

易方达安心回报债券型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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
报告期末基金份额总额	5,520,536,220.92 份
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

	<p>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。</p>	
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（税后）+1.0%	
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。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达安心回报债券 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	4,613,507,654.36 份	907,028,566.56 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 (2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日)	
	易方达安心回报债券 A	易方达安心回报债券 B
	1.本期已实现收益	75,028,083.11
2.本期利润	-134,710,826.72	-25,293,661.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0270	-0.0270
4.期末基金资产净值	8,600,167,418.97	1,658,286,894.04
5.期末基金份额净值	1.8641	1.8283

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达安心回报债券 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	-1.30%	0.25%	0.96%	0.01%	-2.26%	0.24%
过去六个月	-0.17%	0.24%	1.92%	0.01%	-2.09%	0.23%
过去一年	0.30%	0.26%	3.80%	0.01%	-3.50%	0.25%
过去三年	0.94%	0.37%	11.41%	0.01%	-10.47%	0.36%
过去五年	39.68%	0.45%	19.02%	0.01%	20.66%	0.44%
自基金合同生效起至今	256.48%	0.68%	55.35%	0.01%	201.13%	0.67%

易方达安心回报债券 B

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	-1.40%	0.25%	0.96%	0.01%	-2.36%	0.24%
过去六个月	-0.37%	0.24%	1.92%	0.01%	-2.29%	0.23%
过去一年	-0.10%	0.26%	3.80%	0.01%	-3.90%	0.25%
过去三年	-0.26%	0.37%	11.41%	0.01%	-11.67%	0.36%
过去五年	36.86%	0.45%	19.02%	0.01%	17.84%	0.44%
自基金合同生效起至今	241.17%	0.68%	55.35%	0.01%	185.82%	0.67%

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

易方达安心回报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
 (2011年6月21日至2023年12月31日)

易方达安心回报债券 A



易方达安心回报债券 B



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 256.48%，同期业绩比较基准收益率为 55.35%；B 类基金份额净值增长率为 241.17%，同期业绩比较基准收益率为 55.35%。

§ 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		
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，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员	2013-12-23	-	16 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，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。
--	--	--	--	--	---

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 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

国内方面，经济基本面在经历了三季度短暂的企稳改善后，四季度再度呈现疲弱态势。内需多数走弱，地产新政带动消退，地产销售和投资环比偏弱，社会消费品零售总额整体处于历史偏低水平，或反映整体就业市场低迷，同时外需走弱的压力也在边际上升。经济的拉动因素主要来自于财政政策的发力，政府实际支出回升，对制造业和基建投资回升形成支撑。考虑到年内增量财政政策将主要在 2024 年年初集中拨付使用，短期内对经济增速回升形成拉动，但中期维度考虑，地产链条持续走弱等问题仍然突出，内生性的动能不足将制约经济的向上弹性，未来需要持续关注国内财政政策和外需两个因素的边际变化。海外方面，美国 10 月增长数据整体走弱，衰退担忧上升，财政和美联储均释放鸽派信号，11 月 CPI（消费者物价指数）中商品通胀偏弱，这进一步为美联储提供了更为自由的政策空间，如果未来一段时间美国就业市场能够保持稳定，宽松的金融条件有望推动总需求温和回暖。

四季度股票市场整体震荡走弱。10 月受到美债利率快速攀升至历史新高的影响，人民币汇率压力增加，北向资金大幅流出，权益市场整体下跌。直至 10 月下旬，中央汇金增持 ETF、万亿国债增发等利好提振市场信心，股票指数有所反弹。但随着 10 月经济数据的边际走弱，市场情绪再度悲观，A 股再度回调并延续至年末。行业层面，四季度煤炭等高股息高分红防御性质板块在震荡市中有较好表现；地产链条持续走弱，房地产、建材等相关行业表现疲弱。

四季度债券收益率先上后下。影响债券市场走势的核心矛盾在于利率债供给压力增加、同时汇率压力和防范“资金空转”目标下货币政策宽松意愿有限，基本面疲弱，收益率曲线在短端利率上行的推动下，呈现极度平坦的形态。直至年末，随着利率债供给高峰过去、汇率压力缓解央行大量投放跨年资金，资金面预期改善；经济数据边际走弱、财政政策也未见大幅发力，收益率开始下行。短端利率的供需因素大幅改善，带动曲线陡峭修复。整个季度，1 年和 10 年期国债收益率分别下行 9bp 和 12bp，高等级信用利差小幅压缩。保险等长久期资金配置需求强烈，长久期信用债交投活跃度提升，超长久期利率债的期限利差亦有所压缩，30-10 年国债利差较三季度末压缩 6bp。

转债市场跟随权益市场下跌，同时因债市资金紧张和绝对收益资金止损等因素的影响估值有所压缩。结构上，偏红利的大盘转债和高波动的小盘转债持续占优，偏债型转债持续调整、YTM（到期收益率）已经上升至 10 年期国债收益率水平。条款层面，随着市场位置下行和剩余期限缩短，下修个券和选择赎回的个券不断增多，不赎回的转债承诺期限也有缩短的趋势。

报告期内，市场整体走弱，组合权益方面操作较少，主要为应对赎回被动降低持仓，主要减持银行、家电行业个券。转债方面，组合仓位略有提升，加强了中低价转债的配置，减仓了部分高价转债，组合整体绝对价格有所下降，着重配置了下修后弹性有所恢复的低价券和赎回线附近溢价率很低的个券，同时积极进行换仓，用估值偏低的新券替换组合中因正股下跌已经失去弹性的老券，维持组合的整体弹性和不对称性。债券方面，四季度以来汇率压力对银行间资金利率形成掣肘，考虑到短期内制约因素难以大幅改善，组合择机降低久期，将利率品种置换为银行次级债为代表的流动性溢价品种，提升债券部分静态收益、获取套息利差；考虑到收益率曲线平坦化、短端具备较好的配置价值，以及 2024 年信用债的供需格局相对有利，组合保持中性久期和较高的杠杆水平，以更充分应对 2024 年的市场环境。

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 1.8641 元，本报告期份额净值增长率为-1.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.96%；B 类基金份额净值为 1.8283 元，本报告期份额净值增长率为-1.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.96%。

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	1,964,141,656.77	13.76
	其中：股票	1,964,141,656.77	13.76

2	固定收益投资	12,123,045,064.64	84.94
	其中：债券	11,602,326,271.59	81.30
	资产支持证券	520,718,793.05	3.65
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	146,163,143.69	1.02
7	其他资产	38,436,734.13	0.27
8	合计	14,271,786,599.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	111,763,014.12	1.09
C	制造业	1,015,871,769.35	9.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,541,387.02	0.75
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	216,388,801.20	2.11
J	金融业	480,147,136.44	4.68
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	63,429,548.64	0.62
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	1,964,141,656.77	19.15

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	600486	扬农化工	3,837,807	242,242,377.84	2.36
2	688188	柏楚电子	854,920	216,388,801.20	2.11
3	601658	邮储银行	41,985,000	182,634,750.00	1.78
4	000858	五粮液	1,169,799	164,134,497.69	1.60
5	002304	洋河股份	1,256,010	138,035,499.00	1.35
6	600036	招商银行	4,810,400	133,825,328.00	1.30
7	600028	中国石化	20,029,214	111,763,014.12	1.09
8	002415	海康威视	3,121,725	108,386,292.00	1.06
9	600309	万华化学	1,311,788	100,771,554.16	0.98
10	300059	东方财富	6,912,879	97,056,821.16	0.95

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	5,997,422,886.43	58.46
	其中：政策性金融债	532,826,150.27	5.19
4	企业债券	405,939,456.99	3.96
5	企业短期融资券	120,875,733.33	1.18
6	中期票据	1,805,994,695.82	17.60
7	可转债（可交换债）	3,272,093,499.02	31.90

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,602,326,271.59	113.10

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	2128047	21 招商银行永续债	4,900,000	501,278,032.79	4.89
2	2228041	22 农业银行二级 01	4,200,000	434,964,393.44	4.24
3	2228006	22 中国银行二级 01	3,700,000	385,451,808.22	3.76
4	230421	23 农发 21	3,600,000	362,065,377.05	3.53
5	2128028	21 邮储银行二级 01	3,350,000	344,496,892.35	3.36

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	260418	G 黄河优	500,000	50,719,816.44	0.49
2	189847	21LJZ 优	500,000	50,362,038.36	0.49
3	156659	PR 产 1A	500,000	49,969,645.59	0.49
4	135755	22 吉电优	400,000	41,991,309.59	0.41
5	112561	22 和闽优	400,000	40,368,519.07	0.39
6	112592	G 重庆优	300,000	31,635,708.49	0.31
7	199694	G23XH 优	300,000	30,952,696.44	0.30
8	135833	铁置 1 优	300,000	30,145,315.07	0.29
9	199204	23 华兴优	300,000	29,835,318.23	0.29
10	199670	23 中公 1A	200,000	20,193,857.53	0.20

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，大秦铁路股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到西安铁路监督管理局的处罚。招商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深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。中国农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、国家外汇管理局北京市分局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚。中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	278,116.13
2	应收证券清算款	36,644,489.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,514,128.66
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	38,436,734.13

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	113044	大秦转债	289,097,692.08	2.82
2	110059	浦发转债	201,013,294.05	1.96
3	132018	G 三峡 EB1	196,758,193.29	1.92
4	127049	希望转 2	151,976,267.05	1.48
5	123107	温氏转债	125,464,784.20	1.22
6	113050	南银转债	102,837,404.01	1.00
7	110063	鹰 19 转债	90,211,436.28	0.88
8	127040	国泰转债	86,477,481.33	0.84
9	113056	重银转债	72,662,969.97	0.71
10	128129	青农转债	66,759,253.26	0.65
11	113037	紫银转债	64,480,593.17	0.63
12	110083	苏租转债	63,116,731.16	0.62
13	128081	海亮转债	62,353,334.24	0.61
14	113052	兴业转债	61,146,575.34	0.60
15	110073	国投转债	59,990,835.81	0.58
16	123190	道氏转 02	59,061,022.23	0.58
17	113065	齐鲁转债	54,895,429.43	0.54
18	113063	赛轮转债	54,863,527.98	0.53
19	113060	浙 22 转债	51,919,080.96	0.51
20	113042	上银转债	46,628,745.78	0.45
21	113647	禾丰转债	39,928,905.85	0.39
22	113058	友发转债	39,865,380.26	0.39
23	110061	川投转债	36,796,844.04	0.36
24	110074	精达转债	34,978,451.37	0.34
25	113033	利群转债	33,934,810.21	0.33
26	110067	华安转债	33,878,646.18	0.33
27	110077	洪城转债	33,235,477.47	0.32
28	110068	龙净转债	32,365,229.69	0.32
29	132026	G 三峡 EB2	31,440,113.98	0.31
30	127027	能化转债	29,491,024.58	0.29
31	128128	齐翔转 2	27,897,016.43	0.27
32	127063	贵轮转债	26,598,994.42	0.26
33	123194	百洋转债	25,558,348.11	0.25
34	111011	冠盛转债	25,553,567.45	0.25
35	132020	19 蓝星 EB	25,276,878.90	0.25
36	111005	富春转债	23,652,297.12	0.23
37	123187	超达转债	21,868,340.71	0.21
38	110084	贵燃转债	20,652,359.70	0.20
39	110079	杭银转债	20,563,503.02	0.20
40	118028	会通转债	19,300,700.20	0.19
41	128130	景兴转债	18,547,416.00	0.18

42	127045	牧原转债	18,351,675.17	0.18
43	110090	爱迪转债	18,271,930.48	0.18
44	111007	永和转债	17,792,200.56	0.17
45	123085	万顺转 2	17,752,218.36	0.17
46	118022	锂科转债	17,687,440.90	0.17
47	110088	淮 22 转债	16,777,683.53	0.16
48	127039	北港转债	16,252,636.95	0.16
49	127015	希望转债	16,120,578.79	0.16
50	123188	水羊转债	15,595,691.28	0.15
51	111002	特纸转债	14,892,253.22	0.15
52	113051	节能转债	14,803,770.44	0.14
53	128049	华源转债	14,799,390.99	0.14
54	118031	天 23 转债	14,162,448.26	0.14
55	113054	绿动转债	12,734,929.22	0.12
56	127032	苏行转债	12,682,777.48	0.12
57	113632	鹤 21 转债	11,848,891.44	0.12
58	111012	福新转债	11,805,380.32	0.12
59	118030	睿创转债	11,492,356.89	0.11
60	127050	麒麟转债	11,174,285.89	0.11
61	113648	巨星转债	10,969,314.87	0.11
62	123158	宙邦转债	10,537,243.54	0.10
63	128083	新北转债	10,148,268.64	0.10
64	127078	优彩转债	9,889,652.45	0.10
65	113609	永安转债	9,763,055.46	0.10
66	113628	晨丰转债	9,390,906.70	0.09
67	113664	大元转债	8,978,389.43	0.09
68	127067	恒逸转 2	8,914,915.01	0.09
69	128141	旺能转债	8,892,905.79	0.09
70	113021	中信转债	8,840,093.12	0.09
71	123178	花园转债	7,315,855.30	0.07
72	113066	平煤转债	6,935,835.72	0.07
73	113653	永 22 转债	6,831,957.98	0.07
74	128037	岩土转债	6,315,040.10	0.06
75	113048	晶科转债	6,305,920.31	0.06
76	127022	恒逸转债	5,951,977.26	0.06
77	111000	起帆转债	4,887,011.11	0.05
78	128044	岭南转债	4,727,730.53	0.05
79	110089	兴发转债	3,895,035.53	0.04
80	127082	亚科转债	3,856,693.28	0.04
81	110085	通 22 转债	3,200,636.85	0.03
82	127058	科伦转债	2,951,984.93	0.03
83	127012	招路转债	2,903,415.10	0.03
84	128090	汽模转 2	1,236,628.44	0.01

85	123174	精锻转债	388.80	0.00
----	--------	------	--------	------

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达安心回报债券A	易方达安心回报债券B
报告期期初基金份额总额	5,202,941,599.42	969,600,978.52
报告期期间基金总申购份额	58,119,951.60	6,616,497.71
减：报告期期间基金总赎回份额	647,553,896.66	69,188,909.67
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	4,613,507,654.36	907,028,566.56

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会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。

8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年一月十九日