易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41

7.12 投资组合报告附注 42
§8 基金份额持有人信息 43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 43
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 44
§9 开放式基金份额变动 44
§10 重大事件揭示 44
10.1 基金份额持有人大会决议 44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
10.4 基金投资策略的改变 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 45
10.8 其他重大事件 48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 49
§12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 50
12.3 查阅方式 50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金	
基金简称	易方达年年恒秋纯债一年定开债券	
基金主代码	007997	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 10 月 31 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,621,774,651.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C
下属分级基金的交易代码	007997	007998
报告期末下属分级基金的份额总额	1,592,726,533.12 份	29,048,117.95 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金，管理人主要通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，力争为投资者提供长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在封闭期与开放期将采取不同的投资策略。1、封闭运作期内，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。本基金可通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，适当运用杠杆息差方式来获取主动管理回报。本基金可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上，选择投资价值较高的资产支持证券进行投资。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易,以对冲投资组合的系统性风险。2、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	中债信用债总财富（1 年以下）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王玉	张姗
	联系电话	020-85102688	400-61-95555
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.co

			m
客户服务电话		400 881 8088	400-61-95555
传真		020-38798812	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		510627；510623；519031	518040
法定代表人		吴欣荣	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江西路 21 号 52 层； 广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层； 广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）**	
	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C
本期已实现收益	20,540,407.01	330,456.75
本期利润	28,480,874.26	475,242.31
加权平均基金份额本期利润	0.0179	0.0164
本期加权平均净值利润率	1.75%	1.61%
本期基金份额净值增长率	1.77%	1.62%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C

期末可供分配利润	12,133,040.91	202,737.49
期末可供分配基金份额利润	0.0076	0.0070
期末基金资产净值	1,631,906,451.45	29,747,233.26
期末基金份额净值	1.0246	1.0241
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C
基金份额累计净值增长率	28.25%	25.74%

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

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

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.81%	0.02%	0.45%	0.01%	0.36%	0.01%
过去六个月	1.77%	0.02%	1.00%	0.01%	0.77%	0.01%
过去一年	2.61%	0.02%	1.79%	0.01%	0.82%	0.01%
过去三年	11.23%	0.03%	7.25%	0.01%	3.98%	0.02%
过去五年	19.76%	0.04%	13.81%	0.01%	5.95%	0.03%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	28.25%	0.04%	19.90%	0.01%	8.35%	0.03%

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.74%	0.02%	0.45%	0.01%	0.29%	0.01%
过去六个月	1.62%	0.02%	1.00%	0.01%	0.62%	0.01%
过去一年	2.30%	0.02%	1.79%	0.01%	0.51%	0.01%
过去三年	10.24%	0.03%	7.25%	0.01%	2.99%	0.02%
过去五年	18.00%	0.04%	13.81%	0.01%	4.19%	0.03%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生	25.74%	0.04%	19.90%	0.01%	5.84%	0.03%

效起至今						

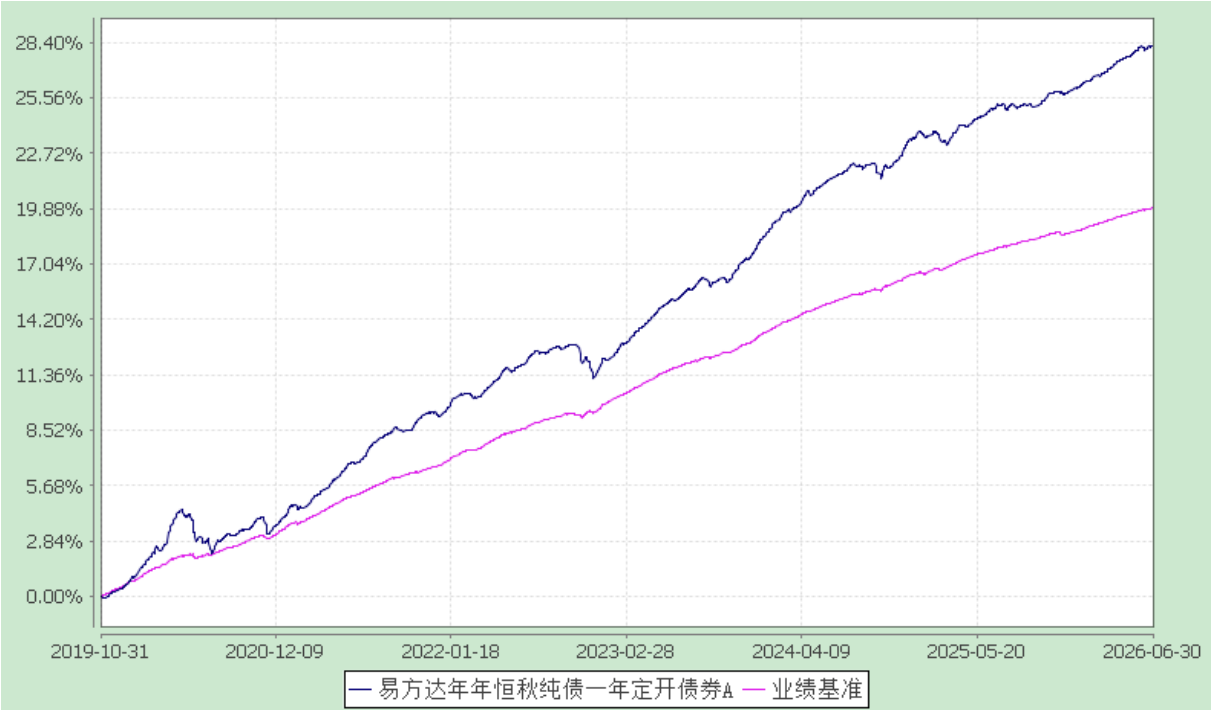
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

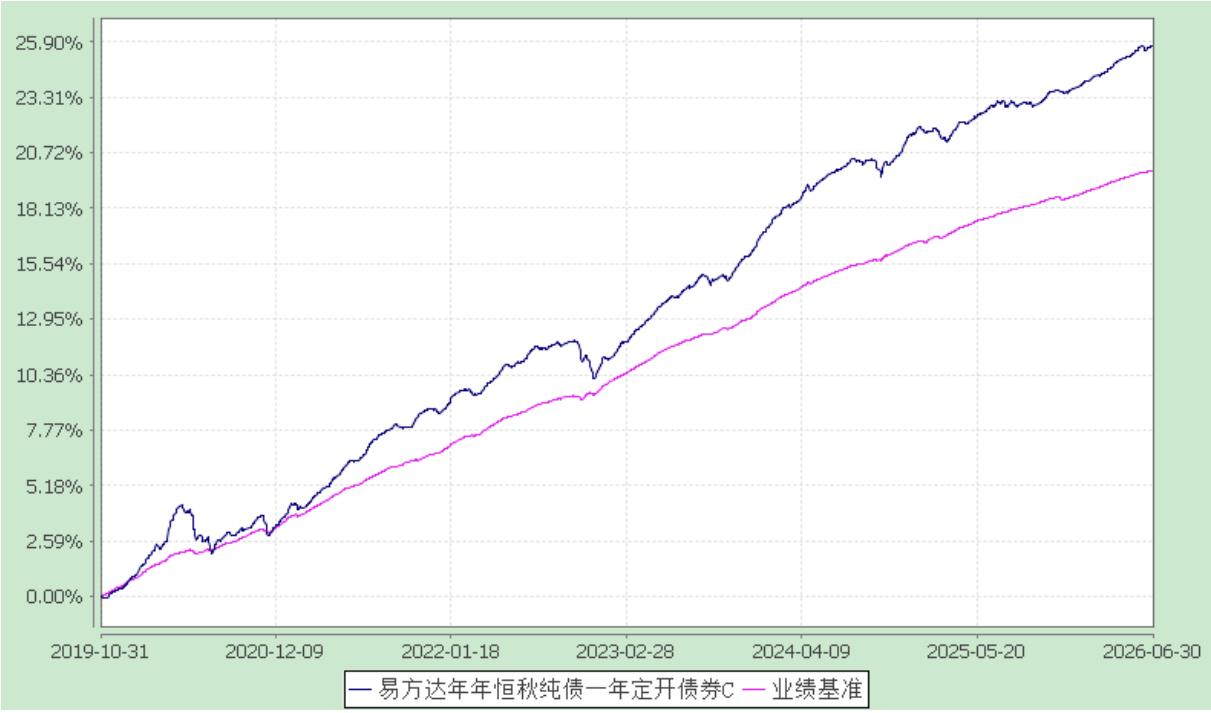
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019 年 10 月 31 日至 2026 年 6 月 30 日）

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A



易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII 等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李一硕	本基金的基金经理，易方达永旭定期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达安源中短债债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券、易方达年年恒春纯债一年定开债券、易方达年年恒实纯债一年定开债券、易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债、	2019-10-31	-	18 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任瑞银证券有限公司研究员，中国国际金融有限公司研究员，易方达基金管理有限公司固定收益研究员、固定收益投资部总经理助理、固定收益特定策略投资部负责人，易方达瑞景混合、易方达富惠纯债债券、易方达新利混合、易方达新享混合、易方达裕

	易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达富惠纯债债券、易方达恒安定开债券、易方达恒惠定开债券（自 2022 年 09 月 08 日至 2026 年 04 月 17 日）、易方达恒兴 3 个月定开债券、易方达恒益定开债券、易方达恒信定开债券的基金经理，易方达中债新综指（LOF）的基金经理助理，债券指数投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员				如混合、易方达恒信定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式、易方达聚盈分级债券发起式、易方达恒益定开债券发起式的基金经理。
刘琬姝	本基金的基金经理助理，易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债、易方达恒利 3 个月定开债券、易方达安旭 90 天持有债券、易方达富惠纯债债券、易方达安源中短债债券的基金经理，易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达恒兴 3 个月定开债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券、易方达年年恒春纯债一年定开债券、易方达永旭定期开放债券、易方达年年恒实纯债一年定开债券、易方达恒惠定开债券、易方达兴利 180 天持有债券的基金经理助理，固定收益策略研究员	2020-12-22	-	14 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投资经理助理。
李昭函	本基金的基金经理助理，易方达瑞财混合的基金经理，易方达稳健收益债券、易方达裕惠定开混合、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达年年恒实纯债一年定开债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券、易方达年年恒春纯债一年定开债券、易方达永旭定期开放债券、易方达安泽 180 天持有债券的基金经理助理，固定收益策略研究员	2025-07-30	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任民生证券股份有限公司固定收益分析师。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、

基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 64 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年我国宏观经济平稳起步，年初固定资产投资及出口两个板块带动内外需求均有所恢复，工业增加值环比增速位于过去几年中的较高水平，其中各个主要行业均呈现边际回升的态势。二季度我国宏观经济压力有所提升，主要增长指标较一季度边际回落。其中固定资产投资增速下行压力相对最高。除投资之外，二季度内需的不确定性还来自于消费数据疲弱，社会消费品零售总额口径中的商品及餐饮收入均呈现下降趋势。最后，融资数据也侧面反映出经济扩张动能不足，其中居民类信贷下行幅度最大。不能忽视的是，今年以来我国经济增长的结构中仍具备诸多亮点，例如出口数据保持韧性、高端制造板块带动设备电子类生产指标持续增长。但总体而言，内外需分化局面下经济增长的不确定性有所上升。

2026 年上半年我国货币政策维持宽松取向，银行间市场流动性充裕。随着二季度基本面出现了一些新的变化，货币政策对经济的支持力度有所提高。在流动性宽松的背景下，债券市场收益率震荡下行，收益率曲线形态呈陡峭化。不过 5 月下旬以来，在经历了公开市场操作持续净回笼后，市场资金利率边际上明显回升，债券收益率阶段性有所走高。整体而言，上半年中债新综合财富指数上涨 2.02%。

操作上，组合维持了中性的杠杆水平及中性偏短的平均资产久期，并不断优化持仓结构。未来我们将继续维持久期匹配的总体策略，关注组合的持有期回报水平，并根据市场情况灵活调整组合的配置结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0246 元，本报告期份额净值增长率为 1.77%，同期业绩比较基准收益率为 1.00%；C 类基金份额净值为 1.0241 元，本报告期份额净值增长率为 1.62%，同期业绩比较基准收益率为 1.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面动能边际趋缓、融资需求维持在偏低水平以及货币政策持续宽松等诸多因素共同推动了今年以来债券收益率的下行趋势。展望下半年，我国经济增长结构性分化导致中短期增速面临压力的格局还会持续，货币政策具备进一步放松的空间。在这样的宏观背景下，债券资产收益率大幅上行的风险是偏低的。

虽然利率下行的周期可能尚未结束，但也应注意到，随着我国整体利率水平已经处于较低位置，债券投资难以单纯通过趋势性增加久期获取显著的超额收益。相较之下，今年以来市场中结构化策略的投资机会仍然较多。例如从期限利差的角度来看，上半年收益率曲线明显陡峭化，近期又有所平坦化，组合在不同阶段进行期限结构的灵活配置，可以获取一定的收益增强。品种利差、个券置换等策略今年以来都存在类似的博弈空间。总体而言，我们认为未来债券投资需要更加精细化地去寻找组合超额收益的来源。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A:本报告期内实施的利润分配金额为 20,202,401.66 元。

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C:本报告期内实施的利润分配金额为 319,180.97 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,606,445.08	1,491,189.20
结算备付金		37,938,783.93	23,763,546.48

存出保证金		15,151.08	13,944.25
交易性金融资产	6.4.7.2	2,395,291,589.69	2,309,160,039.09
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,235,016,369.15	2,137,912,147.01
资产支持证券投资		160,275,220.54	171,247,892.08
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	85,003,842.47	-
应收清算款		10,651,149.20	6,989,654.12
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,535,506,961.45	2,341,418,373.14
负债和净资产	**附注号**	**本期末** **2026 年 6 月 30 日**	**上年度末** **2025 年 12 月 31 日**
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		873,120,539.34	683,134,680.14
应付清算款		6,480.24	7,020,650.86
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		409,392.75	420,011.39
应付托管费		68,232.13	70,001.90
应付销售服务费		7,329.90	7,520.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		119,904.43	168,242.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	121,397.95	102,264.50
负债合计		873,853,276.74	690,923,371.29
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,621,774,651.07	1,619,092,615.80
未分配利润	6.4.7.8	39,879,033.64	31,402,386.05
净资产合计		1,661,653,684.71	1,650,495,001.85
负债和净资产总计		2,535,506,961.45	2,341,418,373.14

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0246 元，C 类基金份额净值 1.0241 元；基金份额总额 1,621,774,651.07 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,592,726,533.12 份，C 类基金份额总额 29,048,117.95 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		38,003,678.68	35,354,558.88
1.利息收入		137,494.56	74,829.21
其中：存款利息收入	6.4.7.9	133,894.59	65,016.04
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		3,599.97	9,813.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		29,780,931.31	44,901,310.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	27,239,009.50	41,667,873.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	2,324,317.81	2,709,510.06
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	217,604.00	523,926.59
股利收益	6.4.7.14	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	8,085,252.81	-9,621,580.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
减：二、营业总支出		9,047,562.11	12,484,539.05
1．管理人报酬		2,459,539.04	3,103,058.35
2．托管费		409,923.21	517,176.40
3．销售服务费		44,041.53	87,400.38
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		5,925,756.46	8,500,916.65
其中：卖出回购金融资产支出		5,925,756.46	8,500,916.65
6．信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7．税金及附加		85,463.01	148,265.53
8．其他费用	6.4.7.18	122,838.86	127,721.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**28,956,116.57**	**22,870,019.83**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**28,956,116.57**	**22,870,019.83**
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		**28,956,116.57**	**22,870,019.83**

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**本期** **2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	1,619,092,615.80	31,402,386.05	1,650,495,001.85
二、本期期初净资产	1,619,092,615.80	31,402,386.05	1,650,495,001.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,682,035.27	8,476,647.59	11,158,682.86
（一）、综合收益总额	-	28,956,116.57	28,956,116.57
（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）	2,682,035.27	42,113.65	2,724,148.92
其中：1.基金申购款	2,682,035.27	42,113.65	2,724,148.92
2.基金赎回款	-	-	-
（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）	-	-20,521,582.63	-20,521,582.63
四、本期期末净资产	1,621,774,651.07	39,879,033.64	1,661,653,684.71
项目	**上年度可比期间** **2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	2,032,370,281.79	68,335,932.22	2,100,706,214.01
二、本期期初净资产	2,032,370,281.79	68,335,932.22	2,100,706,214.01
三、本期增减变动额（减少以“-”	4,256,330.58	-10,894,219.02	-6,637,888.44

号填列）			
（一）、综合收益总额	-	22,870,019.83	22,870,019.83
（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）	4,256,330.58	101,956.04	4,358,286.62
其中：1.基金申购款	4,256,330.58	101,956.04	4,358,286.62
2.基金赎回款	-	-	-
（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）	-	-33,866,194.89	-33,866,194.89
四、本期期末净资产	2,036,626,612.37	57,441,713.20	2,094,068,325.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金(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[2019]1682 号《关于准予易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 10 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,679,068,834.97 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,135,595.29 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编

制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》的规定：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管

理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	6,606,445.08
等于：本金	6,606,246.09
加：应计利息	198.99
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	6,606,445.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	688,194,114.99	4,985,857.57	694,119,857.57	939,885.01
	银行间市场	1,512,536,459.12	16,374,511.58	1,540,896,511.58	11,985,540.88
	合计	2,200,730,574.11	21,360,369.15	2,235,016,369.15	12,925,425.89
资产支持证券		158,959,258.24	777,220.54	160,275,220.54	538,741.76
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,359,689,832.35	22,137,589.69	2,395,291,589.69	13,464,167.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	85,003,842.47	-

合计	85,003,842.47	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	27,377.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	27,377.50
应付利息	-
预提费用	94,020.45
合计	121,397.95

6.4.7.7 实收基金

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,590,086,581.64	1,590,086,581.64
本期申购	2,639,951.48	2,639,951.48
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,592,726,533.12	1,592,726,533.12

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,006,034.16	29,006,034.16

本期申购	42,083.79	42,083.79
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,048,117.95	29,048,117.95

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,791,670.63	19,068,320.60	30,859,991.23
本期期初	11,791,670.63	19,068,320.60	30,859,991.23
本期利润	20,540,407.01	7,940,467.25	28,480,874.26
本期基金份额交易产生的变动数	3,364.93	38,089.57	41,454.50
其中：基金申购款	3,364.93	38,089.57	41,454.50
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-20,202,401.66	-	-20,202,401.66
本期末	12,133,040.91	27,046,877.42	39,179,918.33

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	191,411.09	350,983.73	542,394.82
本期期初	191,411.09	350,983.73	542,394.82
本期利润	330,456.75	144,785.56	475,242.31
本期基金份额交易产生的变动数	50.62	608.53	659.15
其中：基金申购款	50.62	608.53	659.15
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-319,180.97	-	-319,180.97
本期末	202,737.49	496,377.82	699,115.31

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,533.23
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	130,335.36
其他	26.00
合计	133,894.59

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	25,430,956.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,808,052.57
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	27,239,009.50

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	894,603,494.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	879,888,331.98
减：应计利息总额	12,895,324.93
减：交易费用	11,785.00
买卖债券差价收入	1,808,052.57

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	2,244,387.80
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	79,930.01
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,324,317.81

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	41,603,051.06
减：卖出资产支持证券成本总额	40,512,193.28
减：应计利息总额	1,010,927.77
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	79,930.01

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
国债期货投资收益	217,604.00

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	8,085,252.81
——股票投资	-
——债券投资	8,344,861.57
——资产支持证券投资	-259,608.76
——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	8,085,252.81

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	34,513.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	10,218.41
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	122,838.86

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 7 月 6 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.072 元。

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 7 月 6 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.065 元。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	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
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	140,604,300.00	25.38%	20,084,880.00	20.01%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	9,285,100,000.00	31.66%	6,467,683,000.00	31.60%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,459,539.04	3,103,058.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	253,563.81	408,123.38
应支付基金管理人的净管理费	2,205,975.23	2,694,934.97

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.30%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	409,923.21	517,176.40

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.05%÷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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达年年恒秋纯债一年定开债券A	易方达年年恒秋纯债一年定开债券C	合计
易方达基金管理有限公司	-	428.84	428.84
招商银行	-	1,191.03	1,191.03
易方达财富	-	1.98	1.98
合计	-	1,621.85	1,621.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达年年恒秋纯债一年	易方达年年恒秋纯债一年	合计

	定开债券A	定开债券C	
易方达基金管理有限公司	-	254.53	254.53
招商银行	-	1,234.09	1,234.09
合计	-	1,488.62	1,488.62

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 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.30%÷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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A

无。

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	6,606,445.08	3,533.23	3,239,300.06	6,296.86

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026-01-14	-	2026-01-14	0.067	9,250,423.04	1,403,157.14	10,653,580.18	-
2	2026-04-08	-	2026-04-08	0.060	8,270,572.64	1,278,248.84	9,548,821.48	-
合计				0.127	17,520,995.68	2,681,405.98	20,202,401.66	-

注：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 7 月 6 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.072 元。

易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026-01-14	-	2026-01-14	0.060	150,836.20	23,199.94	174,036.14	-
2	2026-04-08	-	2026-04-08	0.050	125,601.83	19,543.00	145,144.83	-
合计				0.110	276,438.03	42,742.94	319,180.97	-

注：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 7 月 6 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.065 元。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
524871	26 申 D10	2026-06-25	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.01	700,000	70,000,000.00	70,007,268.49	-

6.4.12.2 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股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 493,120,539.34 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102281315	22 铁建房产 MTN001	2026-07-01	100.62	100,000	10,062,303.01
102480992	24 特变股份	2026-07-01	102.30	100,000	10,229,625.75

	MTN001B				
102481166	24 榆林能源 MTN001	2026-07-01	104.00	100,000	10,400,143.01
102483664	24 荣盛 MTN002	2026-07-01	102.67	100,000	10,267,414.25
102483962	24 荣盛 MTN003	2026-07-01	102.77	100,000	10,276,660.82
102485200	24 津保投 MTN005	2026-07-01	102.72	200,000	20,543,901.37
102485257	24 津保投 MTN006	2026-07-01	102.59	53,000	5,437,169.81
102501196	25 鲁宏桥 MTN002(科创票据)	2026-07-01	102.38	100,000	10,238,087.67
102501322	25 鲁宏桥 MTN003(科创票据)	2026-07-01	101.97	100,000	10,196,739.73
132480062	24 鲁宏桥 GN001	2026-07-01	104.40	100,000	10,439,871.23
102480047	24 天津港 MTN001(科创票据)	2026-07-02	105.92	200,000	21,184,196.16
102485194	24 中联投资 MTN003A	2026-07-02	102.17	114,000	11,646,915.26
102581841	25 天津港 MTN003(科创票据)	2026-07-02	101.11	200,000	20,221,383.01
102584282	25 宝马中国 MTN002BC	2026-07-02	102.07	154,000	15,718,837.38
102584590	25 萧山机场 MTN002A(绿色)	2026-07-02	102.03	200,000	20,405,150.68
232380084	23 中行二级资本债 04A	2026-07-02	105.89	200,000	21,178,887.67
232580008	25 工行二级资本债 02BC	2026-07-02	101.22	391,000	39,576,653.64
232580022	25 工行二级资本债 03BC	2026-07-02	102.28	300,000	30,684,129.86
232580024	25 农行二级资本债 02A(BC)	2026-07-02	102.41	84,000	8,602,373.72
232580050	25 中行二级资本债 02BC	2026-07-02	102.66	200,000	20,531,466.30
102581472	25 甘公投	2026-07-03	101.61	100,000	10,160,961.64

	MTN002				
102585073	25 甘公投 MTN005	2026-07-03	102.37	200,000	20,473,123.29
102585295	25 华电能源 MTN001	2026-07-03	101.56	100,000	10,156,190.68
232380069	23 建行二级资本债 02A	2026-07-03	106.55	400,000	42,618,115.07
232480033	24 建行二级资本债 02A	2026-07-03	103.78	300,000	31,135,227.95
232480073	24 工行二级资本债 02BC	2026-07-03	103.80	159,000	16,503,858.48
232480098	24 浦发银行二级资本债 02A	2026-07-03	102.68	500,000	51,338,301.37
232580008	25 工行二级资本债 02BC	2026-07-03	101.22	109,000	11,032,877.87
232580016	25 农行二级资本债 01A(BC)	2026-07-03	100.75	8,000	805,993.78
232580024	25 农行二级资本债 02A(BC)	2026-07-03	102.41	93,000	9,524,056.62
102601914	26 贵州交通 MTN002	2026-07-06	100.77	28,000	2,821,617.53
102681558	26 昆明轨道 MTN002	2026-07-06	100.37	100,000	10,036,764.38
合计				5,193,000	534,448,998.99

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 380,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投

资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 143.54%(2025 年 12 月 31 日：139.91%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	100,022,132.05	60,121,879.46
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	204,706,669.04	257,894,294.80
合计	304,728,801.09	318,016,174.26

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	921,770,663.19	701,327,854.28
AAA 以下	88,459,150.36	185,676,692.98
未评级	920,057,754.51	932,891,425.49
合计	1,930,287,568.06	1,819,895,972.75

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	160,275,220.54	171,247,892.08
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	160,275,220.54	171,247,892.08

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2026 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VaR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,606,445.08	-	-	-	6,606,445.08
结算备付金	37,938,783.93	-	-	-	37,938,783.93
存出保证金	15,151.08	-	-	-	15,151.08
交易性金融资产	653,167,927.48	1,412,585,972.74	329,537,689.47	-	2,395,291,589.69
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	85,003,842.47	-	-	-	85,003,842.47
应收清算款	-	-	-	10,651,149.20	10,651,149.20
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	782,732,150.04	1,412,585,972.74	329,537,689.47	10,651,149.20	2,535,506,961.45
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	873,120,539.34	-	-	-	873,120,539.34
应付清算款	-	-	-	6,480.24	6,480.24
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	409,392.75	409,392.75
应付托管费	-	-	-	68,232.13	68,232.13
应付销售服务费	-	-	-	7,329.90	7,329.90
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	119,904.43	119,904.43
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	121,397.95	121,397.95
负债总计	873,120,539.34	-	-	732,737.40	873,853,276.74
利率敏感度缺口	-90,388,389.30	1,412,585,972.74	329,537,689.47	9,918,411.80	1,661,653,684.71
上年度末 2025 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
货币资金	1,491,189.20	-	-	-	1,491,189.20
结算备付金	23,763,546.48	-	-	-	23,763,546.48
存出保证金	13,944.25	-	-	-	13,944.25
交易性金融资产	763,980,290.00	1,269,557,064.71	275,622,684.38	-	2,309,160,039.09
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	6,989,654.12	6,989,654.12
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	789,248,969.93	1,269,557,064.71	275,622,684.38	6,989,654.12	2,341,418,373.14
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	683,134,680.14	-	-	-	683,134,680.14
应付清算款	-	-	-	7,020,650.86	7,020,650.86
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	420,011.39	420,011.39
应付托管费	-	-	-	70,001.90	70,001.90
应付销售服务费	-	-	-	7,520.31	7,520.31
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	168,242.19	168,242.19
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	102,264.50	102,264.50
负债总计	683,134,680.14	-	-	7,788,691.15	690,923,371.29
利率敏感度缺口	106,114,289.79	1,269,557,064.71	275,622,684.38	-799,037.03	1,650,495,001.85

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	10,696,555.72	10,033,086.20
	2.市场利率上升 25 个基点	-10,583,330.05	-9,951,713.65

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金不投资股票、权证、可转债（可分离交易可转债的纯债部分除外）。于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末

	2026 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	2,395,291,589.69
第三层次	-
合计	2,395,291,589.69

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,395,291,589.69	94.47
	其中：债券	2,235,016,369.15	88.15
	资产支持证券	160,275,220.54	6.32
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	85,003,842.47	3.35
	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	44,545,229.01	1.76
8	其他各项资产	10,666,300.28	0.42
9	合计	2,535,506,961.45	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	702,128,038.93	42.25
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	306,162,926.25	18.43
5	企业短期融资券	70,844,569.87	4.26
6	中期票据	1,145,745,290.38	68.95
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	10,135,543.72	0.61
10	合计	2,235,016,369.15	134.51

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	524871	26 申 D10	700,000	70,007,268.49	4.21
2	232480098	24 浦发银行二级资本债 02A	500,000	51,338,301.37	3.09
3	524190	25 国元 01	500,000	50,632,835.62	3.05
4	232580008	25 工行二级资本债 02BC	500,000	50,609,531.51	3.05
5	524732	26 国证 06	500,000	50,380,684.93	3.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	261249	中交投 1A	300,000	30,289,816.44	1.82
2	263539	24 鑫优 01	200,000	20,111,127.94	1.21
3	264097	城发 YW 优	200,000	20,059,429.78	1.21
4	266841	长曜 1 优	200,000	20,042,428.49	1.21
5	500201	长征 3 优	200,000	20,030,482.19	1.21
6	156659	PR 产 1A	200,000	19,497,611.85	1.17
7	261839	工鑫 25A	100,000	10,118,001.10	0.61
8	500233	至盈 1A	100,000	10,081,649.32	0.61
9	266906	盛赢 033A	100,000	10,044,673.43	0.60

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，主要选择流动性好的国债期货合约进行交易，调节组合的久期水平及期限结构。

7.11.2 本期国债期货投资评价

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。本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主动选择流动性好、交易活跃的期货合约进行交易，以调节组合久期及期限、对冲潜在风险。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,151.08
2	应收清算款	10,651,149.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,666,300.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A	13,783	115,557.32	1,338,641,132.66	84.05%	254,085,400.46	15.95%
易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C	977	29,731.95	0.00	0.00%	29,048,117.95	100.00%
合计	14,760	109,876.33	1,338,641,132.66	82.54%	283,133,518.41	17.46%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A	79,061.00	0.0050%
	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C	0.00	0.0000%
	合计	79,061.00	0.0049%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A	0
	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A	0
	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C	0
	合计	0

8.4 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	0.6166%	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	0.6166%	-

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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 A	易方达年年恒秋纯债一年定开债券 C
基金合同生效日（2019 年 10 月 31 日）基金份额总额	4,630,698,395.01	1,048,370,439.96
本报告期期初基金份额总额	1,590,086,581.64	29,006,034.16
本报告期基金总申购份额	2,639,951.48	42,083.79
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,592,726,533.12	29,048,117.95

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为财通证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华西证券股份有限公司。

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。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

1）财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；

2）具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；

3）具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；

4）具有较强的研究、交易服务能力；

5）佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c）本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	413,386,400.00	74.62%	20,042,000,000.00	68.34%	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	140,604,300.00	25.38%	9,285,100,000.00	31.66%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
3	易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-13
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-01-22
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
6	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
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（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报	2026-03-31
9	易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-04
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-04-22
11	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2026-04-23

	迁移安排的联合提示性公告	电子披露网站	
12	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
13	易方达基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29
14	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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 01 月 01 日~2026 年 06 月 30 日	490,820,653.77	0.00	0.00	490,820,653.77	30.26%
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延缓支付或延期办理赎回申请，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五十个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会；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。						

§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年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；

2.《易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；

3.《易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券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。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日