

易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金

2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 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：二〇二四年一月十九日

§ 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 1 月 17 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 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	1,552,425,262.04 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
	(2023年10月1日-2023年12月31日)
1.本期已实现收益	-8,765,203.20
2.本期利润	4,045,901.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0026
4.期末基金资产净值	1,643,349,873.84

5.期末基金份额净值	1.0586
------------	--------

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	0.23%	0.19%	0.54%	0.09%	-0.31%	0.10%
过去六个月	0.89%	0.17%	0.77%	0.09%	0.12%	0.08%
过去一年	6.51%	0.18%	3.12%	0.09%	3.39%	0.09%
过去三年	14.49%	0.19%	8.13%	0.12%	6.36%	0.07%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	25.64%	0.19%	15.87%	0.12%	9.77%	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2023年12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 25.64%，同期业绩比较基准收益率为 15.87%。

§ 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	-	17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	-	14 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合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共12次，其中11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，1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

经济基本面四季度并未延续第三季度的回升势头，边际动能有所减弱，整体呈现弱势振荡格局。结构上看，基建投资和制造业投资是支撑经济的主要需求侧因素，其中制造业投资表现更好一些。社会消费品零售总额数据表现较为中性，但逐月有所走低。地产数据则维持偏弱的水平。外需方面，年底受全球制造业周期回升、电子周期回升和圣诞季购物需求增加的影响，出口在10月份数据下滑后于11月份有所抬升，但是向上的弹性较为有限。

经济整体表现为需求相对不足的情况。我们认为主要来自几个方面的影响。第一，在行业仍处于下行周期的阶段，地产及其上下游产业链需求的下滑尚未找到可以替代的增长动能。第二，在逆全球化的大背景下，外需对国内经济的提振作用较为有限。第三，部分中端制造业处于投资相对过剩的状态，这使得经济向上的弹性较低。

政策方面，四季度财政部大幅增加了地方政府债和国债的发行，在防范化解地方政府债务风险和“宽财政”方面有比较明显的发力，但目前看对经济的刺激作用尚待观察。货币政策保持了相对稳健的风格，大量政府债券的发行导致银行间

资金面紧张，中短端债券收益率一度出现明显抬升。

四季度债券收益率先上后下，整体下行。债券市场主要表现为两个特点，一是平坦化。具体来看，四季度初至年底，1年期国开债收益率下行3BP，2-10年国开债收益率下行5-10BP，20年国开债和30年国债收益率分别下行16BP和17BP。中长期的信用债券同样出现利差平坦化压缩的情况，3-10年的AAA信用债券收益率下行16-20BP。4-10年的二级资本债收益率下行幅度在20BP以上。二是城投利差的大幅度压缩，尤其是低等级城投主体。四季度初至年底，2-3年AA(2)城投收益率下行25-45BP，1年AA(-)城投收益率下行56BP，2年AA(-)城投收益率下行幅度高达127BP。

权益市场继续震荡下跌。四季度沪深300指数下跌7%，创业板指数下跌5.62%。行业方面，煤炭、电子、农林牧渔、综合行业表现相对较好，上涨0-4%，而美容护理、地产、建筑材料等行业下跌较大，跌幅达到14%以上。可转债年底波动也相对较大，四季度中证转债指数下跌3.22%。

组合延续了获取绝对收益的操作思路，在11月下旬大幅降低了股票和可转债的仓位，有效降低了组合净值的波动。在降低权益仓位的同时，组合提升了债券部分的仓位和久期，在后续收益率下行环境下获取了较好的资本利得收益。总体看在面临大幅下跌的市场环境下，组合积极操作，较好地控制了回撤和波动风险，在四季度依然保持了组合净值的正增长。

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1.0586元，本报告期份额净值增长率为0.23%，同期业绩比较基准收益率为0.54%。

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	155,902,126.88	6.20
	其中：股票	155,902,126.88	6.20
2	固定收益投资	2,338,693,725.72	93.03
	其中：债券	2,257,262,692.02	89.79
	资产支持证券	81,431,033.70	3.24
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	10,762,566.63	0.43
7	其他资产	8,631,582.76	0.34
8	合计	2,513,990,001.99	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	770,889.60	0.05
B	采矿业	4,511,265.00	0.27
C	制造业	101,459,227.40	6.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,930,473.00	0.12
F	批发和零售业	67,283.35	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	26,098,868.41	1.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,713,197.28	0.65
J	金融业	2,569,468.65	0.16
K	房地产业	1,550,416.00	0.09

L	租赁和商务服务业	36,981.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	6,183,987.50	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069.29	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	155,902,126.88	9.49

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	601298	青岛港	1,297,900	8,021,022.00	0.49
2	600018	上港集团	1,586,300	7,772,870.00	0.47
3	002472	双环传动	253,600	6,598,672.00	0.40
4	600873	梅花生物	665,300	6,353,615.00	0.39
5	600685	中船防务	242,500	6,195,875.00	0.38
6	600660	福耀玻璃	154,600	5,780,494.00	0.35
7	300760	迈瑞医疗	18,900	5,492,340.00	0.33
8	601728	中国电信	990,911	5,360,828.51	0.33
9	601799	星宇股份	39,800	5,218,178.00	0.32
10	600150	中国船舶	174,796	5,145,994.24	0.31

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	543,833,523.38	33.09
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	374,067,980.12	22.76

5	企业短期融资券	278,029,689.16	16.92
6	中期票据	870,132,446.95	52.95
7	可转债（可交换债）	108,184,101.60	6.58
8	同业存单	-	-
9	其他	83,014,950.81	5.05
10	合计	2,257,262,692.02	137.36

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	2128042	21 兴业银行二级 02	600,000	61,447,659.02	3.74
2	092280065	22 工行二级资本债 03A	600,000	60,822,806.56	3.70
3	232380088	23 苏州银行二级 01	500,000	50,477,983.61	3.07
4	240328	赣投 YK02	500,000	50,442,586.30	3.07
5	282380005	23 太平人寿永续债 01	500,000	50,324,672.13	3.06

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	20,635,130.96	1.26
2	199272	23 北辰 A	200,000	20,393,041.10	1.24
3	260418	G 黄河优	100,000	10,143,963.29	0.62
4	193933	和皖 A	100,000	10,120,213.96	0.62
5	199430	23 济建优	100,000	10,075,054.80	0.61
6	183148	G 国电优	100,000	10,063,629.59	0.61

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
TF2403	TF2403	-60	-61,527,000.00	-339,500.00	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）					-339,500.00
国债期货投资本期收益（元）					-216.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-339,500.00

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。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、中国银行保险监督管理委员会的处罚。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	876,144.00
2	应收证券清算款	7,755,438.76
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	8,631,582.76

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	118031	天23转债	5,706,693.41	0.35
2	118000	嘉元转债	5,154,876.26	0.31
3	123190	道氏转02	3,858,861.42	0.23
4	127061	美锦转债	3,296,766.21	0.20
5	127044	蒙娜转债	2,403,329.19	0.15
6	118020	芳源转债	1,721,461.16	0.10
7	123126	瑞丰转债	1,703,868.56	0.10
8	123049	维尔转债	1,682,630.45	0.10
9	128127	文科转债	1,634,008.33	0.10
10	123165	回天转债	1,580,888.46	0.10
11	110093	神马转债	1,516,323.96	0.09
12	113045	环旭转债	1,405,584.12	0.09
13	111009	盛泰转债	1,401,516.00	0.09
14	118011	银微转债	1,372,592.27	0.08

15	113608	威派转债	1,355,106.23	0.08
16	127075	百川转2	1,314,052.38	0.08
17	113653	永22转债	1,310,029.85	0.08
18	113610	灵康转债	1,200,819.29	0.07
19	123146	中环转2	1,184,602.88	0.07
20	118023	广大转债	1,165,337.64	0.07
21	127055	精装转债	1,159,398.29	0.07
22	118029	富淼转债	1,141,064.92	0.07
23	127083	山路转债	1,109,582.34	0.07
24	113640	苏利转债	1,065,049.22	0.06
25	127068	顺博转债	1,055,479.03	0.06
26	123131	奥飞转债	1,052,078.82	0.06
27	127052	西子转债	1,045,464.51	0.06
28	113649	丰山转债	1,025,669.95	0.06
29	123172	漱玉转债	1,023,698.56	0.06
30	127042	嘉美转债	1,003,364.88	0.06
31	113629	泉峰转债	993,803.36	0.06
32	123151	康医转债	988,810.69	0.06
33	118013	道通转债	967,182.22	0.06
34	127045	牧原转债	957,054.60	0.06
35	127027	能化转债	929,826.14	0.06
36	127040	国泰转债	910,736.09	0.06
37	113668	鹿山转债	905,551.58	0.06
38	113059	福莱转债	858,723.58	0.05
39	111014	李子转债	858,541.08	0.05
40	111003	聚合转债	856,160.91	0.05
41	127049	希望转2	788,097.03	0.05
42	113051	节能转债	773,874.84	0.05
43	128037	岩土转债	768,272.10	0.05
44	110087	天业转债	765,640.30	0.05
45	123076	强力转债	756,145.63	0.05
46	113644	艾迪转债	735,097.38	0.04
47	123183	海顺转债	725,042.12	0.04
48	127066	科利转债	722,693.66	0.04
49	127033	中装转2	681,451.90	0.04
50	123157	科蓝转债	675,479.10	0.04
51	110089	兴发转债	664,565.89	0.04
52	127078	优彩转债	663,504.44	0.04
53	113505	杭电转债	661,555.58	0.04
54	123193	海能转债	658,973.86	0.04
55	113627	太平转债	658,625.78	0.04
56	118006	阿拉转债	654,228.08	0.04
57	123162	东杰转债	648,869.22	0.04

58	123171	共同转债	646,378.39	0.04
59	123091	长海转债	644,896.77	0.04
60	113665	汇通转债	642,005.62	0.04
61	123149	通裕转债	641,637.87	0.04
62	127085	韵达转债	638,654.14	0.04
63	113662	豪能转债	620,022.14	0.04
64	123186	志特转债	610,334.55	0.04
65	110064	建工转债	574,794.37	0.03
66	123160	泰福转债	560,934.90	0.03
67	123178	花园转债	507,603.89	0.03
68	113048	晶科转债	484,734.87	0.03
69	123120	隆华转债	469,456.92	0.03
70	118033	华特转债	463,501.29	0.03
71	118032	建龙转债	460,120.96	0.03
72	123185	能辉转债	454,201.53	0.03
73	123170	南电转债	452,340.46	0.03
74	113637	华翔转债	434,511.47	0.03
75	123082	北陆转债	396,557.56	0.02
76	118003	华兴转债	378,058.67	0.02
77	123135	泰林转债	373,675.49	0.02
78	127070	大中转债	369,874.55	0.02
79	118019	金盘转债	366,392.35	0.02
80	123050	聚飞转债	362,207.20	0.02
81	123152	润禾转债	360,128.11	0.02
82	123119	康泰转2	356,447.91	0.02
83	123167	商络转债	355,790.63	0.02
84	111004	明新转债	354,712.34	0.02
85	127071	天箭转债	349,103.52	0.02
86	123121	帝尔转债	347,224.27	0.02
87	113064	东材转债	343,890.71	0.02
88	118009	华锐转债	341,733.00	0.02
89	113639	华正转债	337,150.65	0.02
90	128066	亚泰转债	334,970.48	0.02
91	113632	鹤21转债	312,231.23	0.02
92	123072	乐歌转债	312,059.96	0.02
93	127007	湖广转债	302,159.98	0.02
94	123147	中辰转债	271,297.29	0.02
95	113619	世运转债	269,073.82	0.02
96	123163	金沃转债	254,066.42	0.02
97	123144	裕兴转债	251,398.25	0.02
98	127019	国城转债	240,121.82	0.01
99	123124	晶瑞转2	238,930.15	0.01
100	113600	新星转债	233,466.51	0.01

101	111001	山玻转债	229,435.40	0.01
102	123175	百畅转债	225,272.96	0.01
103	127087	星帅转2	209,158.06	0.01
104	113643	风语转债	203,679.56	0.01
105	118027	宏图转债	193,808.01	0.01
106	123103	震安转债	190,829.19	0.01
107	123085	万顺转2	179,375.73	0.01
108	111002	特纸转债	156,708.61	0.01
109	123087	明电转债	109,866.84	0.01
110	123056	雪榕转债	98,557.15	0.01
111	123166	蒙泰转债	74,465.16	0.00
112	123184	天阳转债	41,949.86	0.00
113	123158	宙邦转债	28,489.19	0.00
114	123108	乐普转2	5,500.36	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	1,413,625,968.95
报告期期间基金总申购份额	426,944,022.77
减：报告期期间基金总赎回份额	288,144,729.68
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	1,552,425,262.04

§ 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	2023年10月01日~2023年12月31日	370,281,046.40	426,944,022.77	0.00	797,225,069.17	51.35%
	2	2023年10月01日~2023年12月31日	1,036,344,694.54	0.00	284,144,724.00	752,199,970.54	48.45%

产品特有风险

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。

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

二〇二四年一月十九日