

易方达丰华债券型证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

§ 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达丰华债券
基金主代码	000189
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 2 月 19 日
报告期末基金份额总额	2,275,194,329.70 份
投资目标	本基金在控制风险的前提下，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；本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。3、本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。4、本基金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×10%+中债总指数收益率×90%	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	易方达丰华债券 A	易方达丰华债券 C
下属分级基金的交易代码	000189	006867
报告期末下属分级基金的份额总额	2,007,126,795.86 份	268,067,533.84 份

注：自 2019 年 2 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 2 月 20 日。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期	
	(2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)	
	易方达丰华债券 A	易方达丰华债券 C
1.本期已实现收益	-18,819,609.72	-2,810,965.85
2.本期利润	34,407,432.90	2,588,667.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0156	0.0068
4.期末基金资产净值	2,592,021,851.99	339,013,279.55
5.期末基金份额净值	1.2914	1.2647

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达丰华债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.65%	0.32%	1.98%	0.15%	-0.33%	0.17%
过去六个月	2.25%	0.28%	2.68%	0.12%	-0.43%	0.16%
过去一年	2.97%	0.28%	4.21%	0.11%	-1.24%	0.17%
过去三年	1.11%	0.29%	3.29%	0.12%	-2.18%	0.17%
过去五年	33.92%	0.39%	8.35%	0.13%	25.57%	0.26%
自基金合同生效起至今	39.77%	0.38%	9.57%	0.13%	30.20%	0.25%

易方达丰华债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	1.55%	0.32%	1.98%	0.15%	-0.43%	0.17%
过去六个月	2.05%	0.28%	2.68%	0.12%	-0.63%	0.16%
过去一年	2.55%	0.28%	4.21%	0.11%	-1.66%	0.17%
过去三年	-0.10%	0.29%	3.29%	0.12%	-3.39%	0.17%
过去五年	31.28%	0.39%	8.35%	0.13%	22.93%	0.26%
自基金合同生效起至今	36.66%	0.37%	9.60%	0.13%	27.06%	0.24%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达丰华债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

易方达丰华债券 A

(2019 年 2 月 19 日至 2024 年 9 月 30 日)



易方达丰华债券 C

(2019 年 2 月 20 日至 2024 年 9 月 30 日)



注：1.本基金由原易方达保本一号混合型证券投资基金于2019年2月19日转型而来。

2.自2019年2月19日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2019年2月20日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.自基金转型至报告期末，A类基金份额净值增长率为39.77%，同期业绩比较基准收益率为9.57%；C类基金份额净值增长率为36.66%，同期业绩比较基准收益率为9.60%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王成	本基金的基金经理，易方达悦享一年持有混合、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦信一年持有	2019-11-28	-	16年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任安信证券股份有限公司交易员、投资经理，易方达基金管理有限公司年金投资部总经理助理。

	混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理，易方达安心回馈混合、易方达悦稳一年持有混合的基金经理助理，多资产专户投资部总经理、多资产养老金投资部副总经理				
李中阳	本基金的基金经理，易方达悦稳一年持有混合、易方达安心回馈混合的基金经理，易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理助理，多资产研究部总经理助理	2021-07-08	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中信证券股份有限公司研究部研究员，易方达基金管理有限公司研究员，易方达磐固六个月持有混合的基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 28 次，其中 26 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，2 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

由于房地产产业链和居民消费持续表现不佳，基建投资也有所走弱，三季度经济重新出现下行压力，未来走势取决于潜在稳增长政策出台的情况。海外方面，全球经济保持平稳，我国工业部门出口交货值处于改善当中，出口表现较好，对经济有较好拉动作用。新房销售量继续下滑，地产企业拿地意愿较低，房屋交易价格继续下行，地产整体依然处于寻底过程中，带动地产产业链继续下滑，是拖累经济的主要原因。在“以旧换新”政策带动下，家电等消费品表现较好，但居民部门收入预期较差，消费意愿低，多数耐用品继续回落，社会消费品零售总额环比低于季节性波动。被普遍看好的基建投资，由于资金来源压力较大，也在 8 月份出现增速回落。整体经济下行压力较大的情况下，新一轮稳增长政策也在逐步出台，需要关注政策效果和持续性。政策方面，央行连续降准降息，且预告四季度可能继续降准，预计未来将保持较为宽松的货币政策。

基本面的走弱推动债券收益率整体震荡下行，直到 9 月底政策预期出现变化。从二季度末到 9 月 23 日，代表性品种 10 年国债收益率从 2.21% 下行至 2.04%；3 年、5 年国债，由于银行买入较多，收益率分别下行了 30bp 和 25bp；30 年国债也受到保险等机构的青睐，收益率下行了 29bp，达到 2.14% 的历史低位。在国债下行过程中，信用债由于绝对收益较低，利差被动扩大。9 月 24 日金融监管总局、央行和证监会联合发布会后，市场风险偏好发生重大变化，债券收益率快速上行，截至三季度末 10 年

国债收益率上行至 2.15%，30 年国债收益率上行至 2.36%；国开债和信用债收益率也都出现了较大幅度上行。全季来看，国债、金融债的收益率整体下行，10 年国债收益率下行 5bp，30 年国债收益率下行 7bp；而信用债收益率出现了显著上行，3 年 AAA 等级中票收益率上行 19bp，5 年 AAA 等级中票收益率上行 14bp，信用利差显著扩大。

权益市场三季度可以用“见证历史”来描述，前期一直延续成交低迷、普跌的状态，在季度末随着悲观预期大幅扭转，市场快速放量修复，截至 9 月 30 日，沪深 300 指数全年涨幅达到 17.1%。

可转债市场跟随股票市场走势，先跌后涨，全季中证转债指数小幅上涨 0.58%。从季初到 9 月 23 日，可转债市场均是震荡下跌，各类型转债呈现普跌格局，其中由于对信用风险的担忧，偏债品种出现了大幅回调。季末最后 5 个工作日，风险偏好大幅修复，可转债市场大幅反弹，收复季度跌幅。

债券方面，组合在三季度继续保持偏高杠杆操作，以中短期限信用债作为底仓，并对内部信用债品种做了置换，适当降低了久期。同时，组合灵活操作 10 年及以上的中长期国债，调节久期。组合在三季度一直保持久期超配，并根据市场节奏和基本面情况，调节超配水平，获取了一定的超额收益。9 月底债券市场出现调整后，组合适当降低了久期，依然保持超配，以应对不确定性；但没想到风险偏好变化如此剧烈，债市调整幅度超出预期，偏高的久期使得组合收益出现了一定的回撤。

权益方面，组合三季度仓位略有提高，但整体保持中性。结构层面，仍集中在两个方向去寻找投资机会：（1）国内具有一定韧性的结构性需求，如汽车、家电行业，并适当增加内需配置；（2）具有海外扩张能力的制造业龙头，看好其份额持续提升。

转债方面，转债市场出现超预期下跌，为控制对组合净值影响，组合适当降低了持仓比例，重点持有高质量偏债品种和平衡低估品种，降低弹性。转债市场上涨后，组合在右侧做了小幅加仓，但市场反弹较快，组合未能快速提高仓位到超配，错失了部分收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.2914 元，本报告期份额净值增长率为 1.65%，同期业绩比较基准收益率为 1.98%；C 类基金份额净值为 1.2647 元，本报告期份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.98%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	479,969,138.48	12.31
	其中：股票	479,969,138.48	12.31
2	固定收益投资	3,403,713,663.44	87.33
	其中：债券	3,204,808,352.24	82.23
	资产支持证券	198,905,311.20	5.10
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	12,112,762.32	0.31
7	其他资产	1,770,270.79	0.05
8	合计	3,897,565,835.03	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	26,036,353.90	0.89
C	制造业	427,560,928.58	14.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	-	-

	业		
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	26,371,856.00	0.90
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	479,969,138.48	16.38

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	601702	华峰铝业	3,422,368	64,614,307.84	2.20
2	601799	星宇股份	379,612	56,057,304.04	1.91
3	600690	海尔智家	1,068,700	34,358,705.00	1.17
4	603129	春风动力	167,800	27,499,064.00	0.94
5	000708	中信特钢	1,818,700	24,807,068.00	0.85
6	601058	赛轮轮胎	1,442,600	23,139,304.00	0.79
7	600031	三一重工	1,172,000	22,127,360.00	0.75
8	603596	伯特利	424,600	20,771,432.00	0.71
9	688036	传音控股	182,150	19,659,449.50	0.67
10	601899	紫金矿业	1,064,685	19,313,385.90	0.66

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产
----	------	---------	-------

			净值比例(%)
1	国家债券	602,232,059.56	20.55
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,179,677,885.54	40.25
	其中：政策性金融债	156,984,664.66	5.36
4	企业债券	166,900,015.90	5.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	926,100,244.14	31.60
7	可转债（可交换债）	329,898,147.10	11.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,204,808,352.24	109.34

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	240011	24 付息国债 11	3,100,000	315,628,774.46	10.77
2	2121062	21 北京农商二级	2,600,000	273,935,488.52	9.35
3	2420018	24 北京银行 03	1,500,000	151,509,041.10	5.17
4	240411	24 农发 11	1,100,000	110,729,767.12	3.78
5	102381689	23 陕西交通 MTN001	1,000,000	102,221,369.86	3.49

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	260418	G 黄河优	500,000	50,942,334.00	1.74
2	135242	22 萧万 A	500,000	50,307,802.74	1.72
3	112887	G 中交泰 A	400,000	37,500,798.58	1.28
4	180297	燕山湖 A	200,000	20,229,122.29	0.69
5	193398	PR 产 3A	200,000	19,395,223.59	0.66
6	183144	21 水八 04	100,000	10,501,804.93	0.36

7	136708	21 重万优	100,000	10,028,225.07	0.34
---	--------	--------	---------	---------------	------

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京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北京监管局的处罚。陕西交通控股集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到陕西省高速公路路政执法总队、西安市自然资源和规划局、西安市自然资源和规划局长安分局的处罚。中交第四航务工程局有限公司在报告编制日前一年内曾受到苍南县交通运输局、肇庆市城市管理和综合执法局高新区分局、舟山市港航和口岸管理局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	155,838.23
2	应收证券清算款	498,576.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,115,855.65
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	1,770,270.79
---	----	--------------

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113021	中信转债	20,700,183.75	0.71
2	113641	华友转债	19,465,688.32	0.66
3	110087	天业转债	15,581,765.78	0.53
4	118022	锂科转债	12,877,451.54	0.44
5	118031	天 23 转债	12,485,662.07	0.43
6	118034	晶能转债	12,342,193.78	0.42
7	127040	国泰转债	11,762,969.93	0.40
8	127045	牧原转债	11,478,147.64	0.39
9	123107	温氏转债	9,442,964.95	0.32
10	127030	盛虹转债	9,365,166.37	0.32
11	110085	通 22 转债	8,897,299.20	0.30
12	127067	恒逸转 2	8,675,317.06	0.30
13	118009	华锐转债	8,205,927.15	0.28
14	127042	嘉美转债	8,193,126.60	0.28
15	113657	再 22 转债	8,150,114.79	0.28
16	113648	巨星转债	8,056,440.19	0.27
17	123179	立高转债	7,627,940.20	0.26
18	110093	神马转债	7,430,651.25	0.25
19	127022	恒逸转债	7,298,408.51	0.25
20	127018	本钢转债	6,170,665.75	0.21
21	127026	超声转债	6,110,278.03	0.21
22	113043	财通转债	5,863,828.77	0.20
23	118042	奥维转债	5,776,342.87	0.20
24	113059	福莱转债	5,118,223.60	0.17
25	111009	盛泰转债	4,694,808.69	0.16
26	118043	福立转债	4,336,561.31	0.15
27	111007	永和转债	3,956,493.57	0.13
28	127035	濮耐转债	3,597,220.23	0.12
29	123190	道氏转 02	3,550,964.83	0.12
30	123178	花园转债	3,218,217.66	0.11
31	113661	福 22 转债	3,124,463.83	0.11
32	132026	G 三峡 EB2	3,051,390.79	0.10
33	123104	卫宁转债	2,921,799.18	0.10
34	113058	友发转债	2,908,280.56	0.10
35	110081	闻泰转债	2,841,410.96	0.10
36	113623	凤 21 转债	2,581,410.22	0.09
37	113051	节能转债	2,548,655.49	0.09

38	123168	惠云转债	2,506,589.06	0.09
39	113644	艾迪转债	2,497,941.41	0.09
40	123161	强联转债	2,469,095.34	0.08
41	123211	阳谷转债	2,440,868.61	0.08
42	128129	青农转债	2,373,202.52	0.08
43	123203	明电转 02	2,284,175.34	0.08
44	123182	广联转债	2,148,853.56	0.07
45	127073	天赐转债	2,080,743.79	0.07
46	113046	金田转债	1,997,886.30	0.07
47	123108	乐普转 2	1,974,762.80	0.07
48	123172	漱玉转债	1,823,720.55	0.06
49	123174	精锻转债	1,742,579.78	0.06
50	127091	科数转债	1,711,437.88	0.06
51	127061	美锦转债	1,489,478.50	0.05
52	113037	紫银转债	1,486,680.78	0.05
53	123216	科顺转债	1,434,361.22	0.05
54	113068	金铜转债	1,405,260.82	0.05
55	123208	孩王转债	1,250,573.30	0.04
56	123219	宇瞳转债	1,133,124.99	0.04
57	123124	晶瑞转 2	1,088,773.25	0.04
58	113047	旗滨转债	931,951.34	0.03
59	127086	恒邦转债	865,984.12	0.03
60	113065	齐鲁转债	624,381.74	0.02
61	113677	华懋转债	429,324.97	0.01
62	113674	华设转债	380,673.21	0.01
63	128135	洽洽转债	288,385.34	0.01
64	113049	长汽转债	236,897.09	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达丰华债券A	易方达丰华债券C
报告期期初基金份额总额	2,402,055,011.06	598,548,181.70
报告期期间基金总申购份额	17,364,936.93	2,622,616.32
减：报告期期间基金总赎回份额	412,293,152.13	333,103,264.18
报告期期间基金拆分变动份额（份）	-	-

额减少以“-”填列)		
报告期期末基金份额总额	2,007,126,795.86	268,067,533.84

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2024年08月29日~2024年09月30日	470,095,226.05	0.00	0.00	470,095,226.05	20.66%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；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。</p>							

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达保本一号混合型证券投资基金变更注册为易方达丰华债券型证券投资基金的文件；

2.易方达保本一号混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告；

- 3.《易方达丰华债券型证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达丰华债券型证券投资基金托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2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。

9.3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
二〇二四年十月二十五日