

易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金

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	易方达恒盛 3 个月定开混合发起式
基金主代码	007884
交易代码	007884
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 6 日
报告期末基金份额总额	1,552,425,227.26 份
投资目标	在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭运作期与开放运作期采取不同的投资策略。封闭期本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场因素、估值及流动性因素、政策因素等分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。债券投资上主要通过久期配置、

	<p>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。股票方面本基金将通过分析行业景气度、行业竞争格局等因素，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置的基础上，本基金将基于公司基本面分析和估值水平分析进行个股投资策略。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。开放运作期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
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	中国银行股份有限公司

§ 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1月1日-2024年3月31日)
1.本期已实现收益	35,633,757.31
2.本期利润	47,699,824.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0307
4.期末基金资产净值	1,691,049,661.85

5.期末基金份额净值	1.0893
------------	--------

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

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	2.90%	0.19%	2.12%	0.11%	0.78%	0.08%
过去六个月	3.13%	0.19%	2.68%	0.10%	0.45%	0.09%
过去一年	5.37%	0.17%	3.93%	0.09%	1.44%	0.08%
过去三年	15.22%	0.20%	9.83%	0.11%	5.39%	0.09%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	29.29%	0.19%	18.33%	0.12%	10.96%	0.07%

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

易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金
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

（2019年9月6日至2024年3月31日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 29.29%，同期业绩比较基准收益率为 18.33%。

§ 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		
胡剑	本基金的基金经理，易方达稳健收益债券、易方达信用债债券、易方达裕惠定开混合发起式、易方达岁丰添利债券（LOF）、易方达恒利3个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达高等级信用债债券的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员、基础设施资产管理委员会委员	2019-09-06	-	18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债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、固定收益投资业务总部总经理，易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达纯债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达纯债1年定期开放债券、易方达裕惠回报债券、易方达瑞财混合、

					易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达高等级信用债债券、易方达丰惠混合、易方达瑞富混合、易方达睿智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合、易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达富惠纯债债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达恒惠定开债券发起式、易方达科润混合（LOF）的基金经理。
纪玲云	本基金的基金经理，易方达信用债债券、易方达瑞财混合、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒裕一年定开债券发起式、易方达裕华利率债 3 个月定开债券、易方达裕兴 3 个月定开债券、易方达恒固 18 个月封闭式债券、易方达兴利 180 天持有债券的基金经理，易方达稳健收益债券的基金经理助理，固定收益分类资产研究管理部总经理	2019-09-06	-	15 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、投资经理助理、固定收益研究部总经理助理、固定收益分类资产研究管理部负责人、投资经理，易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达科润混合（LOF）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

一季度经济基本面数据出现较为显著的恢复，主要体现在以下几个方面。首先，全球总需求的恢复较好地支撑了中国的出口。1-2月份的出口数据延续了2023年11月份以来的回升，劳动密集型产品是主要的贡献力量，全球电子周期的回升提振了这一趋势。其次，财政发力效果逐步显现。得益于去年四季度大量的政府债券发行，今年1-2月份财政支出加速，制造业投资与基建投资维持在历史较高水平。第三，春节假期旅游的火爆带动了社会消费品零售总额回升。第四，与需求端相比，生产端的恢复更为显著。1-2月份工业增加值的环比数据达到历史同期最高水平，其中劳动密集型、食品饮料和上游冶炼化工等制造业生产回升幅度最大。然而，回升的经济数据并未大幅改善微观市场的预期。一方面房地产市场的销售并未出现实质性改善，不少城市仍然处于价格下滑的压力中。另一方面，生产比需求恢复程度更高使得不少微观产品的价格依然疲软。

政策面基本保持了平稳。财政延续“开前门、堵后门”的方向，虽然部分地区的基建投资受到化解地方债务政策的影响，但中央项目的加快推进使得基建投资

整体依然保持高位。货币政策则继续保持稳健，在引导实际融资成本下行的同时，保持短端资金利率中枢水平稳定。

从债券市场的表现来看，大部分品种的收益率出现 20-40BP 的下行。其中有静态收益、长久期的品种下行更多，譬如 30 年期国债收益率下行 37BP，10 年期 AAA-二级资本债品种收益率下行 48BP，3 年期 AA-城投收益率下行 141BP。从下行节奏上看，1-2 月份收益率基本呈现单边下行状态，3 月份之后表现为 10BP 以内的窄幅振荡。权益市场振荡筑底，结构分化。沪深 300 指数上涨 3.1%，但创业板指数仍然下跌 3.87%。行业方面，银行、石油石化、煤炭、家用电器等行业上涨超过 10%，但医药生物、计算机、电子、综合行业依然下跌 10% 以上。可转债指数先跌后涨，整体下行 0.81%。

操作上，债券方面组合在 1-2 月份保持了偏高的有效久期，在 3 月之后跟随收益率下行逐步降低久期风险敞口。权益方面，组合保持了相对中性的股票仓位，但是跟随市场下跌自 2 月份开始逐步增加了可转债的配置比例，带来了较好的收益增厚。组合在一季度延续了绝对收益的操作思路，净值平稳增长，获取了有竞争力的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0893 元，本报告期份额净值增长率为 2.90%，同期业绩比较基准收益率为 2.12%。

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	164,309,736.31	5.85
	其中：股票	164,309,736.31	5.85
2	固定收益投资	2,603,368,995.95	92.72

	其中：债券	2,531,172,107.13	90.15
	资产支持证券	72,196,888.82	2.57
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	36,332,465.54	1.29
7	其他资产	3,704,841.89	0.13
8	合计	2,807,716,039.69	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	4,044,535.80	0.24
B	采矿业	5,625,051.00	0.33
C	制造业	112,594,196.09	6.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,657,855.00	0.10
F	批发和零售业	16,474.92	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	24,054,422.45	1.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,781,625.46	0.46
J	金融业	2,373,784.00	0.14
K	房地产业	1,340,612.00	0.08
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	4,802,218.61	0.28
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	164,309,736.31	9.72

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	002472	双环传动	471,400	10,903,482.00	0.64
2	600873	梅花生物	665,300	6,852,590.00	0.41
3	600660	福耀玻璃	154,600	6,687,996.00	0.40
4	600150	中国船舶	174,796	6,467,452.00	0.38
5	601298	青岛港	875,100	6,466,989.00	0.38
6	600685	中船防务	242,500	6,302,575.00	0.37
7	002920	德赛西威	47,100	5,864,421.00	0.35
8	601088	中国神华	143,900	5,625,051.00	0.33
9	601799	星宇股份	39,800	5,574,388.00	0.33
10	600018	上港集团	1,022,400	5,490,288.00	0.32

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	725,850,079.19	42.92
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	451,142,177.95	26.68
5	企业短期融资券	205,074,019.41	12.13
6	中期票据	813,997,662.18	48.14
7	可转债（可交换债）	335,108,168.40	19.82
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	2,531,172,107.13	149.68

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	240506	24 招证 G1	800,000	80,838,720.00	4.78
2	092280065	22 工行二级资本债 03A	600,000	61,999,226.23	3.67
3	2128042	21 兴业银行二级 02	500,000	52,001,404.37	3.08
4	232380088	23 苏州银行二级 01	500,000	51,715,131.15	3.06
5	282380005	23 太平人寿永续债 01	500,000	51,437,868.85	3.04

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	199694	G23XH 优	200,000	20,930,654.25	1.24
2	199272	23 北辰 A	200,000	20,710,657.53	1.22
3	260418	G 黄河优	100,000	10,259,453.70	0.61
4	193933	和皖 A	100,000	10,193,068.54	0.60
5	199430	23 济建优	100,000	10,103,054.80	0.60

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
T2406	T2406	-100	-104,060,000.00	-69,700.00	交易期内组合利用国债期货头寸调整组合有效久期和期限结构分布情况，对冲收益率变动和期限利差变动的风险。
公允价值变动总额合计（元）					-69,700.00
国债期货投资本期收益（元）					-314,576.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					269,800.00

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，太平人寿保险有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行上海分行的处罚。兖矿能源集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家矿山安全监察局山东局、济宁市城乡水务局、济宁市能源局、邹城市交通运输局、邹城市消防救援大队的处罚。

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	2,182,469.79
2	应收证券清算款	1,522,372.10
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,704,841.89

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	113651	松霖转债	6,135,085.86	0.36
2	113669	景23转债	6,009,850.59	0.36
3	111000	起帆转债	5,995,114.77	0.35
4	113051	节能转债	5,983,456.57	0.35
5	123171	共同转债	5,940,577.85	0.35
6	113632	鹤21转债	5,801,038.17	0.34
7	110085	通22转债	5,572,517.15	0.33
8	118000	嘉元转债	5,046,200.57	0.30
9	127039	北港转债	4,527,408.77	0.27
10	123196	正元转02	4,389,797.25	0.26
11	123107	温氏转债	4,317,411.31	0.26
12	118030	睿创转债	4,265,466.32	0.25
13	128121	宏川转债	3,969,116.63	0.23
14	118042	奥维转债	3,968,191.99	0.23
15	113631	皖天转债	3,941,271.32	0.23
16	128081	海亮转债	3,655,674.32	0.22
17	123190	道氏转02	3,526,726.99	0.21
18	128066	亚泰转债	3,493,849.67	0.21
19	113062	常银转债	3,412,636.59	0.20
20	110079	杭银转债	3,336,337.77	0.20
21	113602	景20转债	3,254,882.65	0.19
22	113656	嘉诚转债	3,240,501.72	0.19
23	123157	科蓝转债	3,146,484.36	0.19

24	127061	美锦转债	3,102,810.83	0.18
25	127045	牧原转债	3,098,946.81	0.18
26	110094	众和转债	3,088,704.63	0.18
27	127088	赫达转债	3,046,749.07	0.18
28	113623	凤 21 转债	2,970,868.77	0.18
29	111012	福新转债	2,917,808.19	0.17
30	123219	宇瞳转债	2,867,477.89	0.17
31	127082	亚科转债	2,850,180.94	0.17
32	113058	友发转债	2,638,222.51	0.16
33	123187	超达转债	2,625,477.28	0.16
34	128132	交建转债	2,618,407.96	0.15
35	118003	华兴转债	2,570,379.58	0.15
36	113676	荣 23 转债	2,538,020.07	0.15
37	118044	赛特转债	2,423,608.45	0.14
38	123120	隆华转债	2,419,479.58	0.14
39	113664	大元转债	2,413,640.31	0.14
40	123205	大叶转债	2,407,788.31	0.14
41	118012	微芯转债	2,358,812.45	0.14
42	127055	精装转债	2,346,484.10	0.14
43	127044	蒙娜转债	2,321,826.11	0.14
44	113644	艾迪转债	2,302,557.02	0.14
45	123204	金丹转债	2,283,548.01	0.14
46	113064	东材转债	2,208,942.11	0.13
47	118011	银微转债	2,200,036.60	0.13
48	111008	沿浦转债	2,173,625.24	0.13
49	123184	天阳转债	2,145,255.82	0.13
50	123212	立中转债	2,136,097.00	0.13
51	123172	漱玉转债	2,126,028.42	0.13
52	113065	齐鲁转债	2,102,391.93	0.12
53	123217	富仕转债	2,101,701.71	0.12
54	111014	李子转债	2,094,960.16	0.12
55	127030	盛虹转债	2,077,242.41	0.12
56	123185	能辉转债	2,075,288.07	0.12
57	110093	神马转债	2,074,164.28	0.12
58	123208	孩王转债	2,058,010.99	0.12
59	123165	回天转债	2,046,337.78	0.12
60	123151	康医转债	2,043,659.43	0.12
61	111004	明新转债	2,041,714.01	0.12
62	113055	成银转债	2,040,873.50	0.12
63	127042	嘉美转债	2,035,901.64	0.12
64	113045	环旭转债	2,029,861.91	0.12
65	110089	兴发转债	2,022,657.73	0.12
66	123126	瑞丰转债	2,022,217.96	0.12

67	128130	景兴转债	2,021,641.35	0.12
68	113673	岱美转债	2,019,545.51	0.12
69	113675	新23转债	2,017,291.84	0.12
70	127040	国泰转债	2,009,637.17	0.12
71	127052	西子转债	2,008,365.30	0.12
72	127027	能化转债	2,006,022.49	0.12
73	113653	永22转债	2,005,363.06	0.12
74	123063	大禹转债	2,003,123.71	0.12
75	118013	道通转债	1,995,798.80	0.12
76	127076	中宠转2	1,981,108.98	0.12
77	127068	顺博转债	1,979,416.30	0.12
78	123146	中环转2	1,977,591.83	0.12
79	123049	维尔转债	1,977,322.13	0.12
80	113640	苏利转债	1,971,319.54	0.12
81	111009	盛泰转债	1,963,977.28	0.12
82	118029	富淼转债	1,953,597.74	0.12
83	123160	泰福转债	1,940,330.15	0.11
84	123202	祥源转债	1,882,930.40	0.11
85	113628	晨丰转债	1,881,922.95	0.11
86	128105	长集转债	1,861,563.60	0.11
87	128141	旺能转债	1,816,797.15	0.11
88	123162	东杰转债	1,803,663.60	0.11
89	111011	冠盛转债	1,778,768.96	0.11
90	127075	百川转2	1,769,913.33	0.10
91	113067	燃23转债	1,709,711.81	0.10
92	123216	科顺转债	1,663,672.55	0.10
93	127053	豪美转债	1,636,839.20	0.10
94	123221	力诺转债	1,577,978.20	0.09
95	128127	文科转债	1,523,137.86	0.09
96	118020	芳源转债	1,520,866.71	0.09
97	127083	山路转债	1,520,027.48	0.09
98	123131	奥飞转债	1,511,553.69	0.09
99	113597	佳力转债	1,502,420.55	0.09
100	111015	东亚转债	1,501,029.35	0.09
101	113608	威派转债	1,330,009.99	0.08
102	123173	恒锋转债	1,187,743.55	0.07
103	128049	华源转债	1,182,201.73	0.07
104	113610	灵康转债	1,151,933.67	0.07
105	127069	小熊转债	1,095,135.40	0.06
106	113649	丰山转债	1,076,340.98	0.06
107	110095	双良转债	1,062,480.56	0.06
108	118023	广大转债	1,024,086.54	0.06
109	113059	福莱转债	902,425.32	0.05

110	113629	泉峰转债	895,277.80	0.05
111	111003	聚合转债	841,675.70	0.05
112	113668	鹿山转债	831,610.89	0.05
113	127049	希望转2	781,061.77	0.05
114	110087	天业转债	744,239.30	0.04
115	123076	强力转债	731,669.65	0.04
116	127066	科利转债	724,160.66	0.04
117	127091	科数转债	698,728.19	0.04
118	123215	铭利转债	695,698.34	0.04
119	123183	海顺转债	685,032.77	0.04
120	123211	阳谷转债	674,444.93	0.04
121	113627	太平转债	644,307.39	0.04
122	123091	长海转债	643,631.38	0.04
123	123149	通裕转债	618,715.32	0.04
124	127085	韵达转债	611,308.24	0.04
125	118006	阿拉转债	608,023.87	0.04
126	127078	优彩转债	601,364.65	0.04
127	123193	海能转债	600,459.63	0.04
128	127043	川恒转债	596,021.56	0.04
129	113665	汇通转债	584,506.34	0.03
130	110064	建工转债	573,039.56	0.03
131	113662	豪能转债	564,738.69	0.03
132	123186	志特转债	554,204.27	0.03
133	123147	中辰转债	535,462.51	0.03
134	128083	新北转债	496,872.60	0.03
135	118040	宏微转债	488,293.00	0.03
136	127015	希望转债	476,158.23	0.03
137	123178	花园转债	473,768.56	0.03
138	113677	华懋转债	472,503.82	0.03
139	113048	晶科转债	466,207.91	0.03
140	118043	福立转债	442,098.41	0.03
141	113549	白电转债	440,336.99	0.03
142	118032	建龙转债	439,086.86	0.03
143	118026	利元转债	437,917.23	0.03
144	123170	南电转债	428,084.34	0.03
145	118038	金宏转债	424,500.66	0.03
146	113637	华翔转债	423,618.46	0.03
147	118033	华特转债	405,732.53	0.02
148	123163	金沃转债	376,860.74	0.02
149	123082	北陆转债	360,979.74	0.02
150	118019	金盘转债	358,888.97	0.02
151	128128	齐翔转2	358,680.35	0.02
152	123119	康泰转2	353,095.58	0.02

153	127070	大中转债	351,685.91	0.02
154	123152	润禾转债	339,760.64	0.02
155	113068	金铜转债	334,819.91	0.02
156	127071	天箭转债	330,074.42	0.02
157	123121	帝尔转债	317,945.54	0.02
158	118009	华锐转债	303,780.21	0.02
159	113639	华正转债	299,368.58	0.02
160	123072	乐歌转债	297,717.10	0.02
161	127007	湖广转债	285,445.07	0.02
162	123220	易瑞转债	276,819.46	0.02
163	113619	世运转债	268,321.87	0.02
164	127019	国城转债	248,686.75	0.01
165	123144	裕兴转债	234,601.38	0.01
166	111001	山玻转债	222,205.43	0.01
167	123124	晶瑞转2	218,479.36	0.01
168	113600	新星转债	213,010.94	0.01
169	123175	百畅转债	195,394.39	0.01
170	113643	风语转债	190,906.30	0.01
171	123103	震安转债	183,827.90	0.01
172	127087	星帅转2	181,356.17	0.01
173	123085	万顺转2	168,506.45	0.01
174	118027	宏图转债	166,316.22	0.01
175	113030	东风转债	164,979.35	0.01
176	111002	特纸转债	150,469.43	0.01
177	118036	力合转债	148,829.84	0.01
178	123087	明电转债	101,764.18	0.01
179	123166	蒙泰转债	65,376.72	0.00
180	123158	宙邦转债	18,400.79	0.00
181	123108	乐普转2	5,223.83	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

报告期期初基金份额总额	1,552,425,262.04
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	34.78
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	1,552,425,227.26

§ 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	10,000,000.00	0.6442%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	10,000,000.00	0.6442%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满3年，发起份额已全部赎回。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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01月01日~2024年03月31日	797,225,069.17	0.00	0.00	797,225,069.17	51.35%
	2	2024年01月01日~2024年03月31日	752,199,970.54	0.00	0.00	752,199,970.54	48.45%
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；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，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；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，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，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权终止基金合同；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>							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、定期开放运作的风险

(1) 本基金以定期开放方式运作且不上市交易，投资者仅可在开放运作期申赎基金份额，在封闭运作期内无法申购赎回。若投资者在开放运作期末赎回基金份额，则需继续持有至下一封闭运作期结束才能赎回，投资者在封闭运作期内存在无法赎回基金份额的风险。

(2) 基金合同生效后的首个运作期为封闭运作期，自基金合同生效日至基金管理人规定的时间，首个封闭运作期可能少于或者超过3个月，投资者应仔细阅读相关法律文件及公告，并及时行使相关权利。

(3) 除首个运作期封闭运作外，本基金的运作期包含“封闭运作期”和“开放运作期”，运作期期限3个月，基金管理人在每个封闭运作期结束前公布开放运作期和下一封闭运作期的具体时间安排，由于市场环境等因素的影响，本基金每次开放运作期和封闭运作期的时间及长度不完全一样，投资者应关注相关公告并及时行使权利，否则会面临无法申购/赎回基金份额的风险。

2、单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可达到或者超过50%的风险

(1) 本基金单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者持有基金份额可

达到或者超过 50%，单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者大额赎回时，可能会对本基金资产运作及净值表现产生较大影响。

（2）巨额赎回的风险

相对于其他基金，本基金更可能因开放期内单一投资者或者构成一致行动人的多个投资者集中大额赎回发生巨额赎回。当发生巨额赎回时，基金管理人可能根据基金当时的资产组合状况决定延缓支付赎回款，投资者面临赎回款被延缓支付的风险。

3、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同的风险

本基金的销售对象主要为机构投资者，不向个人投资者公开发售，基金持续营销可能受到影响。本基金基金合同生效满三年后继续存续的，若连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于 5000 万元情形，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并等，并召开基金份额持有人大会进行表决。投资者面临转换基金运作方式、与其他基金合并的风险。

《基金合同》生效满三年后的存续期内，若连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元，经与基金托管人协商一致，基金管理人有权终止基金合同。若管理人与托管人根据实际情况决定终止基金合同，本基金面临终止清盘的风险。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式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。

10.2 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。

10.3 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