | -929,418,973.82  |
| （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                                | 582,593,329.83                              | 786,798,144.46   | 1,369,391,474.29 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                  |                  |
|  | 实收基金  | 未分配利润            | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 1,009,811,941.72                            | 1,050,500,471.80 | 2,060,312,413.52 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,009,811,941.72                            | 1,050,500,471.80 | 2,060,312,413.52 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -183,166,276.13                             | -97,941,615.50   | -281,107,891.63  |
| （一）、综合收益总额                               | -   | 100,631,243.58   | 100,631,243.58   |

|  |                 |                 |                  |
|--|-----------------|-----------------|------------------|
| (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)      | -183,166,276.13 | -198,572,859.08 | -381,739,135.21  |
| 其中: 1.基金申购款                              | 127,174,176.34  | 136,008,835.63  | 263,183,011.97   |
| 2.基金赎回款                                  | -310,340,452.47 | -334,581,694.71 | -644,922,147.18  |
| (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                                | 826,645,665.59  | 952,558,856.30  | 1,779,204,521.89 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4, 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: 王永铿

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

易方达安盈回报混合型证券投资基金(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[2015]1333 号《关于准予易方达安盈回报混合型证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2016]2955 号《关于易方达安盈回报混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《易方达安盈回报混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达安盈回报混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 604,172,113.67 份基金份额,其中认购资金利息折合 184,238.52 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

自 2023 年 3 月 7 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券

投资行业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要

为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用

损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外

其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(3) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 在遵守法律法规及监管部门规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指

数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种, 根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 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、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)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。对在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，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|--------------------------|
|    |                         |                          |

|                |              |              |
|----------------|--------------|--------------|
| 活期存款           | 1,007,784.31 | 1,778,230.60 |
| 等于：本金          | 1,007,320.28 | 1,777,957.19 |
| 加：应计利息         | 464.03       | 273.41       |
| 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             | 1,007,784.31 | 1,778,230.60 |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 |                |                  |                |               |
|---------------|-------------------------|----------------|------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                      | 应计利息           | 公允价值             | 公允价值变动         |               |
| 股票            | 595,741,232.26          | -              | 648,810,498.12   | 53,069,265.86  |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -              | -                | -              |               |
| 债券            | 交易所市场                   | 440,709,978.53 | 2,632,612.80     | 458,066,107.61 | 14,723,516.28 |
|               | 银行间市场                   | 322,684,899.47 | 3,980,929.59     | 326,145,429.59 | -520,399.47   |
|               | 合计                      | 763,394,878.00 | 6,613,542.39     | 784,211,537.20 | 14,203,116.81 |
| 资产支持证券        | -                       | -              | -                | -              |               |
| 基金            | -                       | -              | -                | -              |               |
| 其他            | -                       | -              | -                | -              |               |
| 合计            | 1,359,136,110.26        | 6,613,542.39   | 1,433,022,035.32 | 67,272,382.67  |               |
| 项目            | 上年度末                    |                |                  |                |               |

|               |       | 2024 年 12 月 31 日 |              |                  |                |
|---------------|-------|------------------|--------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本               | 应计利息         | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 508,393,735.40   | -            | 448,871,945.16   | -59,521,790.24 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                | -            | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 932,460,567.18   | 3,771,020.11 | 956,306,893.28   | 20,075,305.99  |
|               | 银行间市场 | 304,506,564.10   | 4,352,600.00 | 310,224,600.00   | 1,365,435.90   |
|               | 合计    | 1,236,967,131.28 | 8,123,620.11 | 1,266,531,493.28 | 21,440,741.89  |
| 资产支持证券        |       | -                | -            | -                | -              |
| 基金            |       | -                | -            | -                | -              |
| 其他            |       | -                | -            | -                | -              |
| 合计            |       | 1,745,360,866.68 | 8,123,620.11 | 1,715,403,438.44 | -38,081,048.35 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | -                        | -         |
| 合计    | -                        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |

|       |                |   |
|-------|----------------|---|
| 交易所市场 | 147,008,712.91 | - |
| 银行间市场 | -              | - |
| 合计    | 147,008,712.91 | - |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末              | 上年度末             |
|-------------|------------------|------------------|
|             | 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 12 月 31 日 |
| 应付券商交易单元保证金 | -                | -                |
| 应付赎回费       | 1,120.41         | 358.07           |
| 应付证券出借违约金   | -                | -                |
| 应付交易费用      | 312,827.33       | 88,320.97        |
| 其中：交易所市场    | 311,439.83       | 86,703.59        |
| 银行间市场       | 1,387.50         | 1,617.38         |
| 应付利息        | -                | -                |
| 预提费用        | 183,000.00       | 303,000.00       |
| 合计          | 496,947.74       | 391,679.04       |

#### 7.4.7.7 实收基金

易方达安盈回报混合 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                    |                 |
|---------------|-----------------------|-----------------|
|               | 2025年1月1日至2025年12月31日 |                 |
|               | 基金份额（份）               | 账面金额            |
| 上年度末          | 814,384,848.87        | 814,384,848.87  |
| 本期申购          | 51,092,705.83         | 51,092,705.83   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -374,819,914.41       | -374,819,914.41 |
| 本期末           | 490,657,640.29        | 490,657,640.29  |

易方达安盈回报混合 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31日 |                |
|---------------|-----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末          | 12,260,816.72               | 12,260,816.72  |
| 本期申购          | 117,573,503.13              | 117,573,503.13 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -37,898,630.31              | -37,898,630.31 |
| 本期末           | 91,935,689.54               | 91,935,689.54  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

易方达安盈回报混合 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           | 344,154,284.01  | 594,455,560.36  | 938,609,844.37  |
| 本期期初           | 344,154,284.01  | 594,455,560.36  | 938,609,844.37  |
| 本期利润           | 27,218,617.55   | 99,508,551.74   | 126,727,169.29  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -145,010,527.52 | -255,860,799.06 | -400,871,326.58 |
| 其中：基金申购款       | 22,285,246.14   | 44,826,575.98   | 67,111,822.12   |
| 基金赎回款          | -167,295,773.66 | -300,687,375.04 | -467,983,148.70 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | 226,362,374.04  | 438,103,313.04  | 664,465,687.08  |

易方达安盈回报混合 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           | 5,003,203.72  | 8,945,808.21   | 13,949,011.93  |
| 本期期初           | 5,003,203.72  | 8,945,808.21   | 13,949,011.93  |
| 本期利润           | 2,456,171.44  | 5,844,879.28   | 8,301,050.72   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 32,871,502.95 | 67,210,891.78  | 100,082,394.73 |
| 其中：基金申购款       | 48,432,885.79 | 100,366,789.34 | 148,799,675.13 |

|         |                |                |                |
|---------|----------------|----------------|----------------|
| 基金赎回款   | -15,561,382.84 | -33,155,897.56 | -48,717,280.40 |
| 本期已分配利润 | -              | -              | -              |
| 本期末     | 40,330,878.11  | 82,001,579.27  | 122,332,457.38 |

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|-----------|----------------------------------|----------------------------------|
|           | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 活期存款利息收入  | 16,201.65                        | 33,810.15                        |
| 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 | 16,155.49                        | 90,817.26                        |
| 其他        | 8,047.40                         | 3,668.69                         |
| 合计        | 40,404.54                        | 128,296.10                       |

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|------------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                  | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -39,631,343.76                   | -75,269,655.91                   |
| 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               | -39,631,343.76                   | -75,269,655.91                   |

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|------------|----------------------------------|----------------------------------|
|            | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |
| 卖出股票成交总额   | 558,788,252.79                   | 597,455,331.54                   |
| 减：卖出股票成本总额 | 597,531,594.86                   | 671,860,808.63                   |
| 减：交易费用     | 888,001.69                       | 864,178.82                       |
| 买卖股票差价收入   | -39,631,343.76                   | -75,269,655.91                   |

## 7.4.7.11 债券投资收益

## 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31<br>日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 20,768,023.67                   | 18,668,784.48                        |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 53,391,810.49                   | 23,106,403.00                        |
| 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                           | 74,159,834.16                   | 41,775,187.48                        |

## 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31<br>日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,966,703,952.82                | 1,035,982,277.98                     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,899,922,087.44                | 1,005,499,456.20                     |
| 减：应计利息总额               | 13,328,837.35                   | 7,327,087.18                         |
| 减：交易费用                 | 61,217.54                       | 49,331.60                            |
| 买卖债券差价收入               | 53,391,810.49                   | 23,106,403.00                        |

## 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

## 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

## 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2025年1月1日至2025年12月31日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 12,792,944.85               | 21,652,723.89                    |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 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            | 12,792,944.85 | 21,652,723.89 |

## 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2025年1月1日至2025年12月31日 | 2024年1月1日至2024年12月31日 |
| 1.交易性金融资产              | 105,353,431.02        | 132,452,843.01        |
| ——股票投资                 | 112,591,056.10        | 102,100,677.42        |
| ——债券投资                 | -7,237,625.08         | 30,352,165.59         |
| ——资产支持证券投资             | -                     | -                     |
| ——基金投资                 | -                     | -                     |
| ——贵金属投资                | -                     | -                     |
| ——其他                   | -                     | -                     |
| 2.衍生工具                 | -                     | -                     |
| ——权证投资                 | -                     | -                     |
| 3.其他                   | -                     | -                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                     | -                     |
| 合计                     | 105,353,431.02        | 132,452,843.01        |

## 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                    | 上年度可比期间               |
|---------|-----------------------|-----------------------|
|         | 2025年1月1日至2025年12月31日 | 2024年1月1日至2024年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 250,242.96            | 175,143.27            |
| 合计      | 250,242.96            | 175,143.27            |

## 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

## 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------|-----------------------|-----------------------|
|          | 2025年1月1日至2025年12月31日 | 2024年1月1日至2024年12月31日 |
| 审计费用     | 63,000.00             | 63,000.00             |
| 信息披露费    | 120,000.00            | 120,000.00            |
| 证券出借违约金  | -                     | -                     |
| 银行间账户维护费 | 36,000.00             | 36,000.00             |
| 银行汇划费    | 32,446.90             | 24,048.91             |
| 其他       | 1,200.00              | 1,200.00              |
| 合计       | 252,646.90            | 244,248.91            |

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1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。

##### 7.4.8.2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。

#### 7.4.9关联方关系

| 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 |
| 中国农业银行股份有限公司        | 基金托管人、基金销售机构        |
| 广发证券股份有限公司          | 基金管理人股东、基金销售机构      |
| 广东粤财信托有限公司          | 基金管理人股东             |
| 广东省广晟控股集团有限公司       | 基金管理人股东             |
| 广州市广永国有资产经营有限公司     | 基金管理人股东             |
| 盈峰集团有限公司            | 基金管理人股东             |
| 珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）   | 基金管理人股东             |
| 珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）   | 基金管理人股东             |
| 珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）   | 基金管理人股东             |
| 珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）   | 基金管理人股东             |
| 珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）   | 基金管理人股东             |
| 珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）   | 基金管理人股东             |
| 易方达资产管理有限公司         | 基金管理人的子公司           |
| 易方达私募基金管理有限公司       | 基金管理人的子公司           |
| 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    |
| 易方达国际控股有限公司         | 基金管理人的子公司           |
| 易方达资产管理（香港）有限公司     | 基金管理人子公司控制的公司       |
| 易方达资产管理（新加坡）有限公司    | 基金管理人子公司控制的公司       |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
|                  | 2025年1月1日至2025年12月31日 | 2024年1月1日至2024年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 13,983,555.74         | 17,782,677.12         |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 3,267,255.90          | 4,045,609.72          |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 10,716,299.84         | 13,737,067.40         |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.90% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
|                | 2025年1月1日至2025年12月31日 | 2024年1月1日至2024年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,107,456.92          | 3,951,706.03          |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 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<br>2025年1月1日至2025年12月31日      |             |            |
|----------------|----------------------------------|-------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |             |            |
|                | 易方达安盈回报混合 A                      | 易方达安盈回报混合 C | 合计         |
| 易方达基金管理有限公司    | -                                | 340,789.40  | 340,789.40 |
| 合计             | -                                | 340,789.40  | 340,789.40 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |             |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |             |            |
|                | 易方达安盈回报混合 A                      | 易方达安盈回报混合 C | 合计         |
| 易方达基金管理有限公司    | -                                | 3,713.81    | 3,713.81   |
| 合计             | -                                | 3,713.81    | 3,713.81   |

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。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                  | 本期                    |                | 上年度可比期间               |                |
|---------------------|-----------------------|----------------|-----------------------|----------------|
|                     | 2025年1月1日至2025年12月31日 |                | 2024年1月1日至2024年12月31日 |                |
|                     | 易方达安盈回报混<br>合A        | 易方达安盈回报混<br>合C | 易方达安盈回报混<br>合A        | 易方达安盈回报混<br>合C |
| 报告期初持有的基金份额         | 97,617,727.45         | -              | 97,617,727.45         | -              |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                     | -              | -                     | -              |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                     | -              | -                     | -              |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                     | -              | -                     | -              |
| 报告期末持有的基金份额         | 97,617,727.45         | -              | 97,617,727.45         | -              |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 19.8953%              | -              | 11.9867%              | -              |

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

##### 7.4.10.5.2 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

易方达安盈回报混合 A

无。

易方达安盈回报混合 C

无。

## 7.4.10.6 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<br>2025年1月1日至2025年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |           |
|-------------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
|             | 期末余额                        | 当期利息收入    | 期末余额                             | 当期利息收入    |
| 中国农业银行-活期存款 | 1,007,784.31                | 16,201.65 | 1,778,230.60                     | 33,810.15 |

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

## 7.4.10.7 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<br>2025年1月1日至2025年12月31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：<br>股/张） | 总金额        |
| 万联证券股份有限公司                       | 001396 | 誉帆科技 | 新股发行 | 688            | 15,335.52  |
| 广发证券股份有限公司                       | 301662 | 宏工科技 | 新股发行 | 1,429          | 38,011.40  |
| 广发证券股份有限公司                       | 688795 | 摩尔线程 | 新股发行 | 8,507          | 972,179.96 |
| 广发证券股份有限公司                       | 688805 | 健信超导 | 新股发行 | 2,643          | 49,106.94  |
| 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年12月31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：<br>股/张） | 总金额        |
| -                                | -      | -    | -    | -              | -          |

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

易方达安盈回报混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达安盈回报混合 C

本报告期内未发生利润分配。

#### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 001221               | 悍高集团 | 2025-07-23 | 6 个月 | 新股流通受限 | 15.43 | 56.94  | 160      | 2,468.80  | 9,110.40   | -  |
| 001233               | 海安集团 | 2025-11-18 | 6 个月 | 新股流通受限 | 48.00 | 51.88  | 367      | 17,616.00 | 19,039.96  | -  |
| 001280               | 中国铝业 | 2025-11-25 | 6 个月 | 新股流通受限 | 17.89 | 45.36  | 2,277    | 40,735.53 | 103,284.72 | -  |
| 001285               | 瑞立科密 | 2025-09-23 | 6 个月 | 新股流通受限 | 42.28 | 56.08  | 137      | 5,792.36  | 7,682.96   | -  |
| 001369               | 双欣环保 | 2025-12-23 | 6 个月 | 新股流通受限 | 6.85  | 12.89  | 897      | 6,144.45  | 11,562.33  | -  |
| 001386               | 马可波罗 | 2025-10-15 | 6 个月 | 新股流通受限 | 13.75 | 18.53  | 1,626    | 22,357.50 | 30,129.78  | -  |
| 001388               | 信通电子 | 2025-06-24 | 6 个月 | 新股流通受限 | 16.42 | 42.94  | 94       | 1,543.48  | 4,036.36   | -  |
| 001396               | 誉帆科技 | 2025-12-23 | 6 个月 | 新股流通受限 | 22.29 | 35.39  | 69       | 1,538.01  | 2,441.91   | -  |
| 301563               | 云汉   | 2025-09-23 | 6 个月 | 新股     | 27.00 | 133.6  | 110      | 2,970.00  | 14,705.90  | -  |

|        |      |            |      |        |       |       |         |            |              |   |
|--------|------|------------|------|--------|-------|-------|---------|------------|--------------|---|
|        | 芯城   |            |      | 流通受限   |       | 9     |         |            |              |   |
| 301575 | 艾芬达  | 2025-09-03 | 6 个月 | 新股流通受限 | 27.69 | 49.55 | 126     | 3,488.94   | 6,243.30     | - |
| 301584 | 建发致新 | 2025-09-18 | 6 个月 | 新股流通受限 | 7.05  | 26.82 | 447     | 3,151.35   | 11,988.54    | - |
| 301609 | 山大电力 | 2025-07-16 | 6 个月 | 新股流通受限 | 14.66 | 40.99 | 277     | 4,060.82   | 11,354.23    | - |
| 301632 | 广东建科 | 2025-08-05 | 6 个月 | 新股流通受限 | 6.56  | 23.68 | 656     | 4,303.36   | 15,534.08    | - |
| 301638 | 南网数字 | 2025-11-11 | 6 个月 | 新股流通受限 | 5.69  | 14.21 | 2,322   | 13,212.18  | 32,995.62    | - |
| 301656 | 联合动力 | 2025-09-17 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.48 | 25.46 | 7,395   | 92,289.60  | 188,276.70   | - |
| 301667 | 纳百川  | 2025-12-10 | 6 个月 | 新股流通受限 | 22.63 | 57.07 | 151     | 3,417.13   | 8,617.57     | - |
| 301668 | 昊创瑞通 | 2025-09-15 | 6 个月 | 新股流通受限 | 21.00 | 44.80 | 165     | 3,465.00   | 7,392.00     | - |
| 301687 | 新广益  | 2025-12-24 | 6 个月 | 新股流通受限 | 21.93 | 54.39 | 195     | 4,276.35   | 10,606.05    | - |
| 600930 | 华电新能 | 2025-07-09 | 6 个月 | 新股流通受限 | 3.18  | 6.24  | 254,555 | 809,484.90 | 1,588,423.20 | - |
| 601026 | 道生天合 | 2025-10-09 | 6 个月 | 新股流通受限 | 5.98  | 14.28 | 451     | 2,696.98   | 6,440.28     | - |
| 603092 | 德力佳  | 2025-10-30 | 6 个月 | 新股流通受限 | 46.68 | 55.66 | 146     | 6,815.28   | 8,126.36     | - |
| 603175 | 超颖电子 | 2025-10-17 | 6 个月 | 新股流通受限 | 17.08 | 48.56 | 169     | 2,886.52   | 8,206.64     | - |
| 603248 | 锡华科技 | 2025-12-16 | 6 个月 | 新股流通受限 | 10.10 | 16.30 | 260     | 2,626.00   | 4,238.00     | - |

|        |      |            |      |        |        |        |        |            |              |   |
|--------|------|------------|------|--------|--------|--------|--------|------------|--------------|---|
| 603262 | 技源集团 | 2025-07-16 | 6 个月 | 新股流通受限 | 10.88  | 28.10  | 155    | 1,686.40   | 4,355.50     | - |
| 603334 | 丰倍生物 | 2025-10-29 | 6 个月 | 新股流通受限 | 24.49  | 32.82  | 88     | 2,155.12   | 2,888.16     | - |
| 603370 | 华新精科 | 2025-08-27 | 6 个月 | 新股流通受限 | 18.60  | 46.35  | 82     | 1,525.20   | 3,800.70     | - |
| 603376 | 大明电子 | 2025-10-28 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.55  | 26.21  | 111    | 1,393.05   | 2,909.31     | - |
| 603406 | 天富龙  | 2025-07-30 | 6 个月 | 新股流通受限 | 23.60  | 40.16  | 153    | 3,610.80   | 6,144.48     | - |
| 603418 | 友升股份 | 2025-09-16 | 6 个月 | 新股流通受限 | 46.36  | 59.06  | 139    | 6,444.04   | 8,209.34     | - |
| 688727 | 恒坤新材 | 2025-11-11 | 6 个月 | 新股流通受限 | 14.99  | 34.87  | 563    | 8,439.37   | 19,631.81    | - |
| 688729 | 屹唐股份 | 2025-07-01 | 6 个月 | 新股流通受限 | 8.45   | 24.28  | 3,505  | 29,617.25  | 85,101.40    | - |
| 688759 | 必贝特  | 2025-10-21 | 9 个月 | 新股流通受限 | 17.78  | 25.13  | 12,552 | 223,174.56 | 315,431.76   | - |
| 688783 | 西安奕材 | 2025-10-20 | 9 个月 | 新股流通受限 | 8.62   | 18.39  | 44,370 | 382,469.40 | 815,964.30   | - |
| 688790 | 昂瑞微  | 2025-12-09 | 9 个月 | 新股流通受限 | 83.06  | 117.07 | 2,319  | 192,616.14 | 271,485.33   | - |
| 688795 | 摩尔线程 | 2025-11-26 | 9 个月 | 新股流通受限 | 114.28 | 416.02 | 5,955  | 680,537.40 | 2,477,399.10 | - |
| 688796 | 百奥赛图 | 2025-12-02 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.68  | 42.25  | 423    | 11,285.64  | 17,871.75    | - |
| 688802 | 沐曦股份 | 2025-12-09 | 9 个月 | 新股流通受限 | 104.66 | 399.40 | 3,994  | 418,012.04 | 1,595,203.60 | - |
| 688805 | 健信超导 | 2025-12-17 | 6 个月 | 新股流通   | 18.58  | 32.37  | 265    | 4,923.70   | 8,578.05     | - |

|        |        |            |      |           |       |        |           |              |              |   |
|--------|--------|------------|------|-----------|-------|--------|-----------|--------------|--------------|---|
| 688807 | 优迅股份   | 2025-12-10 | 6 个月 | 受限新股流通受限  | 51.66 | 135.56 | 131       | 6,767.46     | 17,758.36    | - |
| 688809 | 强一股份   | 2025-12-23 | 6 个月 | 受限新股流通受限  | 85.09 | 203.31 | 259       | 22,038.31    | 52,657.29    | - |
| 000100 | TCL 科技 | 2025-08-15 | 6 个月 | 非公开发行流通受限 | 4.21  | 4.44   | 1,283,525 | 5,403,640.25 | 5,698,851.00 | - |

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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为 0，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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 64,989,481.31 元，于 2026 年 1 月 5 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。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。

#### 7.4.13.2 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 2025 年 12 月 31 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 51.80%(2024 年 12 月 31 日：65.52%)。

##### 7.4.13.2.1 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<br>2025年12月31日 | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00               | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00               | 0.00                |
| 未评级    | 74,863,013.15      | 100,862,490.41      |
| 合计     | 74,863,013.15      | 100,862,490.41      |

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。

##### 7.4.13.2.2 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<br>2025年12月31日 | 上年度末<br>2024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 |

## 7.4.13.2.3 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<br>2025年12月31日 | 上年度末<br>2024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                |

## 7.4.13.2.4 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<br>2025年12月31日 | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 344,762,517.80     | 701,493,252.56      |
| AAA 以下 | 278,422,446.25     | 464,175,750.31      |
| 未评级    | 86,163,560.00      | 0.00                |
| 合计     | 709,348,524.05     | 1,165,669,002.87    |

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。

## 7.4.13.2.5 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<br>2025年12月31日 | 上年度末<br>2024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 |
|----|------|------|

#### 7.4.13.2.6 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<br>2025年12月31日 | 上年度末<br>2024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                |

#### 7.4.13.3 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 2025 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接

受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025年12月31<br>日 | 1年以内           | 1-5年           | 5年以上          | 不计息            | 合计               |
|------------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 资产                     |                |                |               |                |                  |
| 货币资金                   | 1,007,784.31   | -              | -             | -              | 1,007,784.31     |
| 结算备付金                  | 4,783,483.13   | -              | -             | -              | 4,783,483.13     |
| 存出保证金                  | 301,126.48     | -              | -             | -              | 301,126.48       |
| 交易性金融资产                | 110,831,823.67 | 574,485,633.15 | 98,894,080.38 | 648,810,498.12 | 1,433,022,035.32 |
| 衍生金融资产                 | -              | -              | -             | -              | -                |
| 买入返售金融资产               | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应收清算款                  | -              | -              | -             | 16,082,048.31  | 16,082,048.31    |
| 应收股利                   | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应收申购款                  | -              | -              | -             | 303,206.24     | 303,206.24       |
| 递延所得税资产                | -              | -              | -             | -              | -                |
| 其他资产                   | -              | -              | -             | -              | -                |
| 资产总计                   | 116,924,217.59 | 574,485,633.15 | 98,894,080.38 | 665,195,752.67 | 1,455,499,683.79 |
| 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               | 64,989,481.31  | -              | -             | -              | 64,989,481.31    |
| 应付清算款                   | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应付赎回款                   | -              | -              | -             | 19,224,286.19  | 19,224,286.19    |
| 应付管理人报酬                 | -              | -              | -             | 1,067,467.16   | 1,067,467.16     |
| 应付托管费                   | -              | -              | -             | 237,214.91     | 237,214.91       |
| 应付销售服务费                 | -              | -              | -             | 72,625.64      | 72,625.64        |
| 应付投资顾问费                 | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应交税费                    | -              | -              | -             | 20,186.55      | 20,186.55        |
| 应付利润                    | -              | -              | -             | -              | -                |
| 递延所得税负债                 | -              | -              | -             | -              | -                |
| 其他负债                    | -              | -              | -             | 496,947.74     | 496,947.74       |
| 负债总计                    | 64,989,481.31  | -              | -             | 21,118,728.19  | 86,108,209.50    |
| 利率敏感度缺口                 | 51,934,736.28  | 574,485,633.15 | 98,894,080.38 | 644,077,024.48 | 1,369,391,474.29 |
| <b>上年度末</b>             |                |                |               |                |                  |
| <b>2024 年 12 月 31 日</b> | <b>1 年以内</b>   | <b>1-5 年</b>   | <b>5 年以上</b>  | <b>不计息</b>     | <b>合计</b>        |
| 资产                      |                |                |               |                |                  |
| 货币资金                    | 1,778,230.60   | -              | -             | -              | 1,778,230.60     |
| 结算备付金                   | 6,750,846.19   | -              | -             | -              | 6,750,846.19     |
| 存出保证金                   | 133,699.91     | -              | -             | -              | 133,699.91       |
| 交易性金融资产                 | 262,989,270.78 | 954,538,987.30 | 49,003,235.20 | 448,871,945.16 | 1,715,403,438.44 |
| 衍生金融资产                  | -              | -              | -             | -              | -                |
| 买入返售金融资产                | 147,008,712.91 | -              | -             | -              | 147,008,712.91   |
| 应收清算款                   | -              | -              | -             | 2,602,050.13   | 2,602,050.13     |
| 应收股利                    | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应收申购款                   | -              | -              | -             | 143,669.91     | 143,669.91       |
| 递延所得税资产                 | -              | -              | -             | -              | -                |
| 其他资产                    | -              | -              | -             | -              | -                |
| 资产总计                    | 418,660,760.39 | 954,538,987.30 | 49,003,235.20 | 451,617,665.20 | 1,873,820,648.09 |

|           |                |                |               |                |                  |
|-----------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 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 | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应付清算款     | -              | -              | -             | 1,254,602.29   | 1,254,602.29     |
| 应付赎回款     | -              | -              | -             | 91,197,297.68  | 91,197,297.68    |
| 应付管理人报酬   | -              | -              | -             | 1,430,050.61   | 1,430,050.61     |
| 应付托管费     | -              | -              | -             | 317,789.01     | 317,789.01       |
| 应付销售服务费   | -              | -              | -             | 8,851.86       | 8,851.86         |
| 应付投资顾问费   | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应交税费      | -              | -              | -             | 15,855.71      | 15,855.71        |
| 应付利润      | -              | -              | -             | -              | -                |
| 递延所得税负债   | -              | -              | -             | -              | -                |
| 其他负债      | -              | -              | -             | 391,679.04     | 391,679.04       |
| 负债总计      | -              | -              | -             | 94,616,126.20  | 94,616,126.20    |
| 利率敏感度缺口   | 418,660,760.39 | 954,538,987.30 | 49,003,235.20 | 357,001,539.00 | 1,779,204,521.89 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                     |
|               |                    | 本期末<br>2025年12月31日              | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|               | 1.市场利率下降25个基点      | 1,505,007.23                    | 1,352,223.64        |
| 2.市场利率上升25个基点 | -1,495,711.62      | -1,344,761.69                   |                     |

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |                          |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 648,810,498.12          | 47.38                    | 448,871,945.16           | 25.23                    |
| 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            | 648,810,498.12          | 47.38                    | 448,871,945.16           | 25.23                    |

#### 7.4.13.4.3.2 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|               |                      | 本期末<br>2025 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|               | 1.业绩比较基准上升 5%        | 233,673,562.41                  | 213,053,525.13           |
| 2.业绩比较基准下降 5% | -233,673,562.41      | -213,053,525.13                 |                          |

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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<br>2025 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 1,017,982,667.21        | 1,237,543,824.84         |
| 第二层次          | 401,524,689.98          | 477,437,664.54           |
| 第三层次          | 13,514,678.13           | 421,949.06               |
| 合计            | 1,433,022,035.32        | 1,715,403,438.44         |

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日 |               | 合计            |
|------------------------------|--|---------------|---------------|
|                              | 交易性金融资产                                |               |               |
|                              | 债券投资                                   | 股票投资          |               |
| 期初余额                         | -                                      | 421,949.06    | 421,949.06    |
| 当期购买                         | -                                      | 21,666,444.55 | 21,666,444.55 |
| 当期出售/结算                      | -                                      | -             | -             |
| 转入第三层次                       | -                                      | -             | -             |
| 转出第三层次                       | -                                      | 25,289,414.42 | 25,289,414.42 |
| 当期利得或损失总额                    | -                                      | 16,715,698.94 | 16,715,698.94 |
| 其中：计入损益的利得或损失                | -                                      | 16,715,698.94 | 16,715,698.94 |
| 计入其他综合收益的利得或损失（若有）           | -                                      | -             | -             |
| 期末余额                         | -                                      | 13,514,678.13 | 13,514,678.13 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损 | -                                      | 5,057,001.46  | 5,057,001.46  |

|  |   |              |              |
|--|---|--------------|--------------|
| 失的变动——公允价值变动损益                             |   |              |              |
| 项目   | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |              |              |
|  | 交易性金融资产                                     |              | 合计           |
|  | 债券投资  | 股票投资         |              |
| 期初余额                                       | -   | 3,698,181.74 | 3,698,181.74 |
| 当期购买                                       | -   | 456,240.20   | 456,240.20   |
| 当期出售/结算                                    | -   | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -   | -            | -            |
| 转出第三层次                                     | -   | 3,492,780.69 | 3,492,780.69 |
| 当期利得或损失总额                                  | -   | -239,692.19  | -239,692.19  |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -   | -239,692.19  | -239,692.19  |
| 计入其他综合收益的利得或损失（若有）                         | -   | -            | -            |
| 期末余额                                       | -   | 421,949.06   | 421,949.06   |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -   | 231,759.11   | 231,759.11   |

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目                | 本期末公允价值       | 采用的估值技术    | 不可观察输入值 |               |            |
|-------------------|---------------|------------|---------|---------------|------------|
|                   |               |            | 名称      | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 流动性折扣估值处于限售期的股票投资 | 13,514,678.13 | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 0.1628—3.0323 | 负相关        |
| 项目                | 上年度末公允价值      | 采用的估值技术    | 不可观察输入值 |               |            |
|                   |               |            | 名称      | 范围/加权平均值      | 与公允价值之间的关系 |
| 流动性折扣估值处于限售期的股票投资 | 421,949.06    | 平均价格亚式期权模型 | 预期年化波动率 | 0.3423—4.9648 | 负相关        |

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

## 7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

## 8.1 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              | 648,810,498.12   | 44.58         |
|    | 其中：股票             | 648,810,498.12   | 44.58         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 784,211,537.20   | 53.88         |
|    | 其中：债券             | 784,211,537.20   | 53.88         |
|    | 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      | 5,791,267.44     | 0.40          |
| 8  | 其他各项资产            | 16,686,381.03    | 1.15          |
| 9  | 合计                | 1,455,499,683.79 | 100.00        |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 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      | 103,284.72     | 0.01          |
| C  | 制造业      | 466,060,214.29 | 34.03         |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,588,423.20   | 0.12  |
| E | 建筑业              | -              | -     |
| F | 批发和零售业           | 26,694.44      | 0.00  |
| 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  | 124,718,336.13 | 9.11  |
| J | 金融业              | 26,607,600.00  | 1.94  |
| 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       | 29,705,945.34  | 2.17  |
| 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               | 648,810,498.12 | 47.38 |

### 8.3 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  | 600486 | 扬农化工 | 944,663   | 65,550,165.57 | 4.79         |
| 2  | 300408 | 三环集团 | 1,425,996 | 65,239,317.00 | 4.76         |
| 3  | 688256 | 寒武纪  | 44,609    | 60,469,729.95 | 4.42         |
| 4  | 002475 | 立讯精密 | 1,060,100 | 60,118,271.00 | 4.39         |
| 5  | 688188 | 柏楚电子 | 291,981   | 39,677,298.09 | 2.90         |
| 6  | 300502 | 新易盛  | 89,711    | 38,654,675.68 | 2.82         |
| 7  | 300750 | 宁德时代 | 94,000    | 34,522,440.00 | 2.52         |
| 8  | 603893 | 瑞芯微  | 178,900   | 31,894,292.00 | 2.33         |
| 9  | 603259 | 药明康德 | 327,340   | 29,670,097.60 | 2.17         |
| 10 | 002371 | 北方华创 | 61,100    | 28,049,788.00 | 2.05         |
| 11 | 000977 | 浪潮信息 | 414,400   | 27,599,040.00 | 2.02         |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 389,000   | 26,607,600.00 | 1.94         |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 13 | 002311 | 海大集团   | 476,000   | 26,360,880.00 | 1.93 |
| 14 | 688521 | 芯原股份   | 179,151   | 24,538,312.47 | 1.79 |
| 15 | 688617 | 惠泰医疗   | 90,065    | 21,910,112.55 | 1.60 |
| 16 | 300274 | 阳光电源   | 94,570    | 16,175,252.80 | 1.18 |
| 17 | 600522 | 中天科技   | 799,900   | 14,494,188.00 | 1.06 |
| 18 | 688041 | 海光信息   | 61,408    | 13,780,569.28 | 1.01 |
| 19 | 000703 | 恒逸石化   | 927,000   | 9,983,790.00  | 0.73 |
| 20 | 000100 | TCL 科技 | 1,283,525 | 5,698,851.00  | 0.42 |
| 21 | 688795 | 摩尔线程   | 5,955     | 2,477,399.10  | 0.18 |
| 22 | 688802 | 沐曦股份   | 3,994     | 1,595,203.60  | 0.12 |
| 23 | 600930 | 华电新能   | 254,555   | 1,588,423.20  | 0.12 |
| 24 | 688783 | 西安奕材   | 44,370    | 815,964.30    | 0.06 |
| 25 | 688759 | 必贝特    | 12,552    | 315,431.76    | 0.02 |
| 26 | 688790 | 昂瑞微    | 2,319     | 271,485.33    | 0.02 |
| 27 | 301656 | 联合动力   | 7,395     | 188,276.70    | 0.01 |
| 28 | 001280 | 中国铀业   | 2,277     | 103,284.72    | 0.01 |
| 29 | 688729 | 屹唐股份   | 3,505     | 85,101.40     | 0.01 |
| 30 | 688809 | 强一股份   | 259       | 52,657.29     | 0.00 |
| 31 | 301638 | 南网数字   | 2,322     | 32,995.62     | 0.00 |
| 32 | 001386 | 马可波罗   | 1,626     | 30,129.78     | 0.00 |
| 33 | 688727 | 恒坤新材   | 563       | 19,631.81     | 0.00 |
| 34 | 001233 | 海安集团   | 367       | 19,039.96     | 0.00 |
| 35 | 688796 | 百奥赛图   | 423       | 17,871.75     | 0.00 |
| 36 | 688807 | 优迅股份   | 131       | 17,758.36     | 0.00 |
| 37 | 301632 | 广东建科   | 656       | 15,534.08     | 0.00 |
| 38 | 301563 | 云汉芯城   | 110       | 14,705.90     | 0.00 |
| 39 | 301584 | 建发致新   | 447       | 11,988.54     | 0.00 |
| 40 | 001369 | 双欣环保   | 897       | 11,562.33     | 0.00 |
| 41 | 301609 | 山大电力   | 277       | 11,354.23     | 0.00 |
| 42 | 301687 | 新广益    | 195       | 10,606.05     | 0.00 |
| 43 | 001221 | 悍高集团   | 160       | 9,110.40      | 0.00 |
| 44 | 301667 | 纳百川    | 151       | 8,617.57      | 0.00 |
| 45 | 688805 | 健信超导   | 265       | 8,578.05      | 0.00 |
| 46 | 603418 | 友升股份   | 139       | 8,209.34      | 0.00 |
| 47 | 603175 | 超颖电子   | 169       | 8,206.64      | 0.00 |
| 48 | 603092 | 德力佳    | 146       | 8,126.36      | 0.00 |
| 49 | 001285 | 瑞立科密   | 137       | 7,682.96      | 0.00 |
| 50 | 301668 | 昊创瑞通   | 165       | 7,392.00      | 0.00 |
| 51 | 601026 | 道生天合   | 451       | 6,440.28      | 0.00 |
| 52 | 301575 | 艾芬达    | 126       | 6,243.30      | 0.00 |
| 53 | 603406 | 天富龙    | 153       | 6,144.48      | 0.00 |
| 54 | 603262 | 技源集团   | 155       | 4,355.50      | 0.00 |
| 55 | 603248 | 锡华科技   | 260       | 4,238.00      | 0.00 |
| 56 | 001388 | 信通电子   | 94        | 4,036.36      | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 57 | 603370 | 华新精科 | 82  | 3,800.70 | 0.00 |
| 58 | 603376 | 大明电子 | 111 | 2,909.31 | 0.00 |
| 59 | 603334 | 丰倍生物 | 88  | 2,888.16 | 0.00 |
| 60 | 001396 | 誉帆科技 | 69  | 2,441.91 | 0.00 |

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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  | 688256 | 寒武纪  | 63,202,095.53 | 3.55            |
| 2  | 002475 | 立讯精密 | 61,561,420.00 | 3.46            |
| 3  | 002311 | 海大集团 | 54,944,761.86 | 3.09            |
| 4  | 603259 | 药明康德 | 54,703,804.60 | 3.07            |
| 5  | 300750 | 宁德时代 | 39,535,951.64 | 2.22            |
| 6  | 603893 | 瑞芯微  | 31,183,388.00 | 1.75            |
| 7  | 002371 | 北方华创 | 28,203,495.80 | 1.59            |
| 8  | 600028 | 中国石化 | 28,139,386.68 | 1.58            |
| 9  | 300502 | 新易盛  | 28,031,000.72 | 1.58            |
| 10 | 000977 | 浪潮信息 | 27,929,436.47 | 1.57            |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 27,917,342.00 | 1.57            |
| 12 | 002714 | 牧原股份 | 27,343,496.16 | 1.54            |
| 13 | 688617 | 惠泰医疗 | 27,308,057.89 | 1.53            |
| 14 | 300832 | 新产业  | 20,494,255.10 | 1.15            |
| 15 | 600809 | 山西汾酒 | 17,096,649.40 | 0.96            |
| 16 | 688188 | 柏楚电子 | 16,299,833.40 | 0.92            |
| 17 | 600522 | 中天科技 | 15,926,119.02 | 0.90            |
| 18 | 300274 | 阳光电源 | 15,297,926.30 | 0.86            |
| 19 | 688041 | 海光信息 | 13,842,321.01 | 0.78            |
| 20 | 300408 | 三环集团 | 13,657,337.50 | 0.77            |

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。

##### 8.4.2 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  | 600036 | 招商银行 | 65,070,185.19 | 3.66            |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 45,661,135.00 | 2.57            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 3  | 600486 | 扬农化工 | 41,914,040.86 | 2.36 |
| 4  | 603259 | 药明康德 | 41,909,283.00 | 2.36 |
| 5  | 300750 | 宁德时代 | 29,338,239.00 | 1.65 |
| 6  | 600028 | 中国石化 | 27,607,863.40 | 1.55 |
| 7  | 002714 | 牧原股份 | 26,953,149.64 | 1.51 |
| 8  | 600976 | 健民集团 | 26,802,827.00 | 1.51 |
| 9  | 002352 | 顺丰控股 | 25,751,368.48 | 1.45 |
| 10 | 002311 | 海大集团 | 25,240,817.40 | 1.42 |
| 11 | 600900 | 长江电力 | 22,092,933.00 | 1.24 |
| 12 | 300832 | 新产业  | 20,501,268.80 | 1.15 |
| 13 | 600989 | 宝丰能源 | 20,005,454.00 | 1.12 |
| 14 | 601088 | 中国神华 | 19,960,305.00 | 1.12 |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 17,563,061.00 | 0.99 |
| 16 | 600809 | 山西汾酒 | 16,127,844.00 | 0.91 |
| 17 | 601318 | 中国平安 | 15,581,394.00 | 0.88 |
| 18 | 688188 | 柏楚电子 | 15,247,690.81 | 0.86 |
| 19 | 600276 | 恒瑞医药 | 13,596,680.56 | 0.76 |
| 20 | 601225 | 陕西煤业 | 13,189,405.00 | 0.74 |

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。

#### 8.4.3 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 | 684,879,091.72 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 558,788,252.79 |

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。

#### 8.5 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 189,550,495.34 | 13.84        |
|    | 其中：政策性金融债 | 74,863,013.15  | 5.47         |
| 4  | 企业债券      | 50,566,558.36  | 3.69         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 6  | 中期票据      | 157,301,746.31 | 11.49 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 386,792,737.19 | 28.25 |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 784,211,537.20 | 57.27 |

#### 8.6 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  | 250304    | 25 进出 04           | 630,000 | 63,776,021.92 | 4.66         |
| 2  | 2228039   | 22 建设银行二级 01       | 500,000 | 52,133,602.74 | 3.81         |
| 3  | 102582121 | 25 先正达 MTN002(科创债) | 400,000 | 40,482,474.52 | 2.96         |
| 4  | 123107    | 温氏转债               | 309,739 | 40,184,536.51 | 2.93         |
| 5  | 110081    | 闻泰转债               | 318,260 | 36,698,368.77 | 2.68         |

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，温氏食品集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到广东省云浮市新兴县新城镇人民政府的处罚。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。中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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 | 301,126.48    |
| 2  | 应收清算款 | 16,082,048.31 |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 303,206.24    |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 16,686,381.03 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值          | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------------|
| 1  | 123107 | 温氏转债 | 40,184,536.51 | 2.93                 |
| 2  | 110081 | 闻泰转债 | 36,698,368.77 | 2.68                 |
| 3  | 127045 | 牧原转债 | 33,281,598.46 | 2.43                 |
| 4  | 113691 | 和邦转债 | 21,002,866.95 | 1.53                 |

|    |        |          |               |      |
|----|--------|----------|---------------|------|
| 5  | 127050 | 麒麟转债     | 20,602,097.72 | 1.50 |
| 6  | 113042 | 上银转债     | 17,725,567.27 | 1.29 |
| 7  | 113052 | 兴业转债     | 17,519,885.67 | 1.28 |
| 8  | 118034 | 晶能转债     | 15,368,133.00 | 1.12 |
| 9  | 127061 | 美锦转债     | 14,218,875.26 | 1.04 |
| 10 | 127040 | 国泰转债     | 13,033,690.36 | 0.95 |
| 11 | 128141 | 旺能转债     | 11,773,095.14 | 0.86 |
| 12 | 127049 | 希望转 2    | 10,474,287.90 | 0.76 |
| 13 | 118031 | 天 23 转债  | 9,112,966.73  | 0.67 |
| 14 | 111018 | 华康转债     | 7,685,307.07  | 0.56 |
| 15 | 127089 | 晶澳转债     | 7,151,920.39  | 0.52 |
| 16 | 110067 | 华安转债     | 5,879,038.78  | 0.43 |
| 17 | 123178 | 花园转债     | 5,718,390.66  | 0.42 |
| 18 | 132026 | G 三峡 EB2 | 3,955,510.22  | 0.29 |
| 19 | 113037 | 紫银转债     | 3,799,522.95  | 0.28 |
| 20 | 127095 | 广泰转债     | 3,671,233.94  | 0.27 |
| 21 | 127103 | 东南转债     | 3,659,048.32  | 0.27 |
| 22 | 110093 | 神马转债     | 3,640,409.51  | 0.27 |
| 23 | 111017 | 蓝天转债     | 3,571,625.98  | 0.26 |
| 24 | 110094 | 众和转债     | 3,331,245.65  | 0.24 |
| 25 | 127027 | 能化转债     | 3,197,656.26  | 0.23 |
| 26 | 111019 | 宏柏转债     | 2,532,736.96  | 0.18 |
| 27 | 113682 | 益丰转债     | 2,396,199.45  | 0.17 |
| 28 | 118053 | 正帆转债     | 2,265,605.38  | 0.17 |
| 29 | 113058 | 友发转债     | 2,245,572.95  | 0.16 |
| 30 | 118042 | 奥维转债     | 2,220,904.00  | 0.16 |
| 31 | 123187 | 超达转债     | 2,153,657.14  | 0.16 |
| 32 | 113676 | 荣 23 转债  | 2,094,077.85  | 0.15 |
| 33 | 123254 | 亿纬转债     | 2,033,131.96  | 0.15 |
| 34 | 128119 | 龙大转债     | 2,003,752.60  | 0.15 |
| 35 | 123176 | 精测转 2    | 1,994,683.13  | 0.15 |
| 36 | 113666 | 爱玛转债     | 1,929,312.70  | 0.14 |
| 37 | 113605 | 大参转债     | 1,921,401.34  | 0.14 |
| 38 | 113043 | 财通转债     | 1,918,978.84  | 0.14 |
| 39 | 123085 | 万顺转 2    | 1,811,734.72  | 0.13 |
| 40 | 110097 | 天润转债     | 1,721,440.99  | 0.13 |
| 41 | 113647 | 禾丰转债     | 1,714,872.43  | 0.13 |
| 42 | 113648 | 巨星转债     | 1,706,063.05  | 0.12 |
| 43 | 113652 | 伟 22 转债  | 1,592,722.12  | 0.12 |
| 44 | 118038 | 金宏转债     | 1,544,480.64  | 0.11 |
| 45 | 110084 | 贵燃转债     | 1,544,224.22  | 0.11 |
| 46 | 113632 | 鹤 21 转债  | 1,541,874.54  | 0.11 |
| 47 | 111004 | 明新转债     | 1,539,864.25  | 0.11 |
| 48 | 110073 | 国投转债     | 1,529,091.12  | 0.11 |

|    |        |         |              |      |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 49 | 111005 | 富春转债    | 1,451,318.53 | 0.11 |
| 50 | 113670 | 金 23 转债 | 1,271,703.11 | 0.09 |
| 51 | 113667 | 春 23 转债 | 1,251,006.19 | 0.09 |
| 52 | 123225 | 翔丰转债    | 1,183,421.90 | 0.09 |
| 53 | 113059 | 福莱转债    | 1,163,479.51 | 0.08 |
| 54 | 118051 | 皓元转债    | 1,111,020.39 | 0.08 |
| 55 | 113049 | 长汽转债    | 1,108,994.02 | 0.08 |
| 56 | 123133 | 佩蒂转债    | 1,104,963.93 | 0.08 |
| 57 | 113056 | 重银转债    | 1,085,955.09 | 0.08 |
| 58 | 113657 | 再 22 转债 | 1,031,780.25 | 0.08 |
| 59 | 123247 | 万凯转债    | 963,836.93   | 0.07 |
| 60 | 118049 | 汇成转债    | 765,324.52   | 0.06 |
| 61 | 127082 | 亚科转债    | 761,325.75   | 0.06 |
| 62 | 113033 | 利群转债    | 756,742.56   | 0.06 |
| 63 | 127070 | 大中转债    | 743,969.96   | 0.05 |
| 64 | 127079 | 华亚转债    | 695,923.34   | 0.05 |
| 65 | 118009 | 华锐转债    | 695,467.67   | 0.05 |
| 66 | 118022 | 锂科转债    | 670,458.61   | 0.05 |
| 67 | 123251 | 华医转债    | 659,433.85   | 0.05 |
| 68 | 110090 | 爱迪转债    | 653,725.99   | 0.05 |
| 69 | 123114 | 三角转债    | 569,320.01   | 0.04 |
| 70 | 123252 | 银邦转债    | 548,810.15   | 0.04 |
| 71 | 113597 | 佳力转债    | 523,746.35   | 0.04 |
| 72 | 113656 | 嘉诚转债    | 501,133.48   | 0.04 |
| 73 | 123117 | 健帆转债    | 480,562.79   | 0.04 |
| 74 | 123236 | 家联转债    | 453,961.29   | 0.03 |
| 75 | 123243 | 严牌转债    | 427,713.73   | 0.03 |
| 76 | 123233 | 凯盛转债    | 410,249.67   | 0.03 |
| 77 | 123229 | 艾录转债    | 352,359.25   | 0.03 |
| 78 | 123146 | 中环转 2   | 345,621.85   | 0.03 |
| 79 | 123119 | 康泰转 2   | 333,113.78   | 0.02 |
| 80 | 118050 | 航宇转债    | 322,650.93   | 0.02 |
| 81 | 110077 | 洪城转债    | 293,420.44   | 0.02 |
| 82 | 113651 | 松霖转债    | 260,389.19   | 0.02 |
| 83 | 127030 | 盛虹转债    | 256,849.26   | 0.02 |
| 84 | 113654 | 永 02 转债 | 212,264.98   | 0.02 |
| 85 | 113661 | 福 22 转债 | 191,293.32   | 0.01 |
| 86 | 118045 | 盟升转债    | 189,010.06   | 0.01 |
| 87 | 118048 | 利扬转债    | 151,567.52   | 0.01 |
| 88 | 127015 | 希望转债    | 150,379.75   | 0.01 |
| 89 | 118030 | 睿创转债    | 118,398.40   | 0.01 |
| 90 | 110095 | 双良转债    | 115,530.90   | 0.01 |
| 91 | 127054 | 双箭转债    | 113,040.58   | 0.01 |
| 92 | 123255 | 鼎龙转债    | 65,862.76    | 0.00 |

|    |        |      |           |      |
|----|--------|------|-----------|------|
| 93 | 113631 | 皖天转债 | 62,372.80 | 0.00 |
|----|--------|------|-----------|------|

### 8.12.5 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 |
| 易方达安盈回报混合 A | 51,932   | 9,448.08   | 137,988,830.71 | 28.12% | 352,668,809.58 | 71.88% |
| 易方达安盈回报混合 C | 269      | 341,768.36 | 88,766,311.23  | 96.55% | 3,169,378.31   | 3.45%  |
| 合计          | 52,201   | 11,160.58  | 226,755,141.94 | 38.92% | 355,838,187.89 | 61.08% |

### 9.2 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 | 易方达安盈回报混合 A | 1,354,144.35 | 0.2760%  |
|                  | 易方达安盈回报混合 C | 29,995.63    | 0.0326%  |
|                  | 合计          | 1,384,139.98 | 0.2376%  |

### 9.3 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 易方达安盈回报混合 A | 0~10              |
|                              | 易方达安盈回报混合 C | 0                 |
|                              | 合计          | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金              | 易方达安盈回报混合 A | 50~100            |
|                              | 易方达安盈回报混合 C | 0                 |
|                              | 合计          | 50~100            |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 易方达安盈回报混合 A    | 易方达安盈回报混合 C    |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2017 年 2 月 16 日）基金份额总额 | 604,172,113.67 | -              |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 814,384,848.87 | 12,260,816.72  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 51,092,705.83  | 117,573,503.13 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 374,819,914.41 | 37,898,630.31  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 490,657,640.29 | 91,935,689.54  |

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 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。

## 11.2 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 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。本基金管理人于 2025 年 9 月 30 日发布公告，自 2025 年 9 月 29 日起张清华先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

## 11.3 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。

#### 11.4 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。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金已连续 2 年聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 63,000.00 元。

#### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

##### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

| 管理人受调查或处罚等情况          | 内容  |
|-----------------------|---|
| 受到调查或处罚等措施的主体         | 易方达基金管理有限公司   |
| 受到调查或处罚等措施的时间         | 2025 年 11 月 5 日   |
| 采取调查或处罚等措施的机构         | 中国证券监督管理委员会广东监管局  |
| 受到调查或处罚等措施类型          | 行政监管措施  |
| 受到的具体措施类型             | 出具警示函   |
| 受到调查或处罚等措施的原因         | 投资运作、合规内控、其他问题（销售管理）  |
| 受到处罚的依据               | 《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《货币市场基金监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 监管部门对管理人上述方面部分制度机制不完善、规定执行不严格提出整改意见，管理人已及时通过完善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改，整改成果已经监管部门验收通过。                                       |
| 其他                    | /   |

##### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，本基金相关从业人员未受到调查或处罚。

##### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

##### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 长江证券 | 1      | 283,379.52     | 0.02%        | 103.43     | 0.02%      | -  |
| 第一创业 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东方财富 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 方正证券 | 1      | 25,798,131.24  | 2.12%        | 11,247.99  | 2.12%      | -  |
| 国泰海通 | 2      | 407,679,340.26 | 33.50%       | 177,748.21 | 33.50%     | -  |
| 国投证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国信证券 | 1      | 194,587,335.22 | 15.99%       | 84,840.07  | 15.99%     | -  |
| 华泰证券 | 1      | 214,049,829.05 | 17.59%       | 93,325.55  | 17.59%     | -  |
| 瑞银证券 | 1      | 832,784.38     | 0.07%        | 363.15     | 0.07%      | -  |
| 申万宏源 | 2      | 52,631,332.27  | 4.33%        | 22,947.25  | 4.33%      | -  |
| 兴业证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 银河证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券 | 2      | 321,017,865.33 | 26.38%       | 139,964.38 | 26.38%     | -  |
| 中信证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为渤海证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、华西证券股份有限公司，无新增交易单元。国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司合并为国泰海通证券股份有限公司。

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。本年度内基金证券经营机构的选择标准有调整，调整后的标准如下：

- 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。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 长江证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 第一创业 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东方财富 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 方正证券 | 592,690,226.75 | 32.43%       | 1,243,400,000.00 | 12.89%         | -    | -            |
| 国泰海通 | 193,142,891.71 | 10.57%       | 3,382,502,000.00 | 35.07%         | -    | -            |
| 国投证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国信证券 | 151,799,362.27 | 8.31%        | 2,759,500,000.00 | 28.61%         | -    | -            |
| 华泰证券 | 164,619,482.00 | 9.01%        | 162,400,000.00   | 1.68%          | -    | -            |
| 瑞银证券 | 159,591,161.76 | 8.73%        | 34,600,000.00    | 0.36%          | -    | -            |
| 申万宏源 | 260,886,320.07 | 14.28%       | 1,744,300,000.00 | 18.09%         | -    | -            |
| 兴业证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 银河证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 招商证券 | 304,711,677.78 | 16.67%       | 317,400,000.00   | 3.29%          | -    | -            |
| 中信证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |

### 11.8 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旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告 | 证券时报                       | 2025-01-21 |
| 2  | 易方达基金管理有限公司董事长变更公告                  | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-03-22 |
| 3  | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告               | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-03-22 |
| 4  | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告               | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-03-22 |
| 5  | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告               | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金       | 2025-03-22 |

|    |  |                            |            |
|----|--|----------------------------|------------|
|    |  | 电子披露网站                     |            |
| 6  | 易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告                   | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-03-25 |
| 7  | 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（2024 年度）          | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站      | 2025-03-31 |
| 8  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告                      | 证券时报                       | 2025-03-31 |
| 9  | 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                           | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-04-11 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告                  | 证券时报                       | 2025-04-22 |
| 11 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-05-17 |
| 12 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配芯原股份（688521）非公开发行 A 股及关联交易事项的公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-06-28 |
| 13 | 易方达基金管理有限公司关于设立易方达财富管理基金销售（广州）有限公司的公告                | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-07-03 |
| 14 | 易方达基金管理有限公司关于董事变更情况的公告                               | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-07-10 |
| 15 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告                  | 证券时报                       | 2025-07-21 |
| 16 | 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                       | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-08-14 |
| 17 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配 TCL 科技（000100）非公开发行 A 股的公告     | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-08-16 |
| 18 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告                      | 证券时报                       | 2025-08-30 |
| 19 | 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                       | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-09-04 |
| 20 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-09-30 |
| 21 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告                  | 证券时报                       | 2025-10-28 |

|    |   |                            |            |
|----|---|----------------------------|------------|
| 22 | 易方达基金管理有限公司关于终止锦州银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告               | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-11-01 |
| 23 | 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                              | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-11-28 |
| 24 | 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                              | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-12-19 |
| 25 | 关于易方达财富管理基金销售(广州)有限公司展业及易方达基金管理有限公司零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-12-23 |
| 26 | 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                              | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-12-25 |

## § 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安盈回报混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达安盈回报混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达安盈回报混合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

二〇二六年三月三十一日