

# 易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金

## 2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                               |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 易方达恒盛 3 个月定开混合                                                                                                |
| 基金主代码      | 007884                                                                                                        |
| 交易代码       | 007884                                                                                                        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                        |
| 基金合同生效日    | 2019 年 9 月 6 日                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 1,903,812,557.32 份                                                                                            |
| 投资目标       | 在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。                                                                              |
| 投资策略       | 本基金在封闭运作期与开放运作期采取不同的投资策略。封闭期本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场因素、估值及流动性因素、政策因素等分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。债券投资上主要通过久期配置、 |

|        |                                                                                                                                                                                                                                     |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。股票方面本基金将通过分析行业景气度、行业竞争格局等因素，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置的基础上，本基金将基于公司基本面分析和估值水平分析进行个股投资策略。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。开放运作期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。 |
| 业绩比较基准 | 中债新综合指数（财富）收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%                                                                                                                                                                                                 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。                                                                                                                                                                                    |
| 基金管理人  | 易方达基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                         |
| 基金托管人  | 中国银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                          |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |
|----------------|-----------------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 47,759,910.79                           |
| 2.本期利润         | 58,034,823.78                           |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0305                                  |
| 4.期末基金资产净值     | 2,162,013,213.44                        |

|            |        |
|------------|--------|
| 5.期末基金份额净值 | 1.1356 |
|------------|--------|

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 2.72%  | 0.24%     | 2.26%      | 0.14%         | 0.46%  | 0.10% |
| 过去六个月      | 2.59%  | 0.24%     | 2.63%      | 0.12%         | -0.04% | 0.12% |
| 过去一年       | 5.09%  | 0.20%     | 3.99%      | 0.11%         | 1.10%  | 0.09% |
| 过去三年       | 20.77% | 0.22%     | 14.86%     | 0.11%         | 5.91%  | 0.11% |
| 过去五年       | 30.17% | 0.21%     | 20.79%     | 0.11%         | 9.38%  | 0.10% |
| 过去七年       | -      | -         | -          | -             | -      | -     |
| 过去十年       | -      | -         | -          | -             | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 50.40% | 0.20%     | 32.07%     | 0.12%         | 18.33% | 0.08% |

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

易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2019 年 9 月 6 日至 2026 年 6 月 30 日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务                                                                                                                          | 任本基金的基金<br>经理期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                          |
|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|----------|----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                                                             | 任职<br>日期        | 离任<br>日期 |                |                                                                                                                                                                                                                             |
| 胡剑 | 本基金的基金经理，易方达稳健收益债券、易方达裕惠定开混合、易方达岁丰添利债券（LOF）、易方达高等级信用债债券、易方达瑞财混合、易方达恒兴 3 个月定开债券的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员、基础设施资产管理委员会委员 | 2019-09-06      | -        | 20 年           | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、固定收益投资业务总部总经理，易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达纯债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达信用债债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕惠回报债券、易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达高等级信用债债券、易方达丰惠混合、 |

|     |                                                                                                                   |            |   |      |                                                                                                                                                                                        |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                                   |            |   |      | 易方达瑞富混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合、易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达富惠纯债债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开债指数、易方达恒惠定开债券发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达科润混合（LOF）的基金经理。 |
| 纪玲云 | 本基金的基金经理，易方达信用债债券、易方达恒利 3 个月定开债券、易方达恒裕一年定开债券、易方达兴利 180 天持有债券的基金经理，易方达稳健收益债券的基金经理助理，固定收益分类资产研究管理部总经理、固定收益投资决策委员会委员 | 2019-09-06 | - | 17 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员、投资经理助理、固定收益研究部总经理助理、固定收益分类资产研究管理部负责人、投资经理，易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达瑞财混合、易方达科润混合（LOF）、易方达裕华利率债 3 个月定开债券、易方达裕兴 3 个月定开债券、易方达恒固 18 个月封闭式债券的基金经理。        |

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 30 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年二季度，国内经济整体呈现总量边际走弱、结构分化加剧的运行特征。总量维度上，外需延续高增长韧性，但内需板块整体走弱，消费与固定资产投资增速均出现明显回落，成为本季度经济放缓的核心拖累项。

内需修复偏弱核心症结集中体现在三大板块：一是地产链条持续承压，对经济基本面形成深度拖累；二是居民就业与收入预期修复缓慢，劳动力市场整体偏宽松，持续约束终端消费复苏及居民部门融资意愿；三是企业盈利预期偏弱、投资信心不足，叠加财政支出节奏不及预期，加大了经济下行压力。整体而言，本季度出口的较强韧性一定程度上对冲了内需走弱的压力，托底整体总需求。

经济结构性分化态势在二季度进一步强化，呈现典型的 K 型格局。一方面，AI 相关产业维持高速增长，产业链部分细分赛道供需格局偏紧，产品价格出现明显上行，成为经济增长的核心亮点；另一方面，AI 产业的增长外溢效应相对有限，传统非 AI 领域复苏乏力、景气度持续偏弱，进一步拉大行业与产业间的景气差距，加剧了整体经济的结构性分化。

货币政策方面，二季度整体维持适度宽松的基调，政策宽松力度虽较前期有

所收敛，但流动性整体保持合理充裕。央行灵活运用逆回购、MLF（中期借贷便利）、买断式逆回购等多种公开市场工具，有效对冲政府债券发行、月度缴税、跨季资金波动等阶段性扰动，平稳呵护市场流动性。此外，本季度央行落地公开市场操作新规，有望进一步熨平银行间资金利率波动，推动市场资金成本围绕政策利率窄幅、平稳运行，后续流动性环境的稳定性将持续提升。

资本市场方面，股票市场风险偏好较一季度有所修复，成交活跃度维持高位，但赚钱效应主要集中在科技成长方向。以 AI 产业链为代表的电子、通信、半导体、算力、PCB（印制电路板）等板块表现突出，创业板、科创类指数明显强于传统宽基指数；而消费、农林牧渔、商贸零售等内需相关板块表现偏弱，与经济基本面“内弱外强”和行业景气分化的特征一致。可转债跟随权益市场震荡运行，中证转债指数季度上涨 3.7%。债券市场方面，二季度市场主线由资金面宽松、基本面偏弱和机构配置需求共同驱动，收益率呈现震荡下行走势。4 月至 5 月，经济数据走弱推动长端利率下行，10 年国债收益率一度降至 1.70% 附近，30 年国债收益率最低降至 2.19%；进入 6 月后，受政府债供给、止盈盘和政策预期扰动影响，长端利率从低位回升，转入窄幅震荡行情。总体看二季度 10 年国债收益率下行 8BP，10 年国开债收益率下行 17BP，5 年二级资本债收益率下行 18BP，30 年国债收益率下行 12BP。

本期债券市场收益率下行，组合持有期回报包含了一定的利率下行带来的资本利得收益。从市场指数来看，久期更长但超长利率债占比更高的中债综合财富指数 2026 年二季度的收益率为 1.19%，其中票息收益贡献了 0.46%，资本利得收益贡献了 0.73%；而久期短一些但信用债占比更多的中债优选投资级信用债财富指数的收益率为 1.01%，其中票息收益贡献 0.44%，资本利得收益贡献 0.57%。

操作上本组合积极进行债券结构调整。在二永债和超长端地方政府债上超配，利用期货进行久期对冲。结构上逐步降低中间期限段利率债的风险敞口，转换为长端和超长端品种。组合久期在 4 月份经济数据下行后，跟随利率上行逐步提升至基准以上。权益方面，组合保持了一定的股票仓位和偏低的可转债仓位，积极进行个股和个券的调整。整体而言组合本季度延续了绝对收益的投资思路，积极参与结构性策略，选择优势资产进行偏离，获取了相对稳健的投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1356 元，本报告期份额净值增长率为 2.72%，同期业绩比较基准收益率为 2.26%。

4. 6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5. 1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 326,992,006.53   | 15.08        |
|    | 其中：股票             | 326,992,006.53   | 15.08        |
| 2  | 固定收益投资            | 1,724,256,876.41 | 79.51        |
|    | 其中：债券             | 1,664,182,464.08 | 76.74        |
|    | 资产支持证券            | 60,074,412.33    | 2.77         |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | 30,001,356.16    | 1.38         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 65,736,306.64    | 3.03         |
| 7  | 其他资产              | 21,634,462.79    | 1.00         |
| 8  | 合计                | 2,168,621,008.53 | 100.00       |

5. 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5. 2. 1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | 6,189,576.68 | 0.29         |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| B | 采矿业              | 1,847,257.34   | 0.09  |
| C | 制造业              | 174,316,940.73 | 8.06  |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,086,913.94   | 0.10  |
| E | 建筑业              | 323,804.00     | 0.01  |
| F | 批发和零售业           | 323,516.51     | 0.01  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 29,108,472.49  | 1.35  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,824,840.12   | 0.08  |
| J | 金融业              | 79,320,765.00  | 3.67  |
| 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       | 31,032,738.72  | 1.44  |
| 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          | 617,181.00     | 0.03  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -              | -     |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 326,992,006.53 | 15.12 |

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 601198 | 东兴证券 | 1,805,900 | 24,542,181.00 | 1.14         |
| 2  | 603259 | 药明康德 | 195,100   | 24,291,901.00 | 1.12         |
| 3  | 601318 | 中国平安 | 330,300   | 15,768,522.00 | 0.73         |
| 4  | 600030 | 中信证券 | 474,600   | 13,635,258.00 | 0.63         |
| 5  | 601628 | 中国人寿 | 378,400   | 13,376,440.00 | 0.62         |
| 6  | 601021 | 春秋航空 | 275,500   | 12,557,290.00 | 0.58         |
| 7  | 002352 | 顺丰控股 | 388,100   | 12,132,006.00 | 0.56         |
| 8  | 601601 | 中国太保 | 420,700   | 11,998,364.00 | 0.55         |

|    |        |      |        |               |      |
|----|--------|------|--------|---------------|------|
| 9  | 002821 | 凯莱英  | 68,260 | 11,058,120.00 | 0.51 |
| 10 | 603501 | 豪威集团 | 95,900 | 9,096,115.00  | 0.42 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 19,981,311.48    | 0.92         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 805,998,761.65   | 37.28        |
|    | 其中：政策性金融债 | 228,649,698.63   | 10.58        |
| 4  | 企业债券      | 63,300,233.20    | 2.93         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 368,854,421.86   | 17.06        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 85,871,703.31    | 3.97         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | 320,176,032.58   | 14.81        |
| 10 | 合计        | 1,664,182,464.08 | 76.97        |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称            | 数量（张）     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 250215    | 25 国开 15        | 1,800,000 | 178,287,780.82 | 8.25         |
| 2  | 232680001 | 26 工行二级资本债 01BC | 1,400,000 | 141,567,232.88 | 6.55         |
| 3  | 232480007 | 24 建行二级资本债 01B  | 1,300,000 | 138,570,120.00 | 6.41         |
| 4  | 232680007 | 26 兴业银行二级资本债 01 | 1,200,000 | 120,856,464.66 | 5.59         |
| 5  | 2605164   | 26 河南债 11       | 700,000   | 72,050,555.25  | 3.33         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券

投资明细

| 序号 | 证券代码   | 证券名称     | 数量（份）   | 公允价值（元）       | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|----------------------|
| 1  | 263314 | 城运燃优     | 500,000 | 38,887,796.88 | 1.80                 |
| 2  | 144164 | 24 光水 07 | 110,000 | 11,080,634.52 | 0.51                 |
| 3  | 199430 | 23 济建优   | 100,000 | 10,105,980.93 | 0.47                 |

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称     | 持仓量 | 合约市值（元）       | 公允价值变动（元）  | 风险说明                                         |
|-------------------|--------|-----|---------------|------------|----------------------------------------------|
| IM2609            | IM2609 | 45  | 76,365,000.00 | 652,040.00 | 本基金买入股指期货多头合约的目的是以多头套保的角度对冲市场指数涨跌对组合净值造成的影响。 |
| 公允价值变动总额合计(元)     |        |     |               |            | 652,040.00                                   |
| 股指期货投资本期收益(元)     |        |     |               |            | 17,551,954.34                                |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |        |     |               |            | -6,176,560.00                                |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，主要选择流动性好的国债期货合约进行交易，

以对冲投资组合的利率风险。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称     | 持仓量<br>(买/卖) | 合约市值<br>(元)    | 公允价值变动<br>(元) | 风险指标说明                                             |
|-------------------|--------|--------------|----------------|---------------|----------------------------------------------------|
| T2609             | T2609  | -60          | -65,529,000.00 | -271,000.00   | 交易期内组合利用国债期货头寸调整组合有效久期和期限结构分布情况，对冲收益率变动和期限利差变动的风险。 |
| TL2609            | TL2609 | -83          | -94,412,500.00 | -991,701.78   | 交易期内组合利用国债期货头寸调整组合有效久期和期限结构分布情况，对冲收益率变动和期限利差变动的风险。 |
| 公允价值变动总额合计（元）     |        |              |                |               | -1,262,701.78                                      |
| 国债期货投资本期收益（元）     |        |              |                |               | -1,209,158.85                                      |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） |        |              |                |               | -2,098,551.78                                      |

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行交易。本基金力争通过国债期货的交易，降低组合债券持仓调整的交易成本，增加组合的灵活性，对冲潜在风险。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局上海市分局、中国人民银行的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾

受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 13,862,577.78 |
| 2  | 应收证券清算款 | 7,771,885.01  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 21,634,462.79 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）       | 占基金资产<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|---------|---------------|----------------------|
| 1  | 113042 | 上银转债    | 12,193,815.57 | 0.56                 |
| 2  | 128127 | 文科转债    | 7,266,245.79  | 0.34                 |
| 3  | 127089 | 晶澳转债    | 5,551,802.79  | 0.26                 |
| 4  | 113052 | 兴业转债    | 4,701,330.25  | 0.22                 |
| 5  | 113616 | 韦尔转债    | 4,681,410.08  | 0.22                 |
| 6  | 118034 | 晶能转债    | 4,096,620.50  | 0.19                 |
| 7  | 123107 | 温氏转债    | 3,768,088.54  | 0.17                 |
| 8  | 127049 | 希望转 2   | 3,634,679.69  | 0.17                 |
| 9  | 127027 | 能化转债    | 3,630,005.53  | 0.17                 |
| 10 | 113049 | 长汽转债    | 2,835,520.79  | 0.13                 |
| 11 | 113605 | 大参转债    | 2,632,840.72  | 0.12                 |
| 12 | 113625 | 江山转债    | 2,574,689.09  | 0.12                 |
| 13 | 118031 | 天 23 转债 | 2,304,126.94  | 0.11                 |
| 14 | 110095 | 双良转债    | 2,229,111.26  | 0.10                 |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 15 | 123113 | 仙乐转债  | 2,122,518.40 | 0.10 |
| 16 | 128128 | 齐翔转 2 | 1,797,293.22 | 0.08 |
| 17 | 110076 | 华海转债  | 1,786,679.21 | 0.08 |
| 18 | 110075 | 南航转债  | 1,679,282.59 | 0.08 |
| 19 | 113056 | 重银转债  | 1,588,241.30 | 0.07 |
| 20 | 127041 | 弘亚转债  | 1,570,593.36 | 0.07 |
| 21 | 127045 | 牧原转债  | 1,566,739.54 | 0.07 |
| 22 | 128134 | 鸿路转债  | 1,561,189.62 | 0.07 |
| 23 | 113627 | 太平转债  | 1,532,081.37 | 0.07 |
| 24 | 123071 | 天能转债  | 1,529,627.19 | 0.07 |
| 25 | 110093 | 神马转债  | 1,452,317.61 | 0.07 |
| 26 | 123114 | 三角转债  | 1,130,266.27 | 0.05 |
| 27 | 128138 | 侨银转债  | 1,035,968.22 | 0.05 |
| 28 | 123065 | 宝莱转债  | 975,590.15   | 0.05 |
| 29 | 113597 | 佳力转债  | 912,112.71   | 0.04 |
| 30 | 127050 | 麒麟转债  | 696,658.44   | 0.03 |
| 31 | 128125 | 华阳转债  | 507,642.51   | 0.02 |
| 32 | 123072 | 乐歌转债  | 299,112.26   | 0.01 |
| 33 | 123104 | 卫宁转债  | 26,501.80    | 0.00 |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,903,812,553.98 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 3.34             |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | -                |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 报告期期末基金份额总额               | 1,903,812,557.32 |

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|--------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | -      | -            | 10,000,000.00 | 0.5253%      | 不少于 3 年    |
| 基金管理人高级管理人员 | -      | -            | -             | -            | -          |
| 基金经理等人员     | -      | -            | -             | -            | -          |
| 基金管理人股东     | -      | -            | -             | -            | -          |
| 其他          | -      | -            | -             | -            | -          |
| 合计          | -      | -            | 10,000,000.00 | 0.5253%      | -          |

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                                           | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                   |                  |         |         | 报告期末持有基金情况       |         |
|---------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------------------------|------------------|---------|---------|------------------|---------|
|                                                                                 | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间            | 期 初 份 额          | 申 购 份 额 | 赎 回 份 额 | 持有份额             | 份额占比    |
| 机构                                                                              | 1              | 2026 年 04 月 01 日~2026 年 06 月 30 日 | 1,241,604,048.08 | 0.00    | 0.00    | 1,241,604,048.08 | 65.22 % |
|                                                                                 | 2              | 2026 年 04 月 01 日~2026 年 06 月 30 日 | 659,608,304.15   | 0.00    | 0.00    | 659,608,304.15   | 34.65 % |
| 产品特有风险                                                                          |                |                                   |                  |         |         |                  |         |
| 报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对 |                |                                   |                  |         |         |                  |         |

基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权终止基金合同；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

### 1、定期开放运作的风险

（1）本基金以定期开放方式运作且不上市交易，投资者仅可在开放运作期申赎基金份额，在封闭运作期内无法申购赎回。若投资者在开放运作期末赎回基金份额，则需继续持有至下一封闭运作期结束才能赎回，投资者在封闭运作期内存在无法赎回基金份额的风险。

（2）基金合同生效后的首个运作期为封闭运作期，自基金合同生效日至基金管理人规定的时间，首个封闭运作期可能少于或者超过 3 个月，投资者应仔细阅读相关法律文件及公告，并及时行使相关权利。

（3）除首个运作期封闭运作外，本基金的运作期包含“封闭运作期”和“开放运作期”，运作期期限 3 个月，基金管理人在每个封闭运作期结束前公布开放运作期和下一封闭运作期的具体时间安排，由于市场环境等因素的影响，本基金每次开放运作期和封闭运作期的时间及长度不完全一样，投资者应关注相关公告并及时行使权利，否则会面临无法申购/赎回基金份额的风险。

### 2、单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过 50%的风险

（1）本基金单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过 50%，单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者大额赎回时，可能会对本基金资产运作及净值表现产生较大影响。

#### （2）巨额赎回的风险

相对于其他基金，本基金更可能因开放期内单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者集中大额赎回发生巨额赎回。当发生巨额赎回时，基金管理人可能根据基金当时的资产组合状况决定延缓支付赎回款，投资者面临赎回款被延缓支付的风险。

### 3、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同的风险

本基金的销售对象主要为机构投资者，不向个人投资者公开发售，基金持续营销可能受到影响。本基金基金合同生效满三年后继续存续的，若连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于 5000 万元情形，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。投资者面临转换基金运作方式、与其他基金合并的风险。

《基金合同》生效满三年后的存续期内，若连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权终止基金合同。若管理人与托管人根据实际情况决定终止基金合同，本基金面临终止清盘的风险。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

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

2.《易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3.《易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 10.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年七月二十一日