

# 易方达安心回馈混合型证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年四月二十日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 4 月 18 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 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 易方达安心回馈混合   |
| 基金主代码      | 001182  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2015 年 5 月 29 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 952,964,251.23 份  |
| 投资目标       | 本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略       | 1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。<br>2、本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础 |

|                 |   |              |
|-----------------|---|--------------|
|                 | 上,判断利差空间,通过杠杆操作放大组合收益。3、本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略,精选优质企业进行投资。同时,本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。 |              |
| 业绩比较基准          | 沪深 300 指数收益率×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%  |              |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。  |              |
| 基金管理人           | 易方达基金管理有限公司   |              |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司  |              |
| 下属分级基金的基金简称     | 易方达安心回馈混合 A   | 易方达安心回馈混合 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 001182  | 016594       |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 952,463,764.94 份  | 500,486.29 份 |

注:自 2022 年 9 月 13 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 14 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<br>(2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日) |           |
|        | 易方达安心回馈混合                               | 易方达安心回馈混合 |

|                | A                | C            |
|----------------|------------------|--------------|
| 1.本期已实现收益      | -19,636,796.31   | -11,811.69   |
| 2.本期利润         | 27,051,274.27    | 9,976.04     |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0276           | 0.0197       |
| 4.期末基金资产净值     | 2,186,702,165.12 | 1,141,868.49 |
| 5.期末基金份额净值     | 2.296            | 2.282        |

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

##### 易方达安心回馈混合 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      | 1.37%   | 0.47%     | 2.23%      | 0.25%         | -0.86%  | 0.22% |
| 过去六个月      | -0.69%  | 0.42%     | 1.41%      | 0.23%         | -2.10%  | 0.19% |
| 过去一年       | -0.82%  | 0.40%     | 0.80%      | 0.22%         | -1.62%  | 0.18% |
| 过去三年       | -2.01%  | 0.49%     | 1.72%      | 0.26%         | -3.73%  | 0.23% |
| 过去五年       | 55.66%  | 0.59%     | 15.30%     | 0.29%         | 40.36%  | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 129.60% | 0.55%     | 24.90%     | 0.34%         | 104.70% | 0.21% |

##### 易方达安心回馈混合 C

| 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 | 1.29%  | 0.47%     | 2.23%      | 0.25%         | -0.94% | 0.22% |

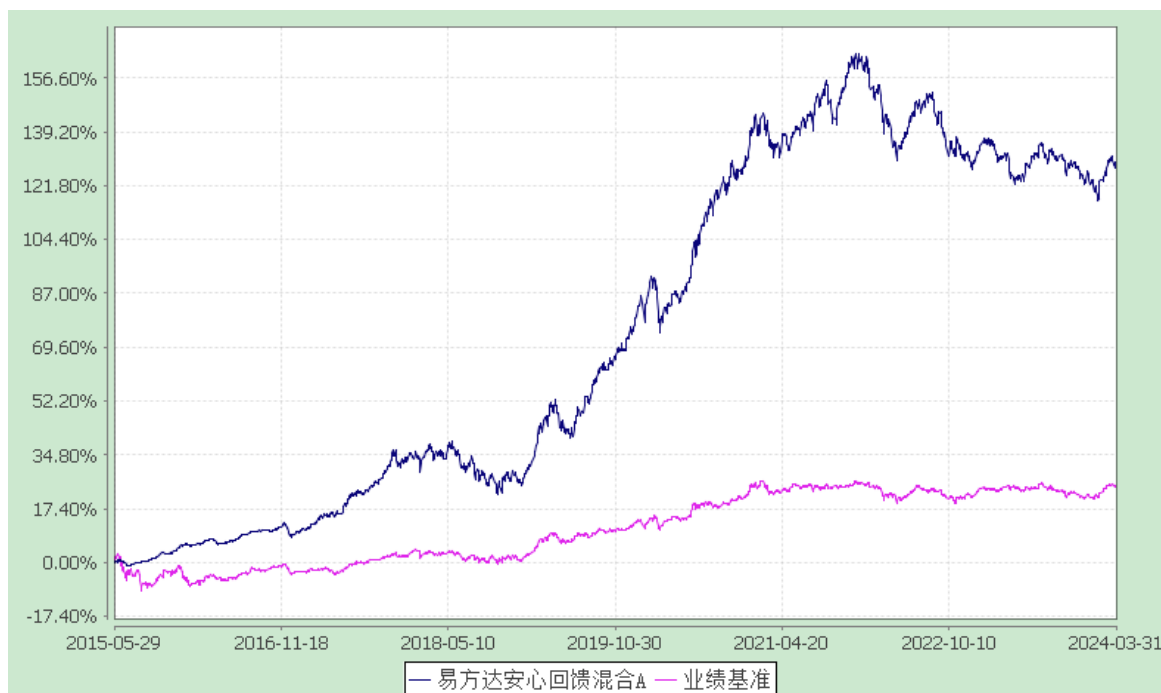
|            |        |       |       |       |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 月          |        |       |       |       |        |       |
| 过去六个月      | -0.87% | 0.42% | 1.41% | 0.23% | -2.28% | 0.19% |
| 过去一年       | -1.17% | 0.40% | 0.80% | 0.22% | -1.97% | 0.18% |
| 过去三年       | -      | -     | -     | -     | -      | -     |
| 过去五年       | -      | -     | -     | -     | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | -7.08% | 0.42% | 1.11% | 0.24% | -8.19% | 0.18% |

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

易方达安心回馈混合型证券投资基金  
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

易方达安心回馈混合 A

(2015 年 5 月 29 日至 2024 年 3 月 31 日)



易方达安心回馈混合 C

(2022 年 9 月 14 日至 2024 年 3 月 31 日)



注：1.自 2022 年 9 月 13 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 14 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 129.60%，同期业绩比较基准收益率为 24.90%；C 类基金份额净值增长率为-7.08%，同期业绩比较基准收益率为 1.11%。

## § 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 |        |   |
| 李中阳 | 本基金的基金经理，易方达丰华债券、易方达悦稳一年持有混合的基金经理，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 | 2022-04-30  | -    | 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。 |

|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | 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 |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|

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 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 10 次，其中 8 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

2024 年一季度的经济增长好于 2023 年四季度，主要带动力量是出口对应的外需和财政发力带动的基建，房地产产业链依旧对经济形成拖累。全球外需整体好转，叠

加国内成本优势显著，1-2 月份出口表现较好，环比企稳。基建投资韧性较强，3 月份之后，财政资金投放加快，基建投资逐步回升，财政政策效果开始显现。房地产产业链表现不佳，新房销售面积继续同比负增长，房价继续调整，尚未看到企稳迹象。由于 3 月份 PMI（采购经理指数）数据较好，预计未来经济将企稳回升，但弹性偏弱。价格数据表现偏弱，受春节影响，CPI（消费者物价指数）季节性回升，持续性预计不强；PPI（生产者价格指数）依然同比负增长，预计低通胀环境仍将持续。

虽然实际经济表现尚可，但低通胀环境对债券市场形成支撑；由于一季度是传统的债券配置旺季，叠加利率债供给较少，供需错配下债券走出了一轮牛市，收益率曲线平坦化下行。从年初到 3 月初，在配置力量驱动下，债券收益率单边下行，10 年期国债收益率下行 29bp 到 2.27%，10 年期国开债收益率下行 32bp 到 2.36%，30 年期国债收益率下行 40bp 到 2.43%，超长债表现较好。信用债跟随利率债收益率下行，信用利差略有压缩。3 月上旬，特别国债供给增加对债市形成扰动，10 年期和 30 年期国债收益率有约 10bp 的回调，后回落约 5-7bp 到历史低位。全季来看，10 年期国债收益率下行 27bp 到 2.29%，30 年期国债收益率下行 37bp 到 2.46%。1 年期 AAA 等级同业存单收益率下行 17bp 到 2.23%，3 年期 AAA 等级中票收益率下行 21bp 到 2.50%。品种利差也有所压缩，3 年期 AAA 等级商业银行二级资本债收益率下行 33bp，3 年期 AAA 等级永续债收益率下行 31bp，5 年表现更优，分别下行 38bp 和 41bp。

权益市场在一季度先抑后扬，年初延续 2023 年的下跌趋势，2 月份随着一系列强有力的组合拳，市场信心得到扭转而快速修复。大小盘走势显著分化，与 2023 年走势相反，沪深 300 在一季度收获正收益，微盘股为代表的小盘则回撤较大。

可转债市场跟随权益市场波动，中证转债指数呈“V 型”走势，全季小幅下跌 0.24%。从年初到 2 月 5 日，转债震荡下跌，平衡型和偏股型表现较差，尤其是中小盘转债跌幅较大，债性转债相对抗跌。2 月 6 日后，可转债跟随权益市场反弹 4.52%，收复前期跌幅，但小盘平衡型转债表现落后于指数，平衡型策略表现不佳。

权益方面，一季度市场初期延续下跌趋势，但是我们仍保持一定的乐观，中游制造业表现出较强的韧性，结合全球竞争力提升，持续带动结构性需求。因此在整个一季度，组合仍保持较高的权益仓位，结构性沿着两个方向去寻找投资机会：1.国内需求的核心抓手，如汽车、家电等中游制造业；2.具有海外扩张能力的制造业龙头，依靠扩张份额换取较好的业绩增长。



债券方面，组合年初判断久期策略是今年的主要投资策略，在继续保持偏高杠杆水平和中短久期信用债底仓的基础上，重点操作中长期利率债，提高了久期操作的灵活性。基于对债市的看好，组合在年初增持利率债，将久期逐步提高到 3.7 年左右；3 月初做了止盈，久期调回低配，后在市场下跌中将久期提高到 3.1 年左右。临近季末，考虑到经济基本面有修复，资金面可能有扰动，供给也将逐步增加，组合将久期降低到低配，等待下一次波段操作机会。

转债方面，组合仓位变化不大，主要做了结构置换；在底部增持了大盘偏债转债，适当降低了小盘平衡型转债的配置，并对即将到期或赎回的转债做了减持。

#### 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 2.296 元，本报告期份额净值增长率为 1.37%，同期业绩比较基准收益率为 2.23%；C 类基金份额净值为 2.282 元，本报告期份额净值增长率为 1.29%，同期业绩比较基准收益率为 2.23%。

#### 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     | 712,159,465.99   | 26.08        |
|    | 其中：股票    | 712,159,465.99   | 26.08        |
| 2  | 固定收益投资   | 1,990,018,859.26 | 72.87        |
|    | 其中：债券    | 1,859,690,987.53 | 68.09        |
|    | 资产支持证券   | 130,327,871.73   | 4.77         |
| 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      | 15,611,641.47    | 0.57   |
| 7 | 其他资产              | 13,248,781.34    | 0.49   |
| 8 | 合计                | 2,731,038,748.06 | 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              | 5,165,412.48   | 0.24         |
| C  | 制造业              | 677,289,385.95 | 30.96        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 11,246,877.00  | 0.51         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 11,556.45      | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 125,387.92     | 0.01         |
| J  | 金融业              | 18,286,135.00  | 0.84         |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,097.60       | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 15,750.21      | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 15,863.38      | 0.00         |
| 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               | 712,159,465.99 | 32.55        |

### 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<br>净值比例<br>（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|----------------------|
| 1  | 601799 | 星宇股份 | 719,223   | 100,734,373.38 | 4.60                 |
| 2  | 601702 | 华峰铝业 | 4,026,632 | 75,539,616.32  | 3.45                 |
| 3  | 600933 | 爱柯迪  | 2,863,370 | 55,348,942.10  | 2.53                 |
| 4  | 002648 | 卫星化学 | 2,375,832 | 43,952,892.00  | 2.01                 |
| 5  | 000708 | 中信特钢 | 2,272,228 | 34,310,642.80  | 1.57                 |
| 6  | 300750 | 宁德时代 | 144,240   | 27,428,678.40  | 1.25                 |
| 7  | 600486 | 扬农化工 | 534,266   | 27,386,475.16  | 1.25                 |
| 8  | 688169 | 石头科技 | 69,467    | 23,797,310.19  | 1.09                 |
| 9  | 600519 | 贵州茅台 | 13,600    | 23,159,440.00  | 1.06                 |
| 10 | 600690 | 海尔智家 | 849,600   | 21,197,520.00  | 0.97                 |

## 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<br>净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|------------------|
| 1  | 国家债券      | 116,233,288.50   | 5.31             |
| 2  | 央行票据      | -                | -                |
| 3  | 金融债券      | 855,860,436.94   | 39.12            |
|    | 其中：政策性金融债 | 116,792,434.42   | 5.34             |
| 4  | 企业债券      | 162,950,318.38   | 7.45             |
| 5  | 企业短期融资券   | 10,541,661.20    | 0.48             |
| 6  | 中期票据      | 495,368,007.24   | 22.64            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 218,737,275.27   | 10.00            |
| 8  | 同业存单      | -                | -                |
| 9  | 其他        | -                | -                |
| 10 | 合计        | 1,859,690,987.53 | 85.00            |

## 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<br>资产净<br>值比例 |
|----|------|------|-------|---------|-------------------|
|----|------|------|-------|---------|-------------------|

|   |         |              |           |                | (%)  |
|---|---------|--------------|-----------|----------------|------|
| 1 | 2128042 | 21 兴业银行二级 02 | 2,000,000 | 208,005,617.49 | 9.51 |
| 2 | 2128030 | 21 交通银行二级    | 1,000,000 | 104,621,912.57 | 4.78 |
| 3 | 240004  | 24 附息国债 04   | 950,000   | 95,695,796.70  | 4.37 |
| 4 | 2228017 | 22 邮储银行二级 01 | 900,000   | 92,777,592.33  | 4.24 |
| 5 | 200203  | 20 国开 03     | 600,000   | 61,076,196.72  | 2.79 |

#### 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<br>值比例 (%) |
|----|--------|---------|---------|---------------|-------------------|
| 1  | 135242 | 22 萧万 A | 400,000 | 40,232,227.94 | 1.84              |
| 2  | 180297 | 燕山湖 A   | 300,000 | 30,800,862.49 | 1.41              |
| 3  | 156659 | PR 产 1A | 110,000 | 10,967,107.05 | 0.50              |
| 4  | 260418 | G 黄河优   | 100,000 | 10,259,453.70 | 0.47              |
| 5  | 112887 | G 中交泰 A | 100,000 | 9,997,333.83  | 0.46              |
| 6  | 193398 | PR 产 3A | 100,000 | 9,830,215.73  | 0.45              |
| 7  | 136324 | 21 大悦 A | 100,000 | 9,797,211.27  | 0.45              |
| 8  | 180802 | 铁建 37A1 | 100,000 | 8,443,459.72  | 0.39              |

#### 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，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的处罚。中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 149,969.15    |
| 2  | 应收证券清算款 | 12,423,092.21 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 675,719.98    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 13,248,781.34 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值(元)       | 占基金资产<br>净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------------|------------------|
| 1  | 113056 | 重银转债     | 16,411,694.63 | 0.75             |
| 2  | 110072 | 广汇转债     | 15,940,073.21 | 0.73             |
| 3  | 113542 | 好客转债     | 12,055,869.63 | 0.55             |
| 4  | 113021 | 中信转债     | 8,430,134.65  | 0.39             |
| 5  | 127067 | 恒逸转 2    | 7,998,761.13  | 0.37             |
| 6  | 113050 | 南银转债     | 6,228,183.51  | 0.28             |
| 7  | 132026 | G 三峡 EB2 | 5,900,549.71  | 0.27             |
| 8  | 113065 | 齐鲁转债     | 5,727,169.17  | 0.26             |
| 9  | 123178 | 花园转债     | 4,885,751.57  | 0.22             |
| 10 | 127061 | 美锦转债     | 4,817,453.81  | 0.22             |
| 11 | 113047 | 旗滨转债     | 4,630,825.76  | 0.21             |
| 12 | 110093 | 神马转债     | 4,349,300.77  | 0.20             |
| 13 | 127022 | 恒逸转债     | 4,275,256.39  | 0.20             |
| 14 | 113033 | 利群转债     | 4,234,400.00  | 0.19             |
| 15 | 123145 | 药石转债     | 3,563,421.97  | 0.16             |
| 16 | 113632 | 鹤 21 转债  | 3,511,669.09  | 0.16             |
| 17 | 128108 | 蓝帆转债     | 3,395,202.98  | 0.16             |
| 18 | 127018 | 本钢转债     | 3,363,900.87  | 0.15             |
| 19 | 113060 | 浙 22 转债  | 3,279,201.55  | 0.15             |
| 20 | 123107 | 温氏转债     | 3,178,522.87  | 0.15             |
| 21 | 110095 | 双良转债     | 3,149,274.89  | 0.14             |

|    |        |         |              |      |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 22 | 113616 | 韦尔转债    | 2,938,067.64 | 0.13 |
| 23 | 113049 | 长汽转债    | 2,871,712.37 | 0.13 |
| 24 | 123190 | 道氏转 02  | 2,831,615.21 | 0.13 |
| 25 | 110094 | 众和转债    | 2,811,838.84 | 0.13 |
| 26 | 127046 | 百润转债    | 2,785,194.85 | 0.13 |
| 27 | 110087 | 天业转债    | 2,764,033.13 | 0.13 |
| 28 | 113037 | 紫银转债    | 2,739,986.62 | 0.13 |
| 29 | 127049 | 希望转 2   | 2,737,390.21 | 0.13 |
| 30 | 123117 | 健帆转债    | 2,531,290.03 | 0.12 |
| 31 | 128135 | 洽洽转债    | 2,517,496.06 | 0.12 |
| 32 | 123211 | 阳谷转债    | 2,509,180.81 | 0.11 |
| 33 | 113641 | 华友转债    | 2,488,965.76 | 0.11 |
| 34 | 113058 | 友发转债    | 2,389,546.87 | 0.11 |
| 35 | 123104 | 卫宁转债    | 2,270,652.05 | 0.10 |
| 36 | 113677 | 华懋转债    | 2,265,918.33 | 0.10 |
| 37 | 113661 | 福 22 转债 | 2,194,541.27 | 0.10 |
| 38 | 118031 | 天 23 转债 | 2,185,952.55 | 0.10 |
| 39 | 123161 | 强联转债    | 2,149,040.29 | 0.10 |
| 40 | 123108 | 乐普转 2   | 2,115,650.65 | 0.10 |
| 41 | 127084 | 柳工转 2   | 2,073,869.52 | 0.09 |
| 42 | 118022 | 锂科转债    | 1,993,970.98 | 0.09 |
| 43 | 113066 | 平煤转债    | 1,951,845.53 | 0.09 |
| 44 | 123216 | 科顺转债    | 1,940,562.65 | 0.09 |
| 45 | 127016 | 鲁泰转债    | 1,780,893.92 | 0.08 |
| 46 | 118009 | 华锐转债    | 1,666,952.77 | 0.08 |
| 47 | 123208 | 孩王转债    | 1,580,274.50 | 0.07 |
| 48 | 113623 | 凤 21 转债 | 1,358,444.31 | 0.06 |
| 49 | 123114 | 三角转债    | 1,298,458.66 | 0.06 |
| 50 | 127050 | 麒麟转债    | 1,292,922.40 | 0.06 |
| 51 | 113648 | 巨星转债    | 1,189,379.17 | 0.05 |
| 52 | 127091 | 科数转债    | 1,174,126.10 | 0.05 |
| 53 | 113674 | 华设转债    | 1,143,066.19 | 0.05 |
| 54 | 110073 | 国投转债    | 1,099,107.62 | 0.05 |
| 55 | 123194 | 百洋转债    | 1,097,029.22 | 0.05 |
| 56 | 110047 | 山鹰转债    | 1,079,113.70 | 0.05 |
| 57 | 123174 | 精锻转债    | 1,036,529.56 | 0.05 |
| 58 | 110090 | 爱迪转债    | 992,235.58   | 0.05 |
| 59 | 128136 | 立讯转债    | 954,944.40   | 0.04 |
| 60 | 113662 | 豪能转债    | 898,138.63   | 0.04 |
| 61 | 127086 | 恒邦转债    | 812,833.47   | 0.04 |
| 62 | 127082 | 亚科转债    | 768,507.42   | 0.04 |
| 63 | 123187 | 超达转债    | 760,104.96   | 0.03 |
| 64 | 127063 | 贵轮转债    | 747,292.01   | 0.03 |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 65 | 118043 | 福立转债 | 729,571.26 | 0.03 |
| 66 | 110075 | 南航转债 | 701,257.06 | 0.03 |
| 67 | 128125 | 华阳转债 | 660,251.73 | 0.03 |
| 68 | 123182 | 广联转债 | 469,171.81 | 0.02 |
| 69 | 111008 | 沿浦转债 | 457,406.35 | 0.02 |
| 70 | 123188 | 水羊转债 | 420,312.53 | 0.02 |
| 71 | 110067 | 华安转债 | 375,345.56 | 0.02 |
| 72 | 113068 | 金铜转债 | 343,899.77 | 0.02 |
| 73 | 113673 | 岱美转债 | 119,562.78 | 0.01 |
| 74 | 110083 | 苏租转债 | 110,160.38 | 0.01 |
| 75 | 123158 | 宙邦转债 | 24,151.04  | 0.00 |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 易方达安心回馈混<br>合A   | 易方达安心回馈混<br>合C |
|-------------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 1,016,301,935.34 | 502,336.54     |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 7,904,649.96     | 242,443.57     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 71,742,820.36    | 244,293.82     |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -                | -              |
| 报告期期末基金份额总额                   | 952,463,764.94   | 500,486.29     |

### § 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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达安心回馈混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达安心回馈混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达安心回馈混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 8.2 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。

### 8.3 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

二〇二四年四月二十日