易方达丰和债券型证券投资基金
2022 年年度报告
2022 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 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。安永华明会计师事务所（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 2022 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 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15
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 16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 20
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 20
§5 托管人报告 20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 20
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 20
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 21
§6 审计报告 21
6.1 审计意见 21
6.2 形成审计意见的基础 21
6.3 其他信息 21
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 21
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 22
§7 年度财务报表 23
7.1 资产负债表 23
7.2 利润表 25
7.3 净资产（基金净值）变动表 26
7.4 报表附注 28
§8 投资组合报告 60
8.1 期末基金资产组合情况 60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 60
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 61

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 64
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 65
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 65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 65
8.12 投资组合报告附注 66
§9 基金份额持有人信息 68
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
§10 开放式基金份额变动 69
§11 重大事件揭示 69
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 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
§12 备查文件目录 73
12.1 备查文件目录 73
12.2 存放地点 73
12.3 查阅方式 73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达丰和债券型证券投资基金	
基金简称	易方达丰和债券	
基金主代码	002969	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 23 日	
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	
报告期末基金份额总额	10,615,785,659.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C
下属分级基金的交易代码	002969	016699
报告期末下属分级基金的份额总额	10,569,550,280.94 份	46,235,378.29 份

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

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。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；本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。3、本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。4、本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。5、本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交

	易,以对冲投资组合的系统性风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路 30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

§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	2022 年		2021 年		2020 年	
	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C
本期已实现收益	465,006,683.30	-272,716.35	901,451,661.90	-	535,556,117.12	-
本期利润	-1,019,438,851.62	578,842.09	926,345,024.75	-	1,129,047,404.92	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0668	0.1019	0.0630	-	0.1337	-
本期加权平均净值利润率	-5.05%	7.85%	4.47%	-	10.27%	-
本期基金份额净值增长率	-4.02%	-0.35%	5.85%	-	11.17%	-
3.1.2 期末数据和指标	**2022 年末**		**2021 年末**		**2020 年末**	
	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C
期末可供分配利润	1,954,619,442.61	8,486,575.84	3,335,155,198.43	-	2,239,201,474.36	-
期末可供分配基金份额利润	0.1849	0.1836	0.1629	-	0.2084	-
期末基金资产净值	13,804,957,809.14	60,323,735.92	27,861,851,569.87	-	14,934,173,121.89	-
期末基	1.3061	1.3047	1.3608	-	1.3897	-

金份额净值						
3.1.3 累计期末指标	**2022 年末**		**2021 年末**		**2020 年末**	
	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C
基金份额累计净值增长率	41.18%	-0.35%	47.10%	-	38.97%	-

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

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

易方达丰和债券 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	-0.22%	0.28%	0.31%	0.18%	-0.53%	0.10%
过去六个月	-3.46%	0.25%	-0.94%	0.16%	-2.52%	0.09%
过去一年	-4.02%	0.29%	-0.78%	0.19%	-3.24%	0.10%
过去三年	12.94%	0.33%	9.34%	0.19%	3.60%	0.14%
过去五年	27.94%	0.32%	21.71%	0.19%	6.23%	0.13%
自基金合同生效起至今	41.18%	0.30%	23.40%	0.18%	17.78%	0.12%

易方达丰和债券 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	-0.33%	0.29%	0.31%	0.18%	-0.64%	0.11%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-

过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-0.35%	0.28%	0.14%	0.18%	-0.49%	0.10%

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

易方达丰和债券型证券投资基金

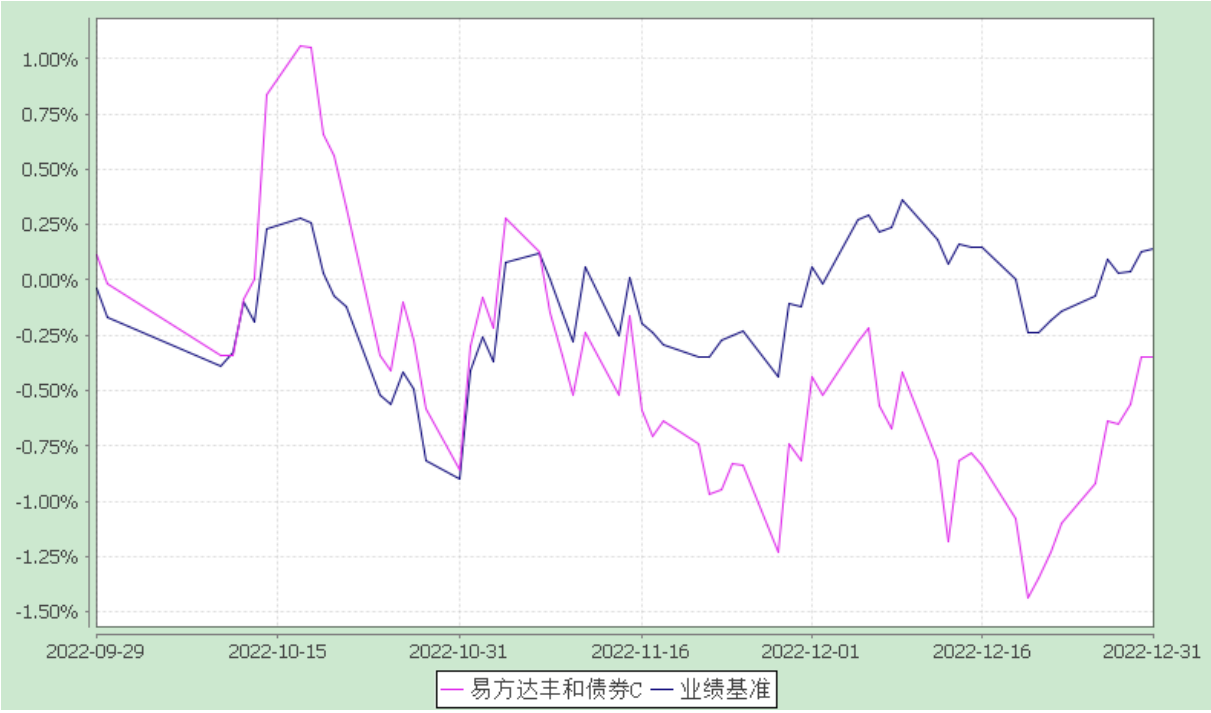
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

易方达丰和债券 A

（2016 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 31 日）

易方达丰和债券 C

（2022 年 9 月 29 日至 2022 年 12 月 31 日）



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

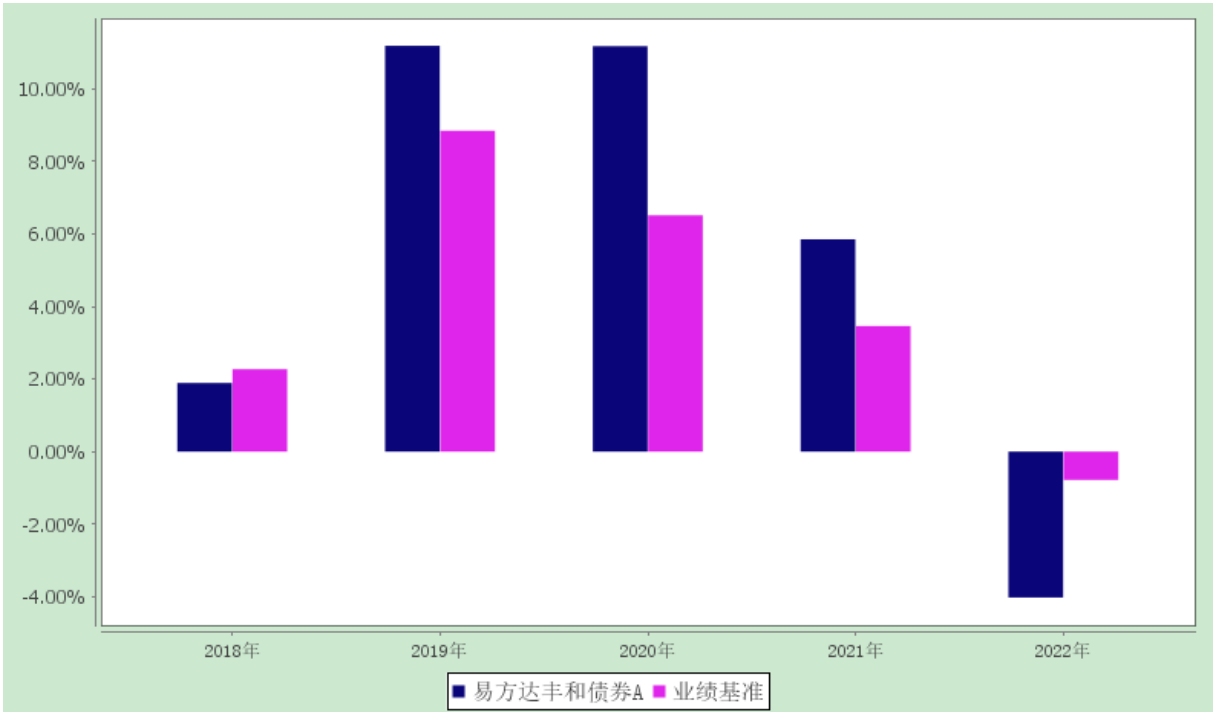
2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 41.18%，同期业绩比较基准收益率为 23.40%；C 类基金份额净值增长率为-0.35%，同期业绩比较基准收益率为 0.14%。

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

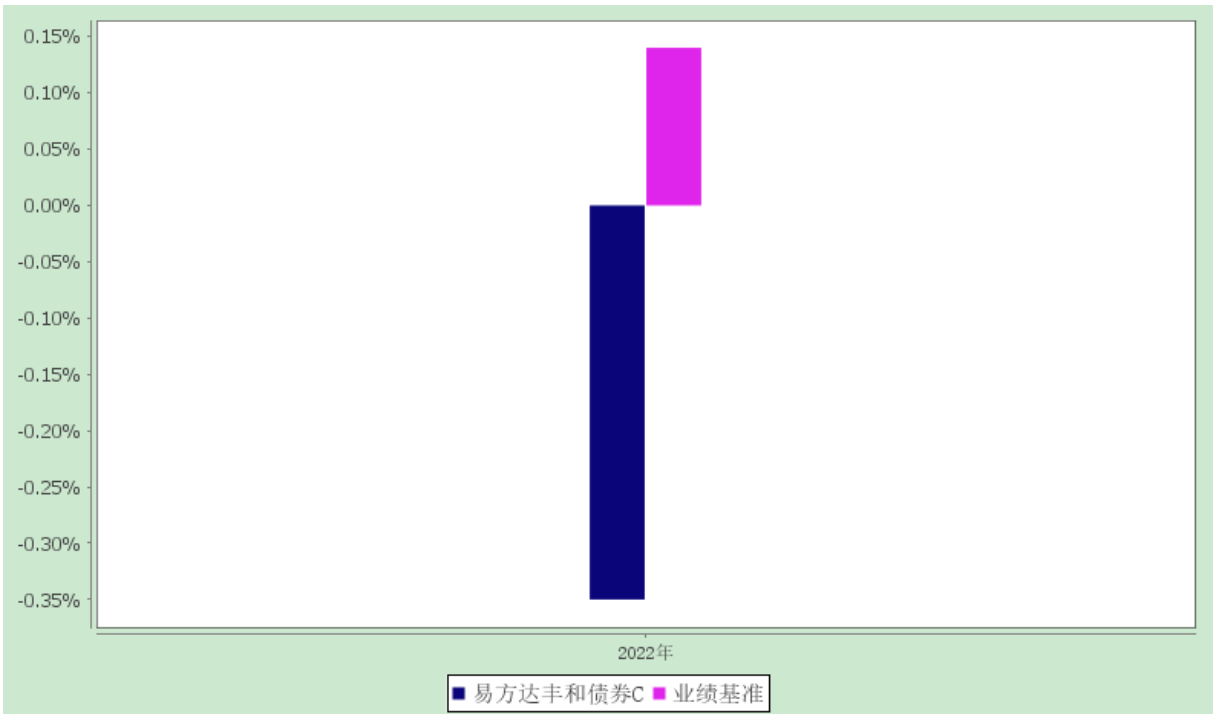
易方达丰和债券型证券投资基金

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

易方达丰和债券 A



易方达丰和债券 C



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

易方达丰和债券 A

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	1.090	1,449,849,071.68	425,064,638.03	1,874,913,709.71	-
合计	1.090	1,449,849,071.68	425,064,638.03	1,874,913,709.71	-

§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。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，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		
张清华	本基金的基金经理，易方达安心回报债券、易方达裕丰回报债券、易方达安盈回报混合、易方达新收益混合、易方达丰华债券（自 2019 年 02 月 19 日至 2022 年 03 月 21 日）、易方达悦兴一年持有混合的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员	2016-11-23	-	15 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，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、易方达磐固六个月持有混合的基

					金经理。
张雅君	本基金的基金经理助理，易方达纯债债券、易方达裕丰回报债券、易方达裕富债券、易方达招易一年持有混合、易方达磐恒九个月持有混合、易方达磐泰一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、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，易方达安心回报债券、易方达磐固六个月持有混合（自 2020 年 09 月 15 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦兴一年持有混合（自 2020 年 12 月 01 日至 2022 年 05 月 19 日）的基金经理助理，多资产公募投资部总经理、多资产研究部总经理	2019-04-04	-	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任海通证券股份有限公司项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员、固定收益研究员、固定收益基金投资部总经理助理、混合资产投资部总经理助理、多资产公募投资部负责人，易方达增强回报债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达裕祥回报债券、易方达富惠纯债债券、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达恒益定开债券发起式、易方达富财纯债债券、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式的基金经理。
杨康	本基金的基金经理助理，易方达鑫转增利混合、易方达鑫转招利混合、易方达瑞川混合发起式（自 2020 年 04 月 22 日至 2022 年 05 月 23 日）、易方达瑞锦混合发起式（自 2020 年 07 月 07 日至 2022 年 05 月 23 日）、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、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、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞信混合、易方达瑞选混合、易方达瑞和混合、易方达瑞富混合、易方达瑞祺混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达丰惠混合、易方达裕鑫债券、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达鑫转添利混合、易方达瑞川混合发起式、易方达瑞锦混合发起式的基金经理，易方达安盈回报混合、易方达丰华债券、易方达安心回报债券、易方达裕丰回报债券、易方达招易一年持有混合（自 2020 年 07 月 09 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达磐恒九个月持有混合（自 2020 年 08 月 11 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达磐泰一年持有混合（自 2020 年 08 月 20 日至 2022 年 05 月 24 日）、	2019-10-11	-	7 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。

	易方达磐固六个月持有混合（自 2020 年 09 月 15 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦享一年持有混合（自 2020 年 09 月 24 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦兴一年持有混合（自 2020 年 12 月 01 日至 2022 年 05 月 19 日）、易方达悦通一年持有混合（自 2020 年 12 月 18 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达鑫转添利混合（自 2021 年 01 月 22 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦盈一年持有混合（自 2021 年 02 月 05 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦弘一年持有混合（自 2021 年 02 月 25 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达宁易一年持有混合（自 2021 年 04 月 30 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达磐恒九个月持有混合、易方达招易一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合、易方达悦浦一年持有混合的基金经理助理				
周琼	本基金的基金经理助理，易方达鑫转添利混合、易方达鑫转招利混合、易方达高等级信用债债券（自 2019 年 09 月 05 日至 2022 年 05 月 19 日）、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券（自 2019 年 09 月 05 日至 2022 年 05 月 19 日）、易方达裕丰回报债券、易方达丰华债券、易方达新收益混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达安盈回报混合、易方达裕鑫债券、易方达鑫转增利混合、易方达安心回报债券、易方达纯债债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新益混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞选混合、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、易方达裕富债券、易方达瑞川混合发起式、易方达丰惠混合、易方达招易一年持有混合、易方达瑞锦混合发起式、易方达磐恒九个月持有混合、易方达磐泰一	2019-10-11	-	8 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。

	年持有混合、易方达磐固六个月持有混合、易方达悦享一年持有混合、易方达悦兴一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达瑞富混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦浦一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦稳一年持有混合、易方达安心回馈混合、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理助理				

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/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.自2023年2月24日起，杨康不再担任本基金的基金经理助理。

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、公平交易执行程序和分配原则、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 42 次，其中 27 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，15 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

2022 年全球资本市场发生大幅震荡，市场持续受到诸如俄乌地缘冲突、海外货币紧缩、疫情扩散等风险因素的扰动。回顾全年，国内经济稳增长压力始终存在，资产定价在弱现实与强预期的拉

扯下此消彼长；海外通胀压力始终高企，货币政策在压通胀与防止经济衰退之间平衡的难度加大。

2022 年国内与海外经济错位，国内资本市场阶段性受到内外因素的影响，但市场整体呈现“以我为主”的特点，国内经济基本面疲弱主导股票市场走弱。有两个时期市场表现出了显著的预期推动。第一次是在 5-6 月，疫情得到控制、各地复产复工加速推进、中央与地方稳增长政策陆续出台，股指超跌反弹，债券收益率有所调整，但在短端资金价格维持低位的牵引下并未突破前高。第二次是在 11 月至年末，随着疫情防控政策的优化、地产救助政策的相继落地，政策出台的节奏和力度展现出了超预期稳增长的决心，对经济过度悲观的预期迅速得到修正，权益市场估值修复且伴随着明显的风格切换特征，消费及地产相关板块领涨。债券市场长短端收益率均出现大幅调整并创出年内新高，在此过程中银行理财资金发生了下跌赎回的负反馈，信用利差大幅走阔。

全年来看，1-10 月债市偏强，中高等级信用利差持续压缩；11 月以来市场快速从牛陡切换至熊平，信用利差也迅速走阔至年内高位，1 年和 10 年国债收益率分别下行 15bp 和上行 6bp，3 年 AAA 信用债收益率上行 26bp。权益市场全年走势偏弱，与宏观经济相对应，10 月之前呈现了上游强、中下游弱的特点，上游能源价格高企、中下游盈利整体受挤压，11 月之后受益于疫情修复及经济增长，相关板块有较好表现。转债市场正股弱、估值贵、赎回多三重压力贯穿全年，平价与估值双杀，中证转债指数全年下跌超 10%，节奏上年中转债基本跟随股市，年底在债券市场的调整过程中估值进一步压缩；偏股型与小盘转债跌幅较大，大盘转债相对平稳。

2022 年的市场值得审视与反思。回顾历史，我们极少经历如此长时期“弱现实”与“强预期”的对立，预期相对于基本面更难以研究与分析，这对投资带来了极大的挑战。从各种复杂的信息中提炼出市场的主要矛盾并迅速做出调整应对，就显得尤为重要，这需要我们时常审视自己的组合是否规避了极端配置、是否保持足够的灵活性以应对各种可能发生的情形、对未来路标的挑选与迭代是否有效。另外，在理财净值化大背景下，11 月债券市场大幅调整引发了银行理财赎回的负反馈，机构行为对市场价格造成如此剧烈的影响，且影响的时长与幅度均超出预期。市场的一致预期与投资者的一致行动，很容易形成过度拥挤的交易，并可能短期内对市场价格造成超预期的巨大波动，这需要我们对市场更加心存警惕。

报告期内，本基金规模有所下降。大类资产配置上，全年市场不确定因素较多，组合投资策略上增加自上而下的权重，仓位调整积极。股票方面，经过年初前 4 个月市场的大幅调整，很多优质公司已经进入相对合理甚至低估的位置，赔率具备吸引力，因此组合维持相对中性的权益仓位，直至 6 月市场情绪改善，组合在反弹过程中适当降低成长股持仓；7 月之后考虑到地产持续下滑、稳增长政策力度不及预期，组合进一步降低了权益仓位，直至 11 月防疫和地产政策更加明朗后，择机将仓位提升至年内最高水平。行业配置上，组合减持了竞争格局恶化的光伏、受到政策不确定影响

的医药行业，加仓了受益于疫后修复的消费行业。转债方面，组合年初减仓了部分高价转债，此后随着转债估值下降，转债仓位和弹性都有所提升，整体配置上仍以大盘平衡型转债为主，加仓了部分正股弹性较大、溢价率合理偏低的弹性个券，此外小幅配置估值合理的新券。债券方面，二季度以来资金价格保持低位，组合保持较高的杠杆水平，持仓以高等级信用债和银行资本补充工具为主获取票息收益，关注信用风险，持续对持仓个券进行优化，同时积极参与利率债的波段交易。

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 1.3061 元，本报告期份额净值增长率为-4.02%，同期业绩比较基准收益率为-0.78%；C 类基金份额净值为 1.3047 元，本报告期份额净值增长率为-0.35%，同期业绩比较基准收益率为 0.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年中国经济持续处于低位，考虑到疫情和地产政策逐步调整，中国经济再次下滑的风险已经大幅下降，2023 年内需大概率将转向复苏。但是考虑到外需压力，内需复苏强度能够支撑整体经济到达什么高度将是 2023 年市场的关键变量。我们倾向于认为 2023 年地产和消费将出现改善，但出口承压、财政有所退坡，全年经济呈现弱复苏格局。参考 2022 年的经验教训，全年的经济走势还面临很多的不确定性，相对而言，上半年弱复苏的置信度相对更高，而下半年的经济走势还需要进一步的观察与验证。债券方面，在经济复苏力度较弱的背景下，由于预期改善带来的利率上行都会最终跟随实际的经济走势，考虑到海外经济下滑、汇率压力缓解，国内稳增长压力仍大，预计流动性仍将维持宽松，债券市场利率抬升的幅度非常有限。权益资产方面，经济从衰退周期的末端逐步进入复苏周期的过程中，预期改善将驱动第一波权益资产价格的修复，而第二波资产价格的上涨则需要看到盈利预期的回升。目前市场可能已经完成了第一波预期修复，未来需要更多基本面的确认，如果不能看到基本面与盈利的确定性改善，市场将缺乏明确的方向，更多是以结构性机会为主。转债资产方面，虽然权益市场较低的估值及经济复苏的预期带来正股方面的机会，但偏高的转债估值会压制机会的级别，转债更多以个券选择为主。

考虑到市场的变化，投资策略上本基金将加大自上而下资产配置的权重。债券部分仍将以中高等级信用债为主，保持一定的杠杆水平，以获取票息收益为主，降低信用风险，积极参与利率波段及债券类属品种的交易机会；权益部分在自身能力圈的范围内，组合将加大消费、化工、高端制造等几大长期跟踪覆盖行业内的结构优化；转债部分，组合将积极进行个券挖掘。本基金力争以长期稳健的业绩回报基金持有人。

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，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规

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并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了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及措施如下：

（1）不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上的核心价值观，加强员工合规风控、廉洁从业教育培训并完善合规监督考评机制，筑牢廉洁从业的红线认识，不断提高员工合规风控意识。

（2）坚持投资合规风险闭环管理，认真贯彻落实法律法规、基金合同和公司制度的各项控制要求，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示、情况核查和结果跟踪；持续推动投资、研究、交易等业务部门完善相应内控机制；加强公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

（3）持续提升产品合规审查质量，督促健全基金募集申请材料质量内控机制和工具手段；坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

（4）持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求，加强营销宣传、销售、客服等环节的合规管控，深入落实投资者适当性管理，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度，着力提高投资者获得感。

（5）持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，完善信息披露管理工作机制流程，不断提高信息披露文件制作、审核、报送的系统化水平，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

（6）贯彻落实风险为本的工作方法，进一步修订制度流程、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，建立健全洗钱风险自评估工作机制，扎实开展风险自评估，持续完善风险管控措施，不断提高反洗钱合规和风险管理水平。

（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、产品运营、信息技术、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，同时参考国际标准，聘请外部机构开展内控合规评估和业绩标准鉴证，报告期内通过 ISAE3402（国际鉴证业务准则 3402 号）内控鉴证和 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，通过内外部不同视角审视公司内控机制和执行情况，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政策和程序，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

易方达丰和债券 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达丰和债券 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达丰和债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2023）审字第 60468000_G18 号

易方达丰和债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达丰和债券型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达丰和债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达丰和债券型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

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，我们独立于易方达丰和债券型证券投资基金，并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 其他信息

易方达丰和债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估易方达丰和债券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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达丰和债券型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 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，就可能导致对易方达丰和债券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丰和债券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（包括披露）、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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

昌华　马婧

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2023 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达丰和债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,502,279.80	2,201,490.89
结算备付金		182,685,658.34	168,430,580.85
存出保证金		824,730.18	458,687.72
交易性金融资产	7.4.7.2	18,283,440,371.62	32,641,901,777.28
其中：股票投资		2,527,378,339.80	4,198,233,534.19
基金投资		-	-
债券投资		15,209,918,922.22	27,316,918,743.09
资产支持证券投资		546,143,109.60	1,126,749,500.00
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	-	-
应收清算款		91,277,770.74	700,580,005.52
应收股利		-	-
应收申购款		1,751,035.26	28,974,511.78
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.5	-	334,726,747.16
资产总计		**18,561,481,845.94**	**33,877,273,801.20**
负债和净资产	**附注号**	**本期末** **2022 年 12 月 31 日**	**上年度末** **2021 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		4,536,303,173.16	5,038,125,928.05
应付清算款		85,667,584.86	687,807,480.95
应付赎回款		61,756,389.17	266,849,488.20
应付管理人报酬		8,443,005.83	15,651,959.51
应付托管费		2,412,287.40	4,471,988.47
应付销售服务费		6,060.90	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		536,167.11	1,542,031.55
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,075,632.45	973,354.60
负债合计		**4,696,200,300.88**	**6,015,422,231.33**
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	10,615,785,659.23	20,474,869,034.41
未分配利润	7.4.7.8	3,249,495,885.83	7,386,982,535.46
净资产合计		**13,865,281,545.06**	**27,861,851,569.87**
负债和净资产总计		**18,561,481,845.94**	**33,877,273,801.20**

注：1.报告截止日 2022 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.3061 元，C 类基金份额净值 1.3047 元；基金份额总额 10,615,785,659.23 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 10,569,550,280.94 份，C 类基金份额总额 46,235,378.29 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年末

资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：易方达丰和债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		**-742,212,671.17**	**1,168,830,621.35**
1.利息收入		3,755,385.14	644,037,702.23
其中：存款利息收入	7.4.7.9	3,735,675.81	2,917,914.19
债券利息收入		-	612,043,566.48
资产支持证券利息收入		-	28,207,607.78
买入返售金融资产收入		19,709.33	868,613.78
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		733,519,062.87	485,962,118.55
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-101,698,339.87	378,440,703.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	763,243,004.66	91,248,920.21
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	28,242,270.45	55,916.44
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	43,732,127.63	16,216,578.13
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	-1,483,593,976.48	24,893,362.85
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	4,106,857.30	13,937,437.72

减：二、营业总支出		**276,647,338.36**	**242,485,596.60**
1．管理人报酬		142,607,974.78	144,745,922.41
2．托管费		40,745,135.63	41,355,977.83
3．销售服务费		6,331.14	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		91,552,853.32	49,917,548.93
其中：卖出回购金融资产支出		91,552,853.32	49,917,548.93
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7．税金及附加		1,336,505.03	1,974,607.55
8．其他费用	7.4.7.18	398,538.46	4,491,539.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-1,018,860,009.53**	**926,345,024.75**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-1,018,860,009.53**	**926,345,024.75**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		**-1,018,860,009.53**	**926,345,024.75**

注：1.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年度利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

2.上表中以下本期数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：本年度报告利润表中“投资收益“项目对应品种的投资收益已扣减对应投资品种产生的交易费用。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达丰和债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	**本期** **2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	20,474,869,034.41	7,386,982,535.46	27,861,851,569.87

二、本期期初净资产（基金净值）	20,474,869,034.41	7,386,982,535.46	27,861,851,569.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,859,083,375.18	-4,137,486,649.63	-13,996,570,024.81
（一）、综合收益总额	-	-1,018,860,009.53	-1,018,860,009.53
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-9,859,083,375.18	-3,118,626,640.10	-12,977,710,015.28
其中：1.基金申购款	3,512,253,654.83	1,189,585,369.45	4,701,839,024.28
2.基金赎回款	-13,371,337,030.01	-4,308,212,009.55	-17,679,549,039.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	10,615,785,659.23	3,249,495,885.83	13,865,281,545.06
项目	**上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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（基金净值）	10,746,590,798.04	4,187,582,323.85	14,934,173,121.89
二、本期期初净资产（基金净值）	10,746,590,798.04	4,187,582,323.85	14,934,173,121.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,728,278,236.37	3,199,400,211.61	12,927,678,447.98
（一）、综合收益总额	-	926,345,024.75	926,345,024.75
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	9,728,278,236.37	4,147,968,896.57	13,876,247,132.94
其中：1.基金申购款	23,780,539,388.15	9,915,580,942.56	33,696,120,330.71
2.基金赎回款	-14,052,261,151.78	-5,767,612,045.99	-19,819,873,197.77

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,874,913,709.71	-1,874,913,709.71
四、本期期末净资产（基金净值）	20,474,869,034.41	7,386,982,535.46	27,861,851,569.87

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：刘晓艳，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

易方达丰和债券型证券投资基金(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[2016]1410 号《关于准予易方达丰和债券型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《易方达丰和债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达丰和债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,225,241,305.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 990,590.83 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

7.4.2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、应用指南、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》、《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。

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基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4重要会计政策和会计估计

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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基

金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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）不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

（5）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（6）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（7）公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（8）其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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)在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)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；

(3)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；

(4)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；

(5)在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；

(6)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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于

以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,201,490.89 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,707.36 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,204,198.25 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 168,430,580.85 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 76,570.50 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 168,507,151.35 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 458,687.72 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 206.40 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 458,894.12 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 334,726,747.16 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,707.36 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 76,570.50 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 206.40 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 334,647,262.90 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

32,641,901,777.28 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 334,647,262.90 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 32,976,549,040.18 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,038,125,928.05 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币-194,649.15 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,037,931,278.90 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币-194,649.15 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币-194,649.15 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（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；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

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费附加。

（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。

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,502,279.80	2,201,490.89
等于：本金	1,502,140.70	2,201,490.89
加：应计利息	139.10	-
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	1,502,279.80	2,201,490.89

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,901,548,015.46	-	2,527,378,339.80	-374,169,675.66
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,177,365,617.13	30,543,424.01	3,193,320,792.32	-14,588,248.82

	银行间市场	11,978,114,226.86	123,130,229.90	12,016,598,129.90	-84,646,326.86
	合计	15,155,479,843.99	153,673,653.91	15,209,918,922.22	-99,234,575.68
资产支持证券		543,840,000.00	2,122,109.60	546,143,109.60	181,000.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		18,600,867,859.45	155,795,763.51	18,283,440,371.62	-473,223,251.34
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,510,606,692.06	-	4,198,233,534.19	687,626,842.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,294,126,655.62	-	7,478,952,243.09	184,825,587.47
	银行间市场	19,703,754,068.39	-	19,837,966,500.00	134,212,431.61
	合计	26,997,880,724.01	-	27,316,918,743.09	319,038,019.08
资产支持证券		1,123,043,636.07	-	1,126,749,500.00	3,705,863.93
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		31,631,531,052.14	-	32,641,901,777.28	1,010,370,725.14

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

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	334,726,747.16
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	334,726,747.16

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	25,102.89	65,906.52
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	819,429.56	870,997.23
其中：交易所市场	638,159.76	737,877.81
银行间市场	181,269.80	133,119.42
应付利息	-	-194,649.15
预提费用	231,100.00	231,100.00
合计	1,075,632.45	973,354.60

7.4.7.7 实收基金

易方达丰和债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,474,869,034.41	20,474,869,034.41
本期申购	3,466,006,142.68	3,466,006,142.68
本期赎回（以“-”号填列）	-13,371,324,896.15	-13,371,324,896.15
本期末	10,569,550,280.94	10,569,550,280.94

易方达丰和债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	46,247,512.15	46,247,512.15
本期赎回（以“-”号填列）	-12,133.86	-12,133.86
本期末	46,235,378.29	46,235,378.29

注：1.自 2022 年 9 月 28 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 9 月 29 日。

2.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

易方达丰和债券 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	3,335,155,198.43	4,051,827,337.03	7,386,982,535.46
本期利润	465,006,683.30	-1,484,445,534.92	-1,019,438,851.62
本期基金份额交易产生的变动数	-1,845,542,439.12	-1,286,593,716.52	-3,132,136,155.64
其中：基金申购款	597,840,012.19	578,232,209.24	1,176,072,221.43
基金赎回款	-2,443,382,451.31	-1,864,825,925.76	-4,308,208,377.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,954,619,442.61	1,280,788,085.59	3,235,407,528.20

易方达丰和债券 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	-	-	-
本期利润	-272,716.35	851,558.44	578,842.09
本期基金份额交易产生的变动数	8,759,292.19	4,750,223.35	13,509,515.54
其中：基金申购款	8,761,721.28	4,751,426.74	13,513,148.02
基金赎回款	-2,429.09	-1,203.39	-3,632.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,486,575.84	5,601,781.79	14,088,357.63

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	168,414.06	137,493.77
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	3,554,913.22	2,773,155.30
其他	12,348.53	7,265.12
合计	3,735,675.81	2,917,914.19

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-101,698,339.87	378,440,703.77
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	-101,698,339.87	378,440,703.77

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,955,374,322.97	1,131,679,997.59
减：卖出股票成本总额	2,052,475,288.14	753,239,293.82
减：交易费用	4,597,374.70	-
买卖股票差价收入	-101,698,339.87	378,440,703.77

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	655,825,316.41	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	107,417,688.25	91,248,920.21
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	763,243,004.66	91,248,920.21

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	27,506,909,024.66	11,951,323,847.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	27,007,463,430.19	11,653,616,706.15
减：应计利息总额	391,771,420.43	206,458,221.49
减：交易费用	256,485.79	-
买卖债券差价收入	107,417,688.25	91,248,920.21

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	27,820,063.73	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	422,206.72	55,916.44
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	28,242,270.45	55,916.44

7.4.7.12.2 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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	756,231,182.48	381,247,192.09
减：卖出资产支持证券成本总额	739,203,636.07	370,294,000.00
减：应计利息总额	16,605,339.69	10,897,275.65
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	422,206.72	55,916.44

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	43,732,127.63	16,216,578.13
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	43,732,127.63	16,216,578.13

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-1,483,593,976.48	24,893,362.85
——股票投资	-1,061,796,517.79	-343,523,056.93
——债券投资	-418,272,594.76	365,259,305.85
——资产支持证券投资	-3,524,863.93	3,157,113.93
——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	-1,483,593,976.48	24,893,362.85

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	4,106,657.30	13,937,162.61
其他	200.00	275.11
合计	4,106,857.30	13,937,437.72

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日

审计费用	111,100.00	111,100.00
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	34,350.00	32,150.00
银行汇划费	131,888.46	117,894.74
其他	1,200.00	1,200.00
交易费用	-	4,109,195.14
合计	398,538.46	4,491,539.88

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

注：1. 珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）自 2022 年 9 月 9 日起名称分别变更为珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）、

珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）。

2.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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	118,508.94	0.00%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	71.12	0.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务

等。

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	142,607,974.78	144,745,922.41
其中：支付销售机构的客户维护费	37,560,048.99	43,005,460.60

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.70%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	40,745,135.63	41,355,977.83

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×0.20%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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	本期

关联方名称	2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	5,045.64	5,045.64
合计	-	5,045.64	5,045.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达丰和债券A	易方达丰和债券C	合计
合计	-	-	-

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×0.40%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付。

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	40,013,893.14	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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。

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

易方达丰和债券 A

无。

易方达丰和债券 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国银行-活期存款	1,502,279.80	168,414.06	2,201,490.89	137,493.77

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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：股/张）	总金额
中银国际证券股份有限公司	600938	中国海油	新股网上发行	3,000	32,400.00

上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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：股/张）	总金额
中银国际证券股份有限公司	600941	中国移动	新股网上发行	1,000	57,580.00
中银国际证券股份有限公司	601728	中国电信	新股网上发行	30,000	135,900.00
中银国际证券股份有限公司	113052	兴业转债	新债网下发行	49,290	4,929,000.00

注：中银国际证券股份有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方。

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

易方达丰和债券 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达丰和债券 C

本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2022 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：资产支持证券										
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
112561	22 和闽优	2022-12-13	1-6 个月（含）	新发流通受限	100.00	100.17	500,000	50,000,000.00	50,086,794.52	-
112592	G 重	2022-12-23	1 个月内	新发	100.00	100.06	200,000	20,000,000.0	20,012,072.	-

	庆优		（含）	流通受限				0	33	
135755	22 吉电优	2022-12-28	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.03	300,000	30,000,000.00	30,008,482.19	-

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 2022 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 2,844,816,084.43 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
102000364	20 汇金 MTN004	2023-01-03	102.60	499,000	51,195,423.14
102001544	20 金融街资 MTN001	2023-01-03	101.52	500,000	50,760,479.45
102280800	22 光大集团 MTN001	2023-01-03	101.93	900,000	91,734,805.48
2028024	20 中信银行二级	2023-01-03	102.49	5,264,000	539,494,236.06
2028025	20 浦发银行二级 01	2023-01-03	102.61	1,517,000	155,660,600.23
2128033	21 建设银行二级 03	2023-01-03	100.58	1,064,000	107,015,196.05
2128042	21 兴业银行二级 02	2023-01-03	99.87	5,619,000	561,189,573.66
2128044	21 工商银行永续债 02	2023-01-03	99.23	1,613,000	160,054,764.00
220211	22 国开 11	2023-01-03	100.54	4,160,000	418,239,903.56
092280083	22 建行永续债 01	2023-01-04	97.48	1,700,000	165,720,564.38
102100647	21 大悦城 MTN001	2023-01-04	102.75	257,000	26,406,310.63
102281291	22 中交建 MTN001	2023-01-04	100.61	1,300,000	130,789,936.99
2128021	21 工商银行永续债 01	2023-01-04	102.79	785,000	80,692,459.84
2128047	21 招商银行	2023-01-04	98.88	3,500,000	346,087,671.24

	永续债				
220211	22 国开 11	2023-01-06	100.54	1,905,000	191,525,725.07
合计				30,583,000	3,076,567,649.78

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 1,691,487,088.73 元，于 2023 年 1 月 3 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。本基金在日常经营活动中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 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、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 108.42%(2021 年 12 月 31 日：95.42%)。

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	162,090,706.30
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	733,915,995.06	1,964,039,428.21
合计	733,915,995.06	2,126,130,134.51

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短期融资券。

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 2022年12月31日	上年度末 2021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 2022年12月31日	上年度末 2021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	上年度末

	2022年12月31日	2021年12月31日
AAA	12,790,343,132.72	21,815,783,847.89
AAA 以下	644,532,661.84	2,027,400,325.85
未评级	1,041,127,132.60	1,476,691,299.71
合计	14,476,002,927.16	25,319,875,473.45

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、政策性金融债和央票。

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	546,143,109.60	1,135,258,835.01
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	546,143,109.60	1,135,258,835.01

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	197,051,063.02
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	197,051,063.02

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 2022 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。

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 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,502,279.80	-	-	-	1,502,279.80
结算备付金	182,685,658.34	-	-	-	182,685,658.34
存出保证金	824,730.18	-	-	-	824,730.18
交易性金融资产	2,403,879,345.96	7,645,632,124.10	5,706,550,561.76	2,527,378,339.80	18,283,440,371.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	91,277,770.74	91,277,770.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,751,035.26	1,751,035.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,588,892,014.28	7,645,632,124.10	5,706,550,561.76	2,620,407,145.80	18,561,481,845.94
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	4,536,303,173.16	-	-	-	4,536,303,173.16
应付清算款	-	-	-	85,667,584.86	85,667,584.86
应付赎回款	-	-	-	61,756,389.17	61,756,389.17
应付管理人报酬	-	-	-	8,443,005.83	8,443,005.83
应付托管费	-	-	-	2,412,287.40	2,412,287.40
应付销售服务费	-	-	-	6,060.90	6,060.90
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	536,167.11	536,167.11
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,075,632.45	1,075,632.45
负债总计	4,536,303,173.16	-	-	159,897,127.72	4,696,200,300.88
利率敏感度缺口	-1,947,411,158.88	7,645,632,124.10	5,706,550,561.76	2,460,510,018.08	13,865,281,54

					5.06
上年度末 2021 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	2,201,490.89	-	-	-	2,201,490.89
结算备付金	168,430,580.85	-	-	-	168,430,580.85
存出保证金	458,687.72	-	-	-	458,687.72
交易性金融资产	5,964,516,590.80	16,534,967,480.26	5,944,184,172.03	4,198,233,534.19	32,641,901,777.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	700,580,005.52	700,580,005.52
应收利息	-	-	-	334,726,747.16	334,726,747.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	28,974,511.78	28,974,511.78
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,135,607,350.26	16,534,967,480.26	5,944,184,172.03	5,262,514,798.65	33,877,273,801.20
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	5,038,125,928.05	-	-	-	5,038,125,928.05
应付证券清算款	-	-	-	687,807,480.95	687,807,480.95
应付赎回款	-	-	-	266,849,488.20	266,849,488.20
应付管理人报酬	-	-	-	15,651,959.51	15,651,959.51
应付托管费	-	-	-	4,471,988.47	4,471,988.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	870,997.23	870,997.23
应交税费	-	-	-	1,542,031.55	1,542,031.55
应付利息	-	-	-	-194,649.15	-194,649.15

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	297,006.52	297,006.52
负债总计	5,038,125,928.05	-	-	977,296,303.28	6,015,422,231.33
利率敏感度缺口	1,097,481,422.21	16,534,967,480.26	5,944,184,172.03	4,285,218,495.37	27,861,851,569.87

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影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	90,926,696.39	155,597,895.42
	2.市场利率上升 25 个基点	-89,918,537.37	-153,979,554.84

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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例（%）		值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	2,527,378,339.80	18.23	4,198,233,534.19	15.07
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	2,527,378,339.80	18.23	4,198,233,534.19	15.07

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影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,050,800,747.86	2,027,847,107.17
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,050,800,747.86	-2,027,847,107.17

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	3,563,002,408.78	5,728,466,694.04
第二层次	14,720,437,962.84	26,913,435,083.24
第三层次	-	-
合计	18,283,440,371.62	32,641,901,777.28

7.4.14.2.2 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。

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

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。

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	2,527,378,339.80	13.62
	其中：股票	2,527,378,339.80	13.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,756,062,031.82	84.89
	其中：债券	15,209,918,922.22	81.94
	资产支持证券	546,143,109.60	2.94
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	184,187,938.14	0.99
8	其他各项资产	93,853,536.18	0.51
9	合计	18,561,481,845.94	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	47,799,988.00	0.34
C	制造业	1,725,817,939.26	12.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,715,966.85	0.66
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	78,932,675.88	0.57
J	金融业	417,468,386.60	3.01
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	43,968,906.00	0.32
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	121,674,477.21	0.88
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,527,378,339.80	18.23

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	002415	海康威视	8,100,031	280,909,075.08	2.03
2	002304	洋河股份	1,518,343	243,694,051.50	1.76
3	600486	扬农化工	2,293,823	238,328,209.70	1.72
4	000858	五粮液	1,289,501	232,999,935.69	1.68
5	600036	招商银行	6,225,700	231,969,582.00	1.67
6	300628	亿联网络	2,195,812	133,044,249.08	0.96

7	300059	东方财富	6,144,739	119,207,936.60	0.86
8	603882	金域医学	1,234,292	96,521,634.40	0.70
9	600886	国投电力	8,468,695	91,715,966.85	0.66
10	688188	柏楚电子	363,611	78,932,675.88	0.57
11	603806	福斯特	1,186,091	78,803,886.04	0.57
12	600309	万华化学	846,100	78,391,165.00	0.57
13	300558	贝达药业	1,498,361	73,824,246.47	0.53
14	601012	隆基绿能	1,746,159	73,792,679.34	0.53
15	000001	平安银行	5,037,300	66,290,868.00	0.48
16	000661	长春高新	380,537	63,340,383.65	0.46
17	600519	贵州茅台	31,670	54,694,090.00	0.39
18	300782	卓胜微	450,756	51,521,410.80	0.37
19	300408	三环集团	1,603,702	49,249,688.42	0.36
20	600028	中国石化	10,963,300	47,799,988.00	0.34
21	603259	药明康德	542,826	43,968,906.00	0.32
22	002756	永兴材料	420,173	38,727,345.41	0.28
23	000860	顺鑫农业	938,294	27,979,927.08	0.20
24	002044	美年健康	4,103,237	25,152,842.81	0.18
25	000301	东方盛虹	458,900	5,984,056.00	0.04
26	000333	美的集团	10,300	533,540.00	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	002304	洋河股份	190,700,221.53	0.68
2	000858	五粮液	165,021,427.56	0.59
3	600036	招商银行	158,374,782.34	0.57
4	300059	东方财富	135,406,219.41	0.49
5	600886	国投电力	86,961,556.45	0.31
6	000001	平安银行	85,572,848.00	0.31
7	600426	华鲁恒升	77,240,177.22	0.28
8	688188	柏楚电子	77,026,257.67	0.28
9	600309	万华化学	72,586,707.19	0.26
10	601012	隆基绿能	62,873,853.24	0.23
11	600486	扬农化工	56,587,970.02	0.20
12	601398	工商银行	52,674,588.00	0.19
13	600028	中国石化	47,423,103.00	0.17
14	600519	贵州茅台	47,309,388.44	0.17
15	300408	三环集团	41,825,330.40	0.15

16	002756	永兴材料	41,381,801.45	0.15
17	002415	海康威视	34,756,029.62	0.12
18	000301	东方盛虹	8,716,107.00	0.03
19	000333	美的集团	789,905.00	0.00
20	688114	华大智造	43,590.00	0.00

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	601012	隆基绿能	542,743,251.23	1.95
2	000661	长春高新	272,565,855.75	0.98
3	600426	华鲁恒升	208,298,772.52	0.75
4	603259	药明康德	180,424,179.14	0.65
5	002415	海康威视	124,955,949.43	0.45
6	603806	福斯特	96,586,212.17	0.35
7	002250	联化科技	92,733,006.96	0.33
8	000596	古井贡酒	75,992,634.20	0.27
9	600763	通策医疗	65,401,666.84	0.23
10	600809	山西汾酒	61,966,023.36	0.22
11	603882	金域医学	54,403,460.26	0.20
12	601398	工商银行	52,214,937.78	0.19
13	600161	天坛生物	45,665,218.03	0.16
14	300782	卓胜微	35,416,866.97	0.13
15	000860	顺鑫农业	32,581,937.86	0.12
16	002044	美年健康	7,501,456.00	0.03
17	300558	贝达药业	5,616,325.00	0.02
18	600941	中国移动	58,698.00	0.00
19	688114	华大智造	47,396.53	0.00
20	600938	中国海油	40,683.00	0.00

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	1,443,416,611.54
卖出股票收入（成交）总额	1,955,374,322.97

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	8,652,580,357.33	62.40
	其中：政策性金融债	723,876,756.16	5.22
4	企业债券	1,910,290,927.09	13.78
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,474,644,307.37	25.06
7	可转债（可交换债）	1,172,403,330.43	8.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,209,918,922.22	109.70

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	2128033	21 建设银行二级 03	10,400,000	1,046,013,194.52	7.54
2	2128042	21 兴业银行二级 02	7,800,000	779,013,823.56	5.62
3	220211	22 国开 11	7,200,000	723,876,756.16	5.22
4	2128047	21 招商银行永续债	7,000,000	692,175,342.47	4.99
5	092200008	22 农行二级资本债 02A	6,600,000	646,497,123.29	4.66

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

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	193797	21 工鑫 8A	900,000	91,156,004.39	0.66
2	112561	22 和闽优	500,000	50,086,794.52	0.36
3	189847	21LJZ 优	400,000	40,286,667.84	0.29
4	193676	至博 03A1	300,000	30,229,800.00	0.22
5	193677	至博 03A2	300,000	30,170,219.18	0.22
6	135755	22 吉电优	300,000	30,008,482.19	0.22
7	193538	至博 01A1	200,000	20,148,290.41	0.15
8	136594	荟柒 4A	200,000	20,032,202.74	0.14
9	193933	和皖 A	200,000	20,016,485.19	0.14
10	112592	G 重庆优	200,000	20,012,072.33	0.14
11	136815	光汇 01 优	200,000	19,912,678.36	0.14
12	112060	二发 A	200,000	19,858,301.37	0.14
13	183194	铁建 032A	100,000	10,072,231.23	0.07
14	193731	至通 02A1	100,000	10,070,739.73	0.07
15	136685	荟享 083A	100,000	10,062,932.06	0.07
16	183208	铁建 033A	100,000	10,043,761.64	0.07
17	136539	荟柒 5A	100,000	10,021,027.40	0.07
18	136444	荟享 055A	100,000	10,009,687.67	0.07
19	136484	荟享 068A	100,000	10,009,258.08	0.07
20	136418	特建发优	100,000	10,008,689.16	0.07
21	183480	PR 铁置优	100,000	10,000,815.20	0.07
22	183916	22 保置优	100,000	9,999,259.68	0.07
23	183148	G 国电优	100,000	9,995,798.90	0.07
24	183271	联汇 1 优	100,000	9,971,138.63	0.07
25	180802	铁建 37A1	100,000	9,909,347.40	0.07
26	183086	诚通 01 优	100,000	9,719,413.65	0.07
27	183105	21 电 4A2	100,000	9,718,507.05	0.07
28	136339	荟享 067A	100,000	2,456,675.59	0.02
29	136334	荟柒 1A	100,000	2,155,828.01	0.02

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

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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，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中国银行保险监督管理委员会的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局、中国人民银行的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。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外汇管理局上海市分局、上海市市场监督管理局、中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。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中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	824,730.18
2	应收清算款	91,277,770.74
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,751,035.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	93,853,536.18

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	占基金资产净值比例（%）
1	110053	苏银转债	127,255,348.48	0.92
2	132018	G 三峡 EB1	123,705,584.02	0.89
3	113011	光大转债	104,672,953.51	0.75
4	110059	浦发转债	103,788,597.91	0.75
5	110073	国投转债	69,780,269.02	0.50
6	113057	中银转债	66,006,907.68	0.48
7	113050	南银转债	47,569,939.74	0.34
8	113044	大秦转债	44,980,147.75	0.32
9	113052	兴业转债	41,870,147.10	0.30
10	127049	希望转 2	40,647,421.93	0.29
11	128129	青农转债	36,694,589.40	0.26
12	113013	国君转债	29,901,770.74	0.22
13	110063	鹰 19 转债	28,047,648.33	0.20
14	123107	温氏转债	27,889,752.11	0.20
15	110083	苏租转债	24,989,661.92	0.18
16	110079	杭银转债	24,570,115.83	0.18
17	127040	国泰转债	20,652,680.10	0.15
18	113043	财通转债	15,439,036.51	0.11
19	128130	景兴转债	13,690,324.21	0.10
20	113058	友发转债	12,818,730.70	0.09
21	113037	紫银转债	12,604,026.60	0.09
22	127058	科伦转债	10,365,788.87	0.07
23	127005	长证转债	9,478,012.24	0.07
24	127045	牧原转债	8,892,645.17	0.06
25	128119	龙大转债	8,831,593.14	0.06
26	127027	靖远转债	8,381,337.25	0.06
27	110077	洪城转债	8,035,031.28	0.06
28	127050	麒麟转债	7,974,876.80	0.06
29	123133	佩蒂转债	7,627,630.45	0.06
30	128034	江银转债	6,281,198.47	0.05
31	128128	齐翔转 2	6,196,179.21	0.04
32	128081	海亮转债	4,760,171.88	0.03
33	110061	川投转债	4,187,780.77	0.03
34	127018	本钢转债	4,111,797.19	0.03
35	113042	上银转债	3,435,531.87	0.02
36	110085	通 22 转债	3,126,257.40	0.02

37	127012	招路转债	2,788,793.18	0.02
38	110067	华安转债	2,495,832.85	0.02
39	127061	美锦转债	2,108,042.96	0.02
40	113025	明泰转债	1,592,409.07	0.01

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
易方达丰和债券 A	245,208	43,104.43	3,722,111,060.59	35.22%	6,847,439,220.35	64.78%
易方达丰和债券 C	42	1,100,842.34	46,046,656.74	99.59%	188,721.55	0.41%
合计	245,250	43,285.57	3,768,157,717.33	35.50%	6,847,627,941.90	64.50%

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	易方达丰和债券 A	3,422,877.97	0.0324%
	易方达丰和债券 C	7,637.67	0.0165%
	合计	3,430,515.64	0.0323%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达丰和债券 A	50~100
	易方达丰和债券 C	0
	合计	50~100

本基金基金经理持有本开放式基金	易方达丰和债券 A	0
	易方达丰和债券 C	0
	合计	0

§10开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达丰和债券 A	易方达丰和债券 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 23 日）基金份额总额	4,225,241,305.74	-
本报告期期初基金份额总额	20,474,869,034.41	-
本报告期基金总申购份额	3,466,006,142.68	46,247,512.15
减：本报告期基金总赎回份额	13,371,324,896.15	12,133.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,569,550,280.94	46,235,378.29

注：本基金 A 类基金份额由原基金份额变更而来，并于 2022 年 9 月 28 日起增设 C 类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§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 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

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。

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

本基金自基金合同生效以来连续 6 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 111,100.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	292,295,194.87	8.61%	175,377.12	7.43%	-
东方财富	1	431,754,314.99	12.72%	259,054.32	10.98%	-
东方证券	2	373,081,045.28	10.99%	223,851.07	9.48%	-
东吴证券	1	134,982,187.90	3.98%	107,985.63	4.58%	-
广发证券	1	118,508.94	0.00%	71.12	0.00%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	150,125,571.85	4.42%	120,100.54	5.09%	-
国泰君安	1	478,050,119.18	14.09%	382,440.10	16.20%	-
华福证券	1	30,207,828.48	0.89%	24,166.26	1.02%	-
摩根大通	1	256,940,759.40	7.57%	154,165.58	6.53%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	420,053,387.48	12.38%	252,032.05	10.68%	-
中泰证券	1	826,327,483.42	24.35%	661,061.99	28.01%	-

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信达证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司。

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。基金交易单

元的选择标准如下：

1） 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2） 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3） 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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	728,140,023.46	12.20%	70,501,600,000.00	14.75%	-	-
东方财富	244,537,396.74	4.10%	20,480,279,000.00	4.29%	-	-
东方证券	550,777,428.97	9.23%	17,189,000,000.00	3.60%	-	-
东吴证券	399,519,518.19	6.69%	8,004,112,000.00	1.67%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	77,598,057.46	1.30%	4,887,487,000.00	1.02%	-	-
国泰君安	1,198,571,374.08	20.08%	86,547,056,000.00	18.11%	-	-
华福证券	1,749,588.65	0.03%	6,055,000,000.00	1.27%	-	-
摩根大通	403,164,089.63	6.75%	30,832,310,000.00	6.45%	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	663,618,588.17	11.12%	43,688,300,000.00	9.14%	-	-
中泰证券	1,702,532,437.56	28.52%	189,733,300,000.00	39.70%	-	-

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关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-01-21
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证券报	2022-03-30
5	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
6	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购中国海洋石油有限公司首次公开发行股票的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-16
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-04-22
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
10	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-14
11	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-07-07
12	易方达基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-07-08
13	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-07-20

14	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证券报	2022-08-30
15	易方达丰和债券型证券投资基金之 C 类份额开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-26
16	易方达基金管理有限公司关于易方达丰和债券型证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同、托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-26
17	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-10-26

§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丰和债券型证券投资基金注册的文件；

2.《易方达丰和债券型证券投资基金基金合同》；

3.《易方达丰和债券型证券投资基金托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

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

二〇二三年三月三十日