易方达安嘉 30 天持有期债券型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§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约定，于 2026 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达安嘉 30 天持有债券
基金主代码	020040
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 27 日
报告期末基金份额总额	238,150,142.31 份
投资目标	本基金在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	1、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。2、本基金将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率和融资成本，判断利差空间，适当运用杠杆方式来获取主动管理回报。3、本基金根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平和预

	期波动率水平，并据此制定和调整资产配置策略。本基金将在法律法规和基金合同允许的范围内，以控制组合波动，谋求基金资产稳健增值为目标确定和调整银行存款、同业存单的投资比例。4、本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的风险等。5、本基金将综合考虑债券的信用风险、信用衍生品的价格及流动性情况、信用衍生品创设机构的财务状况、偿付能力等因素，审慎开展信用衍生品投资。	
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×85%+银行活期存款利率（税后）×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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达安嘉 30 天持有债券 A	易方达安嘉 30 天持有债券 C
下属分级基金的交易代码	020040	020041
报告期末下属分级基金的份额总额	146,498,197.09 份	91,651,945.22 份

§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

	(2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)	
	易方达安嘉 30 天持有债券 A	易方达安嘉 30 天持有债券 C
1.本期已实现收益	1,431,826.23	602,414.39
2.本期利润	1,616,069.37	671,247.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0117	0.0110
4.期末基金资产净值	155,993,466.40	97,048,253.25
5.期末基金份额净值	1.0648	1.0589

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

易方达安嘉 30 天持有债券 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	1.11%	0.04%	0.46%	0.03%	0.65%	0.01%
过去六个月	1.59%	0.03%	1.00%	0.03%	0.59%	0.00%
过去一年	2.45%	0.03%	1.31%	0.03%	1.14%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.48%	0.02%	4.35%	0.07%	2.13%	-0.05%

易方达安嘉 30 天持有债券 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
过去三个月	1.07%	0.04%	0.46%	0.03%	0.61%	0.01%
过去六个月	1.50%	0.03%	1.00%	0.03%	0.50%	0.00%
过去一年	2.26%	0.03%	1.31%	0.03%	0.95%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	5.89%	0.02%	4.35%	0.07%	1.54%	-0.05%

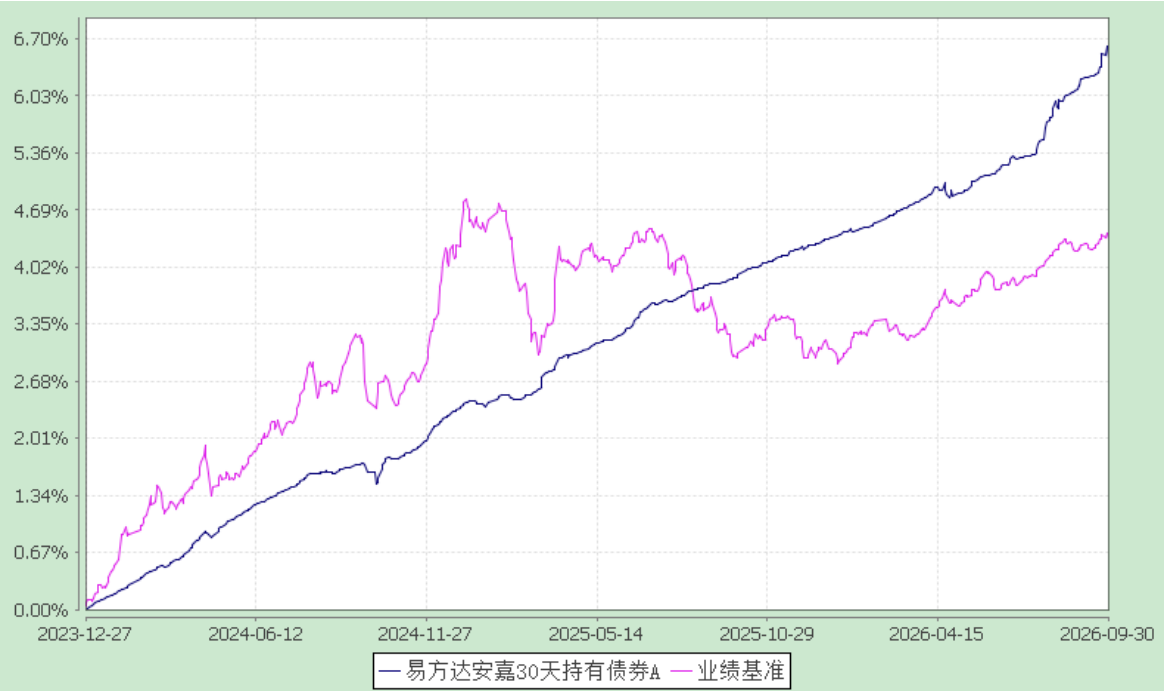
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达安嘉 30 天持有期债券型证券投资基金

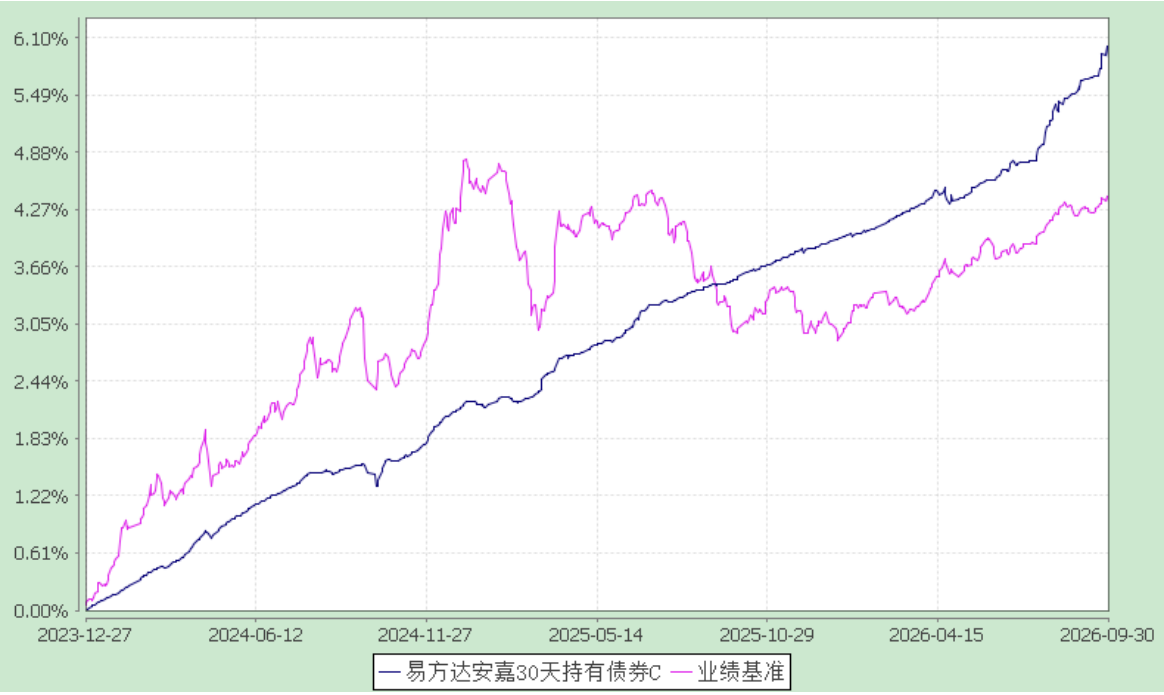
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2023 年 12 月 27 日至 2026 年 9 月 30 日）

易方达安嘉 30 天持有债券 A



易方达安嘉 30 天持有债券 C



§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		
石大怿	本基金的基金经理，易方达天天理财货币、易方达货币、易方达易理财货币、易方达现金增利货币、易方达天天发货币、易方达安瑞短债债券、易方达安益 90 天持有债券的基金经理	2023-12-27	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员，易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、基金经理助理，易方达月月利理财债券、易方达双月利理财债券、易方达保证金货币、易方达财富快线货币、易方达天天增利货币、易方达龙宝货币、易方达掌柜季季盈理财债券、易方达稳悦 120 天滚动短债的基金经理。
王丹	本基金的基金经理，易方达高等级信用债债券、易	2024-12-11	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任海通证券股份有

	方达裕祥回报债券、易方达恒兴 3 个月定开债券的基金经理，易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达投资级信用债债券、易方达安瑞短债债券、易方达增强回报债券、易方达安泽 180 天持有债券、易方达恒利 3 个月定开债券的基金经理助理				限公司研究员，远大物产集团有限公司投资经理助理，富国基金管理有限公司研究员、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，“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，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 62 次，其中 59 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，3 次为不同投资经理管理的组合因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资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

2026 年三季度，国内经济延续弱修复格局，结构分化明显：上半年 GDP 同比增长 4.7%，其中二季度增长 4.3%，生产端保持韧性而内需依然偏弱，政策主线延续“反内卷”与稳增长并重。PPI 同比涨幅由 7 月的 3.5%扩大至 8 月的 3.8%，国际原油、有色等大宗商品涨价的输入性因素叠加“反内卷”下的上游供给约束，煤炭、有色行业价格同比分别上涨 26.6%和 20.8%，对企业盈利形成支撑，1-8 月规模以上工业企业利润总额累计同比增长 15.7%。制造业 PMI 自 7 月 49.2%、8 月 49.8%连续回升，9 月升至 50.1%，重回扩张区间，企业景气与盈利预期同步改善。通胀温和回升，8 月 CPI 同比上涨 0.8%，核心 CPI 回升至 1.0%。投资端仍是主要拖累，1-8 月固定资产投资同比下降 7.2%，其中房地产开发投资下降 19.9%，地产调整延续，但二手房成交保持增长、房价降幅有所收窄。消费修复偏慢，1-8 月社会消费品零售总额同比增长 1.1%，8 月当月同比仅增长 0.4%，商品消费偏弱、服务消费相对较好。展望四季度，出口韧性（8 月进出口同比增长 19.8%）与价格修复仍是主要支撑，重点关注四季度重要会议对明年政策基调的定调及地产、消费领域增量政策落地。海外方面，美联储 9 月 16 日加息 25 个基点，利率目标区间升至 3.75%—4.00%，为 2023 年 7 月以来首次加息，10 年期美债收益率上行至 5%上方，海外流动性边际收紧。国内货币政策保持稳健，7 天逆回购利率维持在 1.40%不变，资金面整体平稳。三季度债市收益率整体下行、曲线平坦化：10 年期国债收益率由季初 1.73%下行约 5bp 至季末 1.68%，1 年期品种收益率上行约 10bp，1 年期 AAA 评级同业存单利率大体运行于 1.40%-1.50%区间，债券市场的信用利差在三季度继续收窄。

操作方面，报告期内本基金以剩余期限一年以内的高等级信用债和同业存单为主要配置资产，并积极运用国债期货工具管理利率风险，保持了中等的剩余期限和中等的杠杆率。总体来看本基金在三季度取得了较好的收益。

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 1.0648 元，本报告期份额净值增长率为 1.11%，同期业绩比较基准收益率为 0.46%；C 类基金份额净值为 1.0589 元，本报告期份额净值增长率为 1.07%，同期业绩比较基准收益率为 0.46%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	268,571,195.29	94.38
	其中：债券	268,571,195.29	94.38
	资产支持证券	-	-
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	15,391,736.50	5.41
7	其他资产	597,898.41	0.21
8	合计	284,560,830.20	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	51,554,895.56	20.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	45,820,824.93	18.11
	其中：政策性金融债	20,351,715.07	8.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	148,587,086.31	58.72
6	中期票据	22,608,388.49	8.93
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	268,571,195.29	106.14

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	220208	22 国开 08	200,000	20,351,715.07	8.04
2	012681115	26 国能资本 SCP002	200,000	20,124,295.89	7.95
3	012681906	26 大唐发电 SCP009	200,000	20,049,605.48	7.92
4	2420021	24 南京银行 01	150,000	15,191,027.67	6.00
5	012681312	26 南航股 SCP011	150,000	15,067,532.05	5.95

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，主要选择流动性好的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的利率风险。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-3,871.51
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行交易。本基金力争通过国债期货的交易，降低组合债券持仓调整的交易成本，增加组合的灵活性，对冲潜在风险。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

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，大唐国际发电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到唐山市生态环境局开平区分局的处罚。中国南方航空股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国民用航空中南地区管理局的处罚。中国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。

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

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	597,898.41
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	597,898.41

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达安嘉30天持有债券A	易方达安嘉30天持有债券C
报告期期初基金份额总额	140,951,176.81	47,094,600.88
报告期期间基金总申购份额	26,536,960.83	52,515,394.43
减：报告期期间基金总赎回份额	20,989,940.55	7,958,050.09
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	146,498,197.09	91,651,945.22

§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

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。

§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安嘉 30 天持有期债券型证券投资基金注册的文件；

2.《易方达安嘉 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》；

3.《易方达安嘉 30 天持有期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。

9.2存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

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

二〇二六年十月二十七日