

易方达安心回报债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50

7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达安心回报债券型证券投资基金	
基金简称	易方达安心回报债券	
基金主代码	110027	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 21 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	
报告期末基金份额总额	6,958,183,286.57 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
下属分级基金的交易代码	110027	110028
报告期末下属分级基金的份额总额	5,944,976,150.92 份	1,013,207,135.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争战胜通货膨胀和银行定期存款利率，主要面向以储蓄存款为主要投资工具的中小投资者，追求基金资产的长期、持续、稳定增值，努力为投资者实现有吸引力的回报，为投资者提供养老投资的工具。
投资策略	本基金采取稳健的资产配置策略，通过自上而下的方法进行固定收益类品种与权益类品种的战略及战术资产配置，在控制基金资产净值波动、追求收益稳定的基础上，提高基金的收益水平。具体来看，本基金主要通过研究各类资产在较长时期的收益与风险水平特征，及各类资产收益与风险间的相关关系，对国内外宏观经济形势与政策、市场利率走势、信用利差水平、利率期限结构以及证券市场走势等因素进行分析，在本基金合同约定范围内制定合理的战略资产配置计划。固定收益品种投资方面，本基金将经济分为衰退、萧条、复苏、繁荣四个阶段，并在各个阶段通过投资不同的固定收益类属资产，以获得超越长期平均通胀水平的回报。权益类品种投资方面，本基金采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略，严格管理权益类品种的投资比例以及净值的波动幅度。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	中债-优选投资级信用债财富指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15%
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低于混合型基金、股票型基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400 881 8088	95588
传真	020-38798812	010-66105798
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55号
办公地址	广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510627；510623；519031	100140
法定代表人	吴欣荣	廖林

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
本期已实现收益	443,782,343.27	66,768,343.90
本期利润	1,549,677,932.36	227,447,580.25
加权平均基金份额本期利润	0.2901	0.2783
本期加权平均净值利润率	12.89%	12.72%
本期基金份额净值增长率	13.45%	13.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
期末可供分配利润	2,282,314,694.29	333,758,363.34
期末可供分配基金份额利润	0.3839	0.3294

期末基金资产净值	14,408,992,724.79	2,384,224,473.47
期末基金份额净值	2.4237	2.3531
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
基金份额累计净值增长率	363.50%	339.10%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达安心回报债券 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	12.06%	0.64%	2.63%	0.19%	9.43%	0.45%
过去六个月	13.45%	0.59%	2.95%	0.17%	10.50%	0.42%
过去一年	17.64%	0.48%	5.92%	0.15%	11.72%	0.33%
过去三年	29.80%	0.37%	13.39%	0.10%	16.41%	0.27%
过去五年	24.28%	0.36%	21.50%	0.08%	2.78%	0.28%
过去七年	63.25%	0.41%	29.63%	0.07%	33.62%	0.34%
过去十年	92.18%	0.46%	41.80%	0.06%	50.38%	0.40%
自基金合同生效起至今	363.50%	0.64%	70.42%	0.05%	293.08%	0.59%

易方达安心回报债券 B

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	11.95%	0.64%	2.63%	0.19%	9.32%	0.45%
过去六个月	13.22%	0.59%	2.95%	0.17%	10.27%	0.42%
过去一年	17.17%	0.48%	5.92%	0.15%	11.25%	0.33%
过去三年	28.23%	0.37%	13.39%	0.10%	14.84%	0.27%
过去五年	21.80%	0.36%	21.50%	0.08%	0.30%	0.28%
过去七年	58.70%	0.41%	29.63%	0.07%	29.07%	0.34%
过去十年	84.99%	0.46%	41.80%	0.06%	43.19%	0.40%
自基金合同生效起至今	339.10%	0.64%	70.42%	0.05%	268.68%	0.59%

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

易方达安心回报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

(2011 年 6 月 21 日至 2026 年 6 月 30 日)

易方达安心回报债券 A



易方达安心回报债券 B



注：自 2025 年 2 月 18 日起，本基金业绩比较基准由“三年期银行定期存款收益率(税后)+1.0%”调整为“中债-优选投资级信用债财富指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×15%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
张清华	本基金的基金经理，易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达安盈回报混合、易方达新收益混合、易方达悦兴一年持有混合、易方达全球配置混合（QDII）的基金经理，高级董事总经理、多资产投资决策委员会委员	2013-12-23	-	19 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、副总经理级高级管理人员，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、易方达丰华债券、易方达磐固六个月持有混合的基金经理。
杨康	本基金的基金经理助理，易方达鑫转增利混合、易方达裕富债券、易	2019-06-19	2026-06-29	11 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

	方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达瑞景混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞锦混合、易方达悦恒稳健债券的基金经理，易方达安盈回报混合（自 2019 年 06 月 10 日至 2026 年 06 月 28 日）、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助理，多资产公募投资部总经理助理				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，易方达鑫转招利混合、易方达瑞川混合发起式、易方达瑞锦混合发起式、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达新益混合、易方达新享混合、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、易方达瑞川混合的基金经理。
周琼	本基金的基金经理助理，易方达悦兴一年持有混合的基金经理，易方达鑫转添利混合、易方达裕丰回报债券、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、易方达新利混合（自 2019 年 10 月 30 日至 2026 年 03 月 13 日）、易方达新鑫混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达丰惠混合、易方达瑞锦混合、易方达悦兴一年持有混合（自 2020 年 12 月 01 日至 2026 年 06 月 12 日）、易方达瑞通混合、易方达全球配置混合（QDII）、易方达丰和债券的基金经理助理	2019-10-11	-	12 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。
罗川	本基金的基金经理助理，易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达新享混合、易方达瑞信混合、易方达瑞选混合、易方达丰惠混合的基金经理，易方达悦丰稳健债券、易方达稳健增长混合、易方达稳健回报混合、易方达稳健增利混合的基金经理助理	2026-06-03	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中金基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司研究员。
胡文伯	本基金的基金经理助理，易方达裕鑫债券、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，易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达磐恒九个月持有混合、易方达悦享一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、易方达安盈回报混合的基金经理助理	2026-06-27	-	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员，易方达双债增强债券、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合的基金经理。

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/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，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 64 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济增长态势良好，一季度受出口和财政带动，国内 GDP 实现 5.0%的较高增长，二季度财政投放节奏有所放缓，经济增速边际放缓至 4.3%，但仍处于政策的合意区间。价格方面，3 月以来的美伊冲突推升了原油等大宗商品价格，在输入性通胀带动下，PPI 同比增速较年初预期更早转正，CPI 同比增速温和回升但向上弹性有限。

中国经济呈现出“分化”的特征：新旧动能分化、内外需走势分化。从 2025 年四季度以来，外需持续对中国经济形成拉动，这一趋势在 2026 年二季度进一步强化。出口的高增来自三方面因素的共

同作用，分别是全球 AI 产业增长带动、美国补库周期对非 AI 出口的拉动、及中美经贸摩擦缓和后中国出口份额的回升，往后看这三个因素预计仍将持续。但另一方面，在出口高增的情况下，新增政策出台的必要性下降，内需仍待复苏。居民消费增速较低，房地产仍在依靠市场的自发出清，虽然个别一线城市房地产市场的量价有初步企稳迹象，但广泛的低线城市仍有压力。

与宏观基本面相对应，资本市场也展现出“分化”特征：债券市场的中短期信用品种和长期限品种的收益率分化、权益市场的科技和传统行业的市场表现分化。债券市场资金面保持平稳、市场配置需求旺盛，中短期信用债较国债收益率的利差持续压低；长期利率品种的收益率则在价格因素回升和内需修复节奏相对温和的双重影响下维持窄幅震荡，上半年大部分时间内，10 年期国债收益率在 1.70%-1.82% 的区间内波动，超长债期限利差始终维持较高水平。

权益市场方面，全球制造业修复与 AI 资本开支持续上修带领科技主线领涨开年的“春季躁动”行情，3 月虽受到中东地缘事件的影响市场有所回调，但 A 股市场展现出较好的韧性，行情主线逐步聚焦于具备产业趋势的 AI 产业链、业绩确定性的出口链等新经济概念板块，而与传统经济相关的消费、地产链板块股价则持续走低。

转债市场年初以来继续演绎稀缺性的逻辑。估值已经进入历史极高水平，偏债型转债的配置价值下降，而偏股型转债更依赖对正股的判断。但由于转债正股中科技占比明显低于股票指数，转债市场从整体稀缺转向局部稀缺，5 月以来随着发行人赎回的增多，高估值转债的脆弱性显现，中证转债指数持续回落，几乎回吐年内涨幅。

报告期内，本基金规模有所增长，权益仓位整体维持较高水平。期间受到中东地缘事件的冲击市场风险偏好骤降，面对较为不确定的市场，组合短暂降仓，后续随着市场情绪的缓和再度将仓位提升至较高水平。行业配置上，基于对出口和 AI 产业景气趋势的乐观判断，组合持仓逐渐向电子和通信行业集中。转债估值处于历史高位，博弈难度加大，仓位更宜逆势操作，在市场上涨过程中逐步兑现高价个券，并在 6 月市场调整后再度加仓；考虑到大量转债对应正股的期权属性受损于分化行情，且偏股型转债估值仍在偏贵水平，结构上更多配置在高价和低价转债两端，结合股票的凸性区间去判断转债的凸性，尝试获取转债不对称的风险收益特征带来的机会。债券方面，年初考虑到价格指数回升，组合久期有所下降，二季度观察到内需修复节奏相对温和后，逐步提升至中性水平，持仓以高等级信用债和金融债为主，以获取票息收益，同时积极把握利率债的波段机会。

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 2.4237 元，本报告期份额净值增长率为 13.45%，同期业绩比较基准收益率为 2.95%；B 类基金份额净值为 2.3531 元，本报告期份额净值增长率为 13.22%，同期业绩比较基准收益率为 2.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济“K 型分化”的格局仍将延续。一方面，我们观察到 AI 对出口和相关企业利润形成显著带动、行业资本开支周期开启，但对经济整体的拉动作用有限，这是因为在当前供给约束的环境下，巨额 AI 需求主要推升了相关产品的价格，对量的带动有限；同时 AI 的通胀效应对传统的需求还存在挤出效应。另一方面，内需修复节奏相对温和，地产下跌导致的居民财富缩水尚难以依靠 AI 带来的财富效应弥补，居民资产负债表仍在修复阶段。

我们对出口的判断依然相较市场更为乐观，除了 AI 产业扩张带来的出口高增尚无走弱的迹象外，随着美国开启补库周期，对非 AI 产业的出口也将形成拉动，2026 年二季度的出口数据验证了这一判断，未来这一趋势预计仍将延续。

基于上述判断，组合仍将主要的风险敞口暴露在外需相关的 AI、高端制造等板块，积极关注内需相关的消费、地产链等行业企稳回升的时点，同时在市场波动的过程中积极把握交易型机会。债券方面，流动性平稳、内需修复节奏相对温和，债券维持震荡判断，持仓仍以信用债和金融债为主，以获取票息收益，保持较好流动性积极把握波段交易机会。转债虽然是一个典型的均值回复型资产，但在风险偏好抬升、供给稀缺性持续的背景下，溢价率大概率还是易涨难跌，择券需要平衡好转债溢价率、剩余期限和正股空间等多重因素，灵活操作，力争为持有人提供更好的中长期回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达安心回报债券 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达安心回报债券 B:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达安心回报债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,280,943.06	1,074,714.55
结算备付金		61,319,014.56	47,306,637.88
存出保证金		891,130.43	486,670.41
交易性金融资产	6.4.7.2	21,476,887,571.24	13,088,362,303.00
其中：股票投资		3,311,159,283.14	2,048,405,191.10
基金投资		-	-

债券投资		18,056,736,243.35	10,808,943,735.50
资产支持证券投资		108,992,044.75	231,013,376.40
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		355,065,252.21	16,692,023.11
应收股利		-	-
应收申购款		78,011,069.63	8,166,306.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		21,973,454,981.13	13,162,088,655.14
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,701,673,710.97	2,587,312,805.48
应付清算款		363,073,213.19	-
应付赎回款		100,704,924.13	33,243,222.03
应付管理人报酬		9,412,833.72	6,431,082.14
应付托管费		2,689,381.08	1,837,452.00
应付销售服务费		737,101.57	471,870.37
应付投资顾问费		-	-
应交税费		522,904.50	353,483.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,423,713.71	1,241,538.15
负债合计		5,180,237,782.87	2,630,891,453.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	6,958,183,286.57	4,946,862,265.63
未分配利润	6.4.7.8	9,835,033,911.69	5,584,334,935.89
净资产合计		16,793,217,198.26	10,531,197,201.52
负债和净资产总计		21,973,454,981.13	13,162,088,655.14

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.4237 元，B 类基金份额净值 2.3531 元；

基金份额总额 6,958,183,286.57 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额

5,944,976,150.92 份，B 类基金份额总额 1,013,207,135.65 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达安心回报债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,866,747,072.83	233,733,702.28
1.利息收入		288,636.89	229,674.18
其中：存款利息收入	6.4.7.9	283,652.84	220,583.77
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,984.05	9,090.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		591,985,641.22	285,166,961.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	437,617,069.40	-66,897,349.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	145,428,489.58	328,750,607.61
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	2,903,531.58	5,742,355.19
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	6,036,550.66	17,571,348.39
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,266,574,825.44	-52,071,184.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	7,897,969.28	408,251.00
减：二、营业总支出		89,621,560.22	76,728,271.26
1. 管理人报酬		47,540,166.56	33,026,277.84
2. 托管费		13,582,904.80	9,436,079.32
3. 销售服务费		3,525,698.28	3,232,975.78
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		24,537,285.59	30,664,005.60
其中：卖出回购金融资产支出		24,537,285.59	30,664,005.60
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		279,396.97	214,069.12
8. 其他费用	6.4.7.18	156,108.02	154,863.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,777,125,512.61	157,005,431.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,777,125,512.61	157,005,431.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,777,125,512.61	157,005,431.02

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达安心回报债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,946,862,265.63	5,584,334,935.89	10,531,197,201.52
二、本期期初净资产	4,946,862,265.63	5,584,334,935.89	10,531,197,201.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,011,321,020.94	4,250,698,975.80	6,262,019,996.74
（一）、综合收益总额	-	1,777,125,512.61	1,777,125,512.61
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,011,321,020.94	2,473,573,463.19	4,484,894,484.13
其中：1.基金申购款	5,420,640,117.53	6,762,279,257.97	12,182,919,375.50
2.基金赎回款	-3,409,319,096.59	-4,288,705,794.78	-7,698,024,891.37
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	6,958,183,286.57	9,835,033,911.69	16,793,217,198.26
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,833,515,389.02	4,913,963,832.69	9,747,479,221.71
二、本期期初净资产	4,833,515,389.02	4,913,963,832.69	9,747,479,221.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-68,833,716.30	96,996,460.98	28,162,744.68

(一)、综合收益总额	-	157,005,431.02	157,005,431.02
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-68,833,716.30	-60,008,970.04	-128,842,686.34
其中: 1.基金申购款	1,290,552,796.55	1,306,059,172.54	2,596,611,969.09
2.基金赎回款	-1,359,386,512.85	-1,366,068,142.58	-2,725,454,655.43
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	4,764,681,672.72	5,010,960,293.67	9,775,641,966.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达安心回报债券型证券投资基金(以下简称“本基金”) 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]665 号《关于核准易方达安心回报债券型证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达安心回报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，《易方达安心回报债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,790,229,532.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 786,926.23 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信

息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

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

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。对资

管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,280,943.06
等于：本金	1,274,589.70
加：应计利息	6,353.36
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	1,280,943.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,676,161,163.03	-	3,311,159,283.14	1,634,998,120.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,918,828,257.34	37,255,852.03	6,921,349,938.76	-34,734,170.61
	银行间市场	10,980,143,519.46	76,223,904.59	11,135,386,304.59	79,018,880.54
	合计	17,898,971,776.80	113,479,756.62	18,056,736,243.35	44,284,709.93
资产支持证券		107,416,922.11	1,544,044.75	108,992,044.75	31,077.89
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		19,682,549,861.94	115,023,801.37	21,476,887,571.24	1,679,313,907.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	69,768.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,251,245.52
其中：交易所市场	1,061,807.02
银行间市场	189,438.50
应付利息	-
预提费用	102,699.40
合计	1,423,713.71

6.4.7.7 实收基金

易方达安心回报债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,301,999,454.61	4,301,999,454.61
本期申购	4,553,409,689.23	4,553,409,689.23
本期赎回（以“-”号填列）	-2,910,432,992.92	-2,910,432,992.92
本期末	5,944,976,150.92	5,944,976,150.92

易方达安心回报债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	644,862,811.02	644,862,811.02
本期申购	867,230,428.30	867,230,428.30
本期赎回（以“-”号填列）	-498,886,103.67	-498,886,103.67
本期末	1,013,207,135.65	1,013,207,135.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达安心回报债券 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	1,307,374,427.97	3,581,590,795.01	4,888,965,222.98
本期期初	1,307,374,427.97	3,581,590,795.01	4,888,965,222.98
本期利润	443,782,343.27	1,105,895,589.09	1,549,677,932.36
本期基金份额交易产生的变动数	531,157,923.05	1,494,215,495.48	2,025,373,418.53
其中：基金申购款	1,491,187,638.63	4,222,802,444.87	5,713,990,083.50
基金赎回款	-960,029,715.58	-2,728,586,949.39	-3,688,616,664.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,282,314,694.29	6,181,701,879.58	8,464,016,573.87

易方达安心回报债券 B

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	165,079,055.88	530,290,657.03	695,369,712.91
本期期初	165,079,055.88	530,290,657.03	695,369,712.91
本期利润	66,768,343.90	160,679,236.35	227,447,580.25
本期基金份额交易产生的变动数	101,910,963.56	346,289,081.10	448,200,044.66
其中：基金申购款	241,391,812.19	806,897,362.28	1,048,289,174.47
基金赎回款	-139,480,848.63	-460,608,281.18	-600,089,129.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	333,758,363.34	1,037,258,974.48	1,371,017,337.82

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	70,245.61
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	91,312.23
其他	122,095.00
合计	283,652.84

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	437,617,069.40
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	437,617,069.40

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,709,427,357.91
减：卖出股票成本总额	2,268,189,400.78
减：交易费用	3,620,887.73
买卖股票差价收入	437,617,069.40

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	138,627,017.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,801,472.32
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	145,428,489.58

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,003,584,491.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,940,220,391.68
减：应计利息总额	56,256,368.99
减：交易费用	306,258.68
买卖债券差价收入	6,801,472.32

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	2,770,233.25
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	133,298.33
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,903,531.58

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	123,348,964.06
减：卖出资产支持证券成本总额	118,853,207.60
减：应计利息总额	4,362,458.13
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	133,298.33

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,036,550.66
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	6,036,550.66

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	1,266,574,825.44

——股票投资	1,326,147,861.82
——债券投资	-58,871,243.98
——资产支持证券投资	-701,792.40
——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	1,266,574,825.44

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	7,897,969.28
合计	7,897,969.28

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	43,192.03
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
银行汇划费	34,808.62
其他	600.00
合计	156,108.02

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期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	168,880.71	0.00%	221,019.84	0.02%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30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	61.64	0.00%	61.64	0.01%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	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	80.67	0.02%	-	-

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.本基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务及研究服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	47,540,166.56	33,026,277.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,681,713.28	7,300,031.18
应支付基金管理人的净管理费	35,858,453.28	25,726,246.66

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：

$$H=E\times 0.70\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,582,904.80	9,436,079.32

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金

托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B	合计
易方达基金管理有限公司	-	619,617.27	619,617.27
中国工商银行	-	670,095.18	670,095.18
广发证券	-	33,502.97	33,502.97
易方达财富	-	21,147.92	21,147.92
合计	-	1,344,363.34	1,344,363.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,005,060.36	1,005,060.36
中国工商银行	-	374,020.17	374,020.17
广发证券	-	44,128.73	44,128.73
合计	-	1,423,209.26	1,423,209.26

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金销售服务费按前一日 B 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：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2026年1月1日至2026年6月30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
中国工商银行	-	163,165,732.74	-	-	-	-
上年度可比期间						
2025年1月1日至2025年6月30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
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达安心回报债券 A

无。

易方达安心回报债券 B

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	1,280,943.06	70,245.61	101,659,703.45	30,087.74

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达安心回报债券 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达安心回报债券 B

本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
002851	麦格米特	2026-01-27	6 个月	非公开发行流通受限	85.01	155.65	970,409	82,494,469.09	151,044,160.85	-
300666	江丰电子	2026-06-12	6 个月	非公开发	181.01	324.87	213,940	38,725,279.4	69,502,687.8	-

				行流通受限				0	0	
600733	北汽蓝谷	2026-01-27	6 个月	非公开发行流通受限	7.56	4.77	14,920,687	112,800,393.72	71,171,676.99	-
688072	拓荆科技	2026-06-23	6 个月	非公开发行流通受限	576.01	787.85	114,633	66,029,754.33	90,313,609.05	-
301308	江波龙	2026-01-26	6 个月	询价转让流通受限	212.09	675.52	31,066	6,588,787.94	20,985,704.32	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	787.85	2026-07-13	890.99	114,633	66,029,754.33	90,313,609.05	非公开发行流通受限

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,581,173,710.97 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
092280081	22 光大银行二级资本债 01B	2026-07-01	110.71	98,000	10,849,265.86

102481079	24 陕西交通 MTN001B	2026-07-01	103.92	100,000	10,391,640.00
102481663	24 东方国际 MTN001	2026-07-01	102.74	250,000	25,685,308.22
102485433	24 中国铜业 MTN001	2026-07-01	102.37	100,000	10,237,242.19
102501358	25 陕煤化 MTN002	2026-07-01	101.52	200,000	20,304,317.81
102501481	25 中铝集 MTN004	2026-07-01	102.64	200,000	20,527,539.73
102582768	25 日照港 MTN001	2026-07-01	102.33	117,000	11,972,222.14
102584121	25 华能新能 MTN004	2026-07-01	102.92	200,000	20,584,401.10
102584426	25 华能新能 MTN005	2026-07-01	103.64	500,000	51,822,413.70
102584711	25 沪电力 MTN007	2026-07-01	102.09	200,000	20,418,701.37
102584997	25 鲁西化工 MTN002(科创 债)	2026-07-01	101.87	200,000	20,374,210.41
102601881	26 中化能源 MTN001	2026-07-01	101.16	300,000	30,348,669.04
102601962	26 先正达 MTN002(科创 债)	2026-07-01	100.89	300,000	30,268,285.48
102680490	26 先正达 MTN001(科创 债)	2026-07-01	101.31	18,000	1,823,580.00
210208	21 国开 08	2026-07-01	102.58	510,000	52,315,548.49
220203	22 国开 03	2026-07-01	101.79	205,000	20,867,371.23
240202	24 国开 02	2026-07-01	101.66	164,000	16,673,017.32
240303	24 进出 03	2026-07-01	100.98	100,000	10,098,054.79
242580014	25 北京银行 永续债 01	2026-07-01	101.23	4,548,000	460,409,116.93
250361	25 进出 61	2026-07-01	100.16	24,000	2,403,763.69
250431	25 农发 31	2026-07-01	101.27	1,103,000	111,699,812.77
272400007	24 中国人寿 资本补充债 01BC	2026-07-01	102.95	1,071,000	110,259,479.34
092280081	22 光大银行 二级资本债 01B	2026-07-02	110.71	278,000	30,776,488.88
102501672	25 华能新能	2026-07-02	103.31	300,000	30,993,289.31

	MTN006				
102580860	25 中色 MTN002	2026-07-02	103.14	300,000	30,941,104.11
102581924	25 淮南矿 MTN002	2026-07-02	101.19	500,000	50,594,391.78
102582460	25 湘高速 MTN012	2026-07-02	100.64	1,116,000	112,312,344.33
102584758	25 华能新能 MTN007	2026-07-02	102.94	398,000	40,969,862.66
232480020	24 兴业银行 二级资本债 01	2026-07-02	102.65	2,043,000	209,712,270.82
232680007	26 兴业银行 二级资本债 01	2026-07-02	100.71	2,000,000	201,427,441.10
242400019	24 江苏银行 永续债 02	2026-07-02	103.51	500,000	51,757,076.71
242680010	26 宁波银行 永续债 01	2026-07-02	100.34	877,000	87,995,378.41
242680011	26 北京银行 永续债 01	2026-07-02	100.21	547,000	54,815,439.48
240403	24 农发 03	2026-07-03	101.20	685,000	69,325,227.94
242400008	24 江苏银行 永续债 01	2026-07-03	102.35	835,000	85,465,109.59
242400025	24 北京银行 永续债 01	2026-07-03	103.38	2,537,000	262,282,163.60
242680011	26 北京银行 永续债 01	2026-07-03	100.21	2,509,000	251,429,502.11
250431	25 农发 31	2026-07-03	101.27	1,421,000	143,903,385.26
092200009	22 农行二级 资本债 02B	2026-07-06	110.67	3,000	332,001.22
092280081	22 光大银行 二级资本债 01B	2026-07-06	110.71	124,000	13,727,642.52
102400913	24 中储发展 MTN001	2026-07-06	103.36	100,000	10,336,031.78
102480674	24 诚通控股 MTN007A	2026-07-06	107.57	100,000	10,756,675.07
102481494	24 川高速 MTN005(乡村 振兴)	2026-07-06	103.29	500,000	51,644,041.10
102481669	24 安瑞科控 MTN001	2026-07-06	101.08	100,000	10,108,216.99
102482735	24 江西铁航	2026-07-06	102.04	500,000	51,018,041.10

	MTN002				
102501665	25 顺义国资 MTN003	2026-07-06	102.08	300,000	30,623,741.92
102581105	25 福建能化 MTN001	2026-07-06	101.78	100,000	10,177,992.33
102581349	25 陕西交控 MTN002	2026-07-06	102.38	200,000	20,476,953.42
102581790	25 香格里拉 MTN001A(BC)	2026-07-06	101.28	100,000	10,128,490.96
102681339	26 北控水集 MTN001	2026-07-06	100.99	500,000	50,492,956.16
102681702	26 丰台国资 MTN001	2026-07-06	100.85	100,000	10,084,914.52
102681854	26 云铜股 MTN001	2026-07-06	100.27	100,000	10,027,201.64
232380089	23 中信银行 二级资本债 01A	2026-07-06	105.48	900,000	94,928,764.93
232480001	24 中行二级 资本债 01A	2026-07-06	104.06	100,000	10,406,397.26
232480050	24 上海银行 二级资本债 01	2026-07-06	103.28	1,271,000	131,270,063.95
232480052	24 浦发银行 二级资本债 01A	2026-07-06	103.41	3,029,000	313,220,458.59
232580024	25 农行二级 资本债 02A(BC)	2026-07-06	102.41	400,000	40,963,684.39
232580026	25 建行二级 资本债 02A(BC)	2026-07-06	102.50	296,000	30,339,985.40
242400004	24 邮储永续 债 01	2026-07-06	103.61	300,000	31,082,482.19
242480002	24 兴业银行 永续债 01	2026-07-06	102.34	623,000	63,755,457.72
242480082	24 农行永续 债 03BC	2026-07-06	103.21	1,100,000	113,530,035.62
242480086	24 中行永续 债 02BC	2026-07-06	102.68	157,000	16,120,053.71
242580002	25 邮储永续 债 01BC	2026-07-06	101.56	500,000	50,778,506.85
242580007	25 兴业银行	2026-07-06	101.46	1,000,000	101,461,495.89

	永续债 01BC				
102382044	23 诚通控股 MTN003	2026-07-07	113.62	100,000	11,362,282.19
102481221	24 海运集装 MTN002(科创 票据)	2026-07-07	103.77	500,000	51,882,547.95
102481665	24 北控水集 MTN002	2026-07-07	102.82	100,000	10,281,880.00
102483657	24 鲁西化工 MTN001(科创 票据)	2026-07-07	103.47	400,000	41,389,424.66
102485101	24 中国环保 MTN001	2026-07-07	104.00	200,000	20,799,948.49
102580299	25 苏农垦 MTN001(科创 票据)	2026-07-07	102.04	100,000	10,203,586.30
102580323	25 拜耳 MTN001BC	2026-07-07	102.21	300,000	30,663,961.64
102581659	25 中国环保 MTN002	2026-07-07	101.20	300,000	30,359,589.04
102581866	25 中电科技 MTN001(科创 票据)	2026-07-07	101.23	100,000	10,122,572.60
102582119	25 中原高速 MTN002	2026-07-07	100.69	200,000	20,138,140.27
102582362	25 巴斯夫 MTN001B(BC)	2026-07-07	101.57	64,000	6,500,796.67
102582486	25 淮南矿 MTN004	2026-07-07	100.61	69,000	6,941,823.07
102583039	25 江铜 MTN002(科创 债)	2026-07-07	103.20	100,000	10,320,156.71
102584837	25 大众汽车 MTN002A(BC)	2026-07-07	101.70	100,000	10,169,753.42
102584838	25 大众汽车 MTN002B(BC)	2026-07-07	102.11	200,000	20,421,282.19
102584925	25 蓝星 MTN006	2026-07-07	101.56	100,000	10,155,739.18
102601887	26 华润 MTN002A	2026-07-07	100.95	500,000	50,474,846.58
102680712	26 华润	2026-07-07	101.11	57,000	5,763,112.27

	MTN001				
102681355	26 江西交投 MTN005	2026-07-07	100.52	200,000	20,104,334.25
102681841	26 淮河能源 MTN005	2026-07-07	100.64	500,000	50,318,063.01
132680068	26 华能水电 GN008	2026-07-07	100.60	100,000	10,060,189.04
232580016	25 农行二级 资本债 01A(BC)	2026-07-07	100.75	100,000	10,074,922.19
242580063	25 上海银行 永续债 01	2026-07-07	103.46	669,000	69,215,696.76
242680002	26 招商银行 永续债 01	2026-07-07	101.09	294,000	29,720,596.93
242680009	26 交行永续 债 01BC	2026-07-07	100.47	177,000	17,782,716.71
242680011	26 北京银行 永续债 01	2026-07-07	100.21	1,292,000	129,472,665.10
272400007	24 中国人寿 资本补充债 01BC	2026-07-07	102.95	232,000	23,884,406.36
282380005	23 太平人寿 永续债 01	2026-07-07	105.52	300,000	31,655,613.70
312610002	26 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	2026-07-07	101.15	1,000,000	101,153,150.68
312610009	26 中行 TLAC 非资本债 01BC	2026-07-07	100.30	304,000	30,492,587.57
合计				48,515,000	4,954,713,110.46

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 120,500,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 99.17%(2025 年 12 月 31 日：92.80%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元		
短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	865,173,342.11	547,174,325.48
合计	865,173,342.11	547,174,325.48

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。
3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	11,981,899,702.06	5,805,502,306.37
AAA 以下	2,467,155,903.45	1,432,246,990.22
未评级	2,742,507,295.73	3,024,020,113.43
合计	17,191,562,901.24	10,261,769,410.02

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	108,992,044.75	231,013,376.40
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	108,992,044.75	231,013,376.40

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金

资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,280,943.06	-	-	-	1,280,943.06
结算备付金	61,319,014.56	-	-	-	61,319,014.56
存出保证金	891,130.43	-	-	-	891,130.43
交易性金融资产	1,275,909,927.84	13,882,691,609.04	3,007,126,751.22	3,311,159,283.14	21,476,887,571.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	355,065,252.21	355,065,252.21
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	78,011,069.63	78,011,069.63
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,339,401,015.89	13,882,691,609.04	3,007,126,751.22	3,744,235,604.98	21,973,454,981.13
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	4,701,673,710.97	-	-	-	4,701,673,710.97
应付清算款	-	-	-	363,073,213.19	363,073,213.19
应付赎回款	-	-	-	100,704,924.13	100,704,924.13
应付管理人报酬	-	-	-	9,412,833.72	9,412,833.72
应付托管费	-	-	-	2,689,381.08	2,689,381.08

应付销售服务费	-	-	-	737,101.57	737,101.57
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	522,904.50	522,904.50
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,423,713.71	1,423,713.71
负债总计	4,701,673,710.97	-	-	478,564,071.90	5,180,237,782.87
利率敏感度缺口	-3,362,272,695.08	13,882,691,609.04	3,007,126,751.22	3,265,671,533.08	16,793,217,198.26
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,074,714.55	-	-	-	1,074,714.55
结算备付金	47,306,637.88	-	-	-	47,306,637.88
存出保证金	486,670.41	-	-	-	486,670.41
交易性金融资产	1,064,930,613.54	7,775,963,541.90	2,199,062,956.46	2,048,405,191.10	13,088,362,303.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	16,692,023.11	16,692,023.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	8,166,306.19	8,166,306.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,113,798,636.38	7,775,963,541.90	2,199,062,956.46	2,073,263,520.40	13,162,088,655.14
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,587,312,805.48	-	-	-	2,587,312,805.48
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	33,243,222.03	33,243,222.03
应付管理人报酬	-	-	-	6,431,082.14	6,431,082.14

应付托管费	-	-	-	1,837,452.00	1,837,452.00
应付销售服务费	-	-	-	471,870.37	471,870.37
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	353,483.45	353,483.45
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,241,538.15	1,241,538.15
负债总计	2,587,312,805.48	-	-	43,578,648.14	2,630,891,453.62
利率敏感度缺口	-1,473,514,169.10	7,775,963,541.90	2,199,062,956.46	2,029,684,872.26	10,531,197,201.52

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	138,860,105.24	67,308,126.70
	2.市场利率上升 25 个基点	-136,377,018.21	-66,451,920.13

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	3,311,159,283.14	19.72	2,048,405,191.10	19.45
交易性金融资产—债券投资	3,548,006,881.34	21.13	-	-
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	6,859,166,164.48	40.84	2,048,405,191.10	19.45

6.4.13.4.3.2 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	2,432,190,929.20	1,476,925,274.84
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,432,190,929.20	-1,476,925,274.84

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	6,363,927,926.01
第二层次	14,709,941,806.22
第三层次	403,017,839.01
合计	21,476,887,571.24

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,311,159,283.14	15.07
	其中：股票	3,311,159,283.14	15.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,165,728,288.10	82.67
	其中：债券	18,056,736,243.35	82.18
	资产支持证券	108,992,044.75	0.50
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	62,599,957.62	0.28
8	其他各项资产	433,967,452.27	1.97
9	合计	21,973,454,981.13	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	2,778,097,820.63	16.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,055.00	0.00
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	533,056,407.51	3.17
J	金融业	-	-
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	-	-
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	3,311,159,283.14	19.72

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688521	芯原股份	782,799	290,528,020.86	1.73
2	300502	新易盛	476,904	289,480,728.00	1.72
3	300408	三环集团	1,645,600	274,650,640.00	1.64
4	688256	寒武纪	152,003	242,528,386.65	1.44
5	688548	广钢气体	4,227,240	220,239,204.00	1.31
6	603067	振华股份	4,648,878	215,196,562.62	1.28

7	300308	中际旭创	164,100	208,407,000.00	1.24
8	603986	兆易创新	230,500	187,857,500.00	1.12
9	300666	江丰电子	476,940	166,444,487.80	0.99
10	002353	杰瑞股份	1,077,330	164,292,825.00	0.98
11	002851	麦格米特	970,409	151,044,160.85	0.90
12	300433	蓝思科技	2,256,400	121,078,424.00	0.72
13	688396	华润微	1,106,162	107,906,103.10	0.64
14	002371	北方华创	115,600	102,255,136.00	0.61
15	002384	东山精密	386,600	101,424,510.00	0.60
16	300604	长川科技	280,400	95,734,168.00	0.57
17	688008	澜起科技	304,699	94,426,220.10	0.56
18	688072	拓荆科技	114,633	90,313,609.05	0.54
19	600733	北汽蓝谷	14,920,687	71,171,676.99	0.42
20	002491	通鼎互联	1,676,887	54,331,138.80	0.32
21	300274	阳光电源	256,900	40,852,238.00	0.24
22	301308	江波龙	31,066	20,985,704.32	0.12
23	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
24	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	600498	烽火通信	279,492,563.58	2.65
2	603259	药明康德	137,263,357.77	1.30
3	688220	翱捷科技	113,782,406.91	1.08
4	600733	北汽蓝谷	112,800,393.72	1.07
5	300502	新易盛	106,277,496.00	1.01
6	300433	蓝思科技	105,831,249.41	1.00
7	688548	广钢气体	101,134,904.43	0.96
8	002851	麦格米特	82,494,469.09	0.78
9	002648	卫星化学	81,296,198.72	0.77
10	688008	澜起科技	81,227,813.81	0.77
11	002371	北方华创	81,117,625.14	0.77
12	300666	江丰电子	79,172,187.40	0.75
13	300014	亿纬锂能	76,731,651.36	0.73
14	688396	华润微	72,338,063.56	0.69
15	603067	振华股份	69,709,901.22	0.66
16	600584	长电科技	66,446,579.98	0.63
17	688072	拓荆科技	66,029,754.33	0.63
18	002491	通鼎互联	63,850,477.83	0.61
19	002916	深南电路	58,498,993.16	0.56

20	002353	杰瑞股份	44,020,001.00	0.42
----	--------	------	---------------	------

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	600498	烽火通信	244,039,774.74	2.32
2	603259	药明康德	228,628,618.85	2.17
3	300408	三环集团	178,957,866.00	1.70
4	300502	新易盛	174,339,683.82	1.66
5	600486	扬农化工	160,553,154.09	1.52
6	300308	中际旭创	151,186,168.91	1.44
7	002648	卫星化学	101,129,988.00	0.96
8	300750	宁德时代	99,448,706.63	0.94
9	002475	立讯精密	92,041,949.00	0.87
10	688220	翱捷科技	91,167,990.57	0.87
11	000534	万泽股份	88,142,481.00	0.84
12	300274	阳光电源	84,715,720.55	0.80
13	601899	紫金矿业	83,595,971.30	0.79
14	002491	通鼎互联	80,907,454.57	0.77
15	300014	亿纬锂能	78,530,259.58	0.75
16	603893	瑞芯微	73,168,871.92	0.69
17	688188	柏楚电子	72,385,322.00	0.69
18	300394	天孚通信	67,495,037.86	0.64
19	600584	长电科技	64,144,851.70	0.61
20	002916	深南电路	54,959,738.11	0.52

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。

7.4.3 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	2,204,795,631.00
卖出股票收入（成交）总额	2,709,427,357.91

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	146,644,808.74	0.87

2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,181,603,930.61	54.67
	其中：政策性金融债	865,173,342.11	5.15
4	企业债券	1,516,078,042.07	9.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,164,010,143.27	18.84
7	可转债（可交换债）	3,548,006,881.34	21.13
8	同业存单	-	-
9	其他	500,392,437.32	2.98
10	合计	18,056,736,243.35	107.52

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	242580014	25 北京银行永续债 01	5,800,000	587,153,227.40	3.50
2	242680011	26 北京银行永续债 01	4,800,000	481,012,997.26	2.86
3	250431	25 农发 31	4,630,000	468,875,913.97	2.79
4	242400025	24 北京银行永续债 01	3,400,000	351,501,520.00	2.09
5	242480002	24 兴业银行永续债 01	3,400,000	347,943,107.95	2.07

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	260418	G 黄河优	500,000	51,244,438.78	0.31
2	156659	PR 产 1A	500,000	48,744,029.64	0.29
3	112887	G 中交泰 A	100,000	9,003,576.33	0.05

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,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、中国人民银行的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局上海市分局、中国人民银行的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国农业发展银行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。中国人寿保险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北京市分局的处罚。

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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	891,130.43
2	应收清算款	355,065,252.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	78,011,069.63

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	433,967,452.27

7.12.4 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	118034	晶能转债	275,231,740.34	1.64
2	127049	希望转 2	158,425,012.93	0.94
3	113052	兴业转债	130,356,321.55	0.78
4	127064	杭氧转债	123,060,235.63	0.73
5	118031	天 23 转债	113,835,276.05	0.68
6	127089	晶澳转债	110,762,126.28	0.66
7	113048	晶科转债	109,530,080.95	0.65
8	123216	科顺转债	108,006,722.96	0.64
9	113042	上银转债	96,398,725.96	0.57
10	113056	重银转债	94,793,714.95	0.56
11	127067	恒逸转 2	76,958,512.57	0.46
12	113691	和邦转债	73,289,427.17	0.44
13	127040	国泰转债	62,584,182.88	0.37
14	118050	航宇转债	59,024,463.70	0.35
15	127050	麒麟转债	54,268,174.87	0.32
16	113062	常银转债	52,310,216.77	0.31
17	110093	神马转债	51,180,095.54	0.30
18	127108	太能转债	49,098,632.25	0.29
19	113051	节能转债	49,007,064.45	0.29
20	113070	渝水转债	48,949,942.79	0.29
21	127045	牧原转债	48,246,189.16	0.29
22	113067	燃 23 转债	48,181,041.12	0.29
23	127056	中特转债	47,379,346.11	0.28
24	127083	山路转债	47,166,890.84	0.28
25	118030	睿创转债	46,763,896.47	0.28
26	127110	广核转债	45,814,576.04	0.27
27	118058	微导转债	42,068,456.94	0.25
28	110087	天业转债	39,163,090.78	0.23
29	113058	友发转债	36,315,889.90	0.22
30	123176	精测转 2	33,128,549.65	0.20
31	110099	福能转债	31,467,706.25	0.19

32	123247	万凯转债	31,199,983.14	0.19
33	127082	亚科转债	29,188,218.15	0.17
34	118053	正帆转债	28,974,689.73	0.17
35	127103	东南转债	28,006,004.84	0.17
36	111000	起帆转债	27,348,885.91	0.16
37	110098	南药转债	25,573,893.04	0.15
38	113054	绿动转债	24,970,884.78	0.15
39	113631	皖天转债	24,915,088.60	0.15
40	110084	贵燃转债	24,267,924.96	0.14
41	127102	浙建转债	24,215,561.63	0.14
42	111017	蓝天转债	23,389,887.81	0.14
43	111018	华康转债	23,302,568.63	0.14
44	118022	锂科转债	22,570,294.62	0.13
45	110085	通 22 转债	18,530,136.32	0.11
46	127084	柳工转 2	18,515,131.25	0.11
47	113677	华懋转债	17,675,022.33	0.11
48	127046	百润转债	17,575,167.85	0.10
49	118024	冠宇转债	17,436,777.61	0.10
50	113627	太平转债	17,318,438.32	0.10
51	113661	福 22 转债	17,043,780.34	0.10
52	111004	明新转债	16,704,673.68	0.10
53	113652	伟 22 转债	16,610,094.16	0.10
54	113655	欧 22 转债	16,547,579.20	0.10
55	113696	伯 25 转债	16,300,700.00	0.10
56	123263	鼎捷转债	15,925,658.85	0.09
57	127111	金威转债	15,834,554.31	0.09
58	110086	精工转债	15,791,426.68	0.09
59	127054	双箭转债	15,482,293.75	0.09
60	123187	超达转债	14,940,311.62	0.09
61	123149	通裕转债	14,725,240.69	0.09
62	111009	盛泰转债	14,514,447.95	0.09
63	123194	百洋转债	14,405,932.11	0.09
64	113659	莱克转债	14,339,263.55	0.09
65	123144	裕兴转债	12,984,926.60	0.08
66	113667	春 23 转债	12,487,508.35	0.07
67	127027	能化转债	12,020,774.46	0.07
68	127061	美锦转债	11,769,987.99	0.07
69	127095	广泰转债	11,594,224.30	0.07
70	113695	华辰转债	11,107,167.43	0.07
71	128129	青农转债	10,611,756.00	0.06
72	110097	天润转债	9,737,953.97	0.06
73	113037	紫银转债	8,946,423.37	0.05
74	123251	华医转债	8,812,234.26	0.05
75	132026	G 三峡 EB2	8,756,127.12	0.05

76	113658	密卫转债	8,234,513.05	0.05
77	123171	共同转债	8,060,930.49	0.05
78	127078	优彩转债	7,972,028.65	0.05
79	123122	富瀚转债	7,841,662.16	0.05
80	111020	合顺转债	7,794,089.69	0.05
81	123119	康泰转 2	7,727,627.94	0.05
82	123154	火星转债	7,656,353.64	0.05
83	123165	回天转债	7,629,554.17	0.05
84	113650	博 22 转债	7,591,009.20	0.05
85	123172	漱玉转债	7,538,716.37	0.04
86	113648	巨星转债	7,527,066.30	0.04
87	111015	东亚转债	7,525,784.90	0.04
88	110095	双良转债	7,506,215.16	0.04
89	113640	苏利转债	7,466,973.03	0.04
90	123183	海顺转债	7,464,972.33	0.04
91	118042	奥维转债	7,461,122.99	0.04
92	123150	九强转债	7,447,415.90	0.04
93	127062	垒知转债	7,412,762.50	0.04
94	113679	芯能转债	7,390,497.90	0.04
95	113059	福莱转债	7,364,968.89	0.04
96	127060	湘佳转债	7,334,771.76	0.04
97	123180	浙矿转债	7,329,031.10	0.04
98	127044	蒙娜转债	7,318,610.85	0.04
99	123155	中陆转债	7,244,514.60	0.04
100	123189	晓鸣转债	7,233,241.83	0.04
101	113665	汇通转债	7,204,957.94	0.04
102	123215	铭利转债	7,185,301.41	0.04
103	123253	永贵转债	7,007,309.65	0.04
104	113636	甬金转债	6,934,305.60	0.04
105	110076	华海转债	6,860,302.62	0.04
106	111021	奥锐转债	6,651,452.22	0.04
107	128128	齐翔转 2	6,457,488.54	0.04
108	123224	宇邦转债	6,380,957.08	0.04
109	123243	严牌转债	6,293,763.22	0.04
110	113066	平煤转债	5,963,194.71	0.04
111	113686	泰瑞转债	5,775,590.03	0.03
112	123252	银邦转债	5,658,136.99	0.03
113	113605	大参转债	5,565,454.77	0.03
114	123225	翔丰转债	5,336,537.06	0.03
115	113682	益丰转债	5,288,411.31	0.03
116	111002	特纸转债	4,982,011.92	0.03
117	110073	国投转债	3,765,728.53	0.02
118	128135	洽洽转债	3,089,559.33	0.02
119	123188	水羊转债	2,765,441.61	0.02

120	118051	皓元转债	2,671,424.24	0.02
121	113673	岱美转债	2,219,384.87	0.01
122	110075	南航转债	1,025,557.95	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	300666	江丰电子	69,502,687.80	0.41	非公开发行流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
易方达安心回报 债券 A	154,358	38,514.21	2,722,139,455.86	45.79%	3,222,836,695.06	54.21%
易方达安心回报 债券 B	34,272	29,563.70	243,960,066.79	24.08%	769,247,068.86	75.92%
合计	188,630	36,888.00	2,966,099,522.65	42.63%	3,992,083,763.92	57.37%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达安心回报债券 A	2,503,355.51	0.0421%
	易方达安心回报债券 B	147,819.42	0.0146%
	合计	2,651,174.93	0.0381%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人	易方达安心回报债券 A	10~50
	易方达安心回报债券 B	0

持有本开放式基金	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达安心回报债券 A	50~100
	易方达安心回报债券 B	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
基金合同生效日（2011 年 6 月 21 日）基金份额总额	476,546,478.86	1,313,683,053.68
本报告期期初基金份额总额	4,301,999,454.61	644,862,811.02
本报告期基金总申购份额	4,553,409,689.23	867,230,428.30
减：本报告期基金总赎回份额	2,910,432,992.92	498,886,103.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	5,944,976,150.92	1,013,207,135.65

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项；本报告期内无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	168,880.71	0.00%	61.64	0.00%	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	2,278,006,629.66	50.28%	993,212.01	50.28%	-
申万宏源	1	277,565,752.86	6.13%	121,018.68	6.13%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	79,157,967.61	1.75%	34,512.88	1.75%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	502,268,441.10	11.09%	218,991.34	11.09%	-
中信建投	2	1,393,642,770.13	30.76%	607,630.13	30.76%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；

- 4) 具有较强的研究、交易服务能力;
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求,并在行业内具有较强竞争力。
- c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下:
- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	848,082,401.85	12.12%	2,955,700,000.00	5.48%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	2,190,115,227.29	31.29%	28,709,699,000.00	53.22%	-	-
申万宏源	915,670,555.59	13.08%	3,869,000,000.00	7.17%	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	477,437,164.92	6.82%	1,459,400,000.00	2.71%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	1,164,460,873.83	16.64%	830,776,000.00	1.54%	-	-
中信建投	1,403,679,477.76	20.05%	16,120,756,000.00	29.88%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日
----	------	--------	-------

			期
1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-01-08
3	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	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	2026-01-15
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2026-01-22
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配北汽蓝谷（600733）非公开发行 A 股的公告	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	2026-01-29
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配麦格米特（002851）非公开发行 A 股的公告	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	2026-01-29
7	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-02-24
8	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-03-23
9	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报	2026-03-31
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2026-04-22
12	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-04-23
13	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
14	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-05-23
15	易方达安心回报债券型证券投资基金暂停大额申购及大额转换转入业务的公告	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	2026-05-26
16	易方达基金管理有限公司关于终止中证金牛	中国证券报、基金管理人	2026-05-29

	(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
17	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	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	2026-06-03
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配江丰电子（300666）非公开发行 A 股及关联交易事项的公告	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	2026-06-13
19	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-06-23
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配拓荆科技（688072）非公开发行 A 股的公告	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	2026-06-25
21	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	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	2026-06-27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达安心回报债券型证券投资基金募集的文件；
- 2.《易方达安心回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达安心回报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

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日