

# 易方达丰华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：招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。

基金托管人招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	易方达丰华债券
基金主代码	000189
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 2 月 19 日
报告期末基金份额总额	4,146,580,635.52 份
投资目标	本基金在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。 2、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；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资；本基金投资资产支持证券将采取自上而

	下和自下而上相结合的投资策略；本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。3、本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。4、本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易,以对冲投资组合的系统性风险。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×10%+中债总指数收益率×90%	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达丰华债券 A	易方达丰华债券 C
下属分级基金的交易代码	000189	006867
报告期末下属分级基金的份额总额	3,226,326,030.27 份	920,254,605.25 份

注：本基金 A 类份额由原易方达保本一号混合型证券投资基金转型而来，并增设 C 类份额类别，基金合同于 2019 年 2 月 19 日起生效，C 类份额首次确认日为 2019 年 2 月 20 日。

### § 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)	
	易方达丰华债券 A	易方达丰华债券 C
1.本期已实现收益	-31,058,800.70	-10,909,781.77
2.本期利润	-51,691,997.19	-19,939,590.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0131	-0.0153
4.期末基金资产净值	4,012,205,840.89	1,124,093,680.75
5.期末基金份额净值	1.2436	1.2215

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

##### 易方达丰华债券 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	-0.85%	0.24%	0.03%	0.10%	-0.88%	0.14%
过去六个月	-0.38%	0.21%	-0.38%	0.09%	0.00%	0.12%
过去一年	1.61%	0.23%	0.36%	0.09%	1.25%	0.14%
过去三年	3.34%	0.34%	-0.07%	0.13%	3.41%	0.21%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	34.60%	0.39%	5.17%	0.13%	29.43%	0.26%

##### 易方达丰华债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①—③	②—④
----	--------	----------	----------	----------	-----	-----

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	-0.95%	0.24%	0.03%	0.10%	-0.98%	0.14%
过去六个月	-0.59%	0.21%	-0.38%	0.09%	-0.21%	0.12%
过去一年	1.20%	0.23%	0.36%	0.09%	0.84%	0.14%
过去三年	2.10%	0.34%	-0.07%	0.13%	2.17%	0.21%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	31.99%	0.39%	5.20%	0.13%	26.79%	0.26%

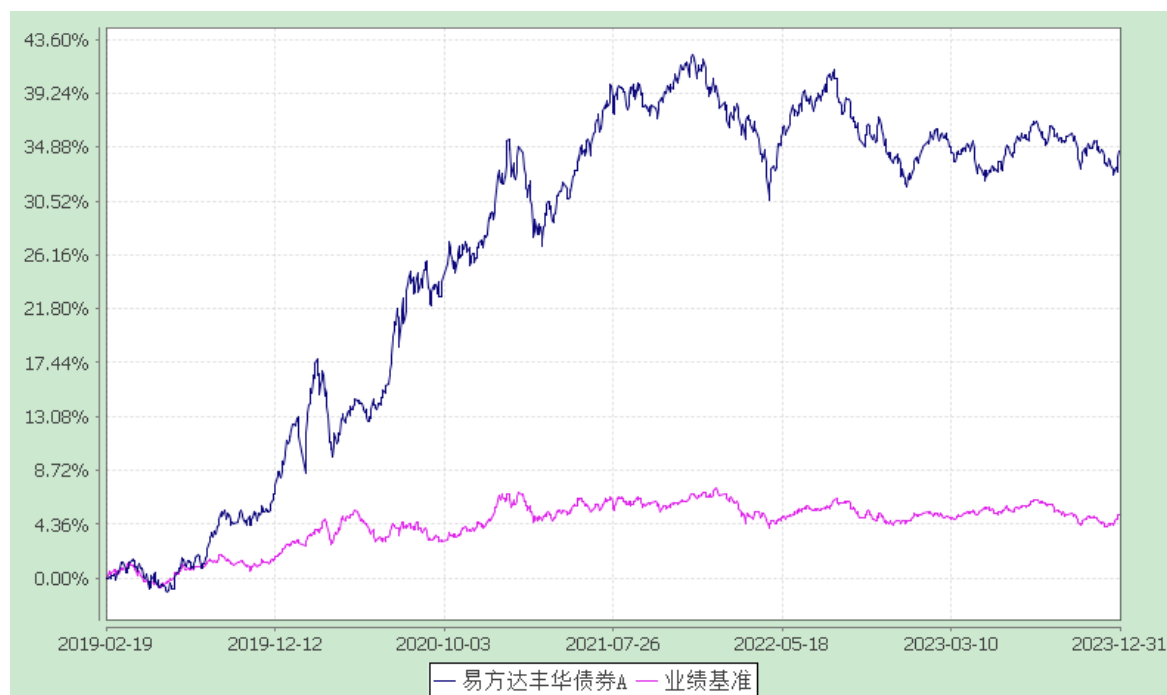
### 3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达丰华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

易方达丰华债券 A

(2019 年 2 月 19 日至 2023 年 12 月 31 日)



易方达丰华债券 C

(2019 年 2 月 20 日至 2023 年 12 月 31 日)



注：1.本基金由原易方达保本一号混合型证券投资基金于 2019 年 2 月 19 日转型而来。

2.自 2019 年 2 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 2 月 20 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.自基金转型至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 34.60%，同期业绩比较基准收益率为 5.17%；C 类基金份额净值增长率为 31.99%，同期业绩比较基准收益率为 5.20%。

## § 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		
王成	本基金的基金经理，易方达悦享一年持有混合、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦信一年持有	2019-11-28	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任安信证券股份有限公司交易员、投资经理，易方达基金管理有限公司年金投资部总经理助理。

	混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理，易方达安心回馈混合、易方达悦稳一年持有混合的基金经理助理，多资产养老金投资部副总经理				
李中阳	本基金的基金经理，易方达悦稳一年持有混合、易方达安心回馈混合的基金经理，易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理助理，多资产研究部总经理助理	2021-07-08	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中信证券股份有限公司研究部研究员，易方达基金管理有限公司研究员，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

四季度经济弱于预期，内需走弱，以 PPI（生产者价格指数，下同）和 CPI（消费者价格指数，下同）为代表的价格数据维持低位。三季度出台的稳增长政策效果不佳，尤其是房地产放松政策，在四季度效果消退，地产投资和销售回落，引发了市场对房地产产业链进一步下滑的担忧。虽然增发了一万亿特别国债，但下拨速度不及预期，主要工作量体现在 2024 年，基建增速环比提高有限。外需整体稳定，带动出口低位走平。以 CPI 和 PPI 为代表的价格数据同比走弱，未能回正，虽然实际 GDP（国内生产总值，下同）增速尚可，但名义 GDP 增速较低，拖累了经济表现。

四季度有新增的特别国债，还有地方政府发行的特殊再融资债券，供给较多，阶段性对银行间市场资金面产生了较大的扰动，1 年 AAA 等级 NCD（同业存单，下同）收益率从四季度初的 2.42% 上升到 11 月底的 2.62%，高出 1 年期 MLF（中期借贷便利）利率 16bp。短端收益率受到 NCD 上行影响出现较大调整，从四季度初到 11 月底，1 年国债收益率上行了 19bp、3 年国债收益率上行了 10bp、1 年 AAA 等级中短期票据收益率上行了 21bp、3 年 AAA 等级中短期票据收益率上行了 6bp。同时，由于对经济走势预期不明确，中长端利率保持震荡，从四季度初到 11 月底，30 年国债收益率在 3% 附近震荡、10 年国债收益率在 2.70% 附近震荡，曲线进一步平坦化，信用利差有小幅压缩。进入 12 月份以后，财政资金逐步投放，市场资金面宽松，叠加经济预期走弱，收益率陡峭化下行。截止 12 月底，1 年 NCD 收益率下行至 2.4%，1 年国债收益率下行至 2.08%，3 年国债收益率下行至 2.29%；曲线陡峭化，长端下行



略少，10 年国债收益率下行至 2.56%，30 年国债收益率下行至 2.83%。高等级信用债收益率跟随下行，利差变化不大，但永续债和二级资本债利差进一步压缩；截止 12 月底，3 年 AAA 等级中短期票据收益率下行至 2.71%，3 年 AAA-等级二级资本债收益率下行至 2.85%，5 年 AAA-商业银行永续债收益率下行至 3.05%。

权益市场进一步超预期地下探，沪深 300 指数四季度继续下行且贡献了全年最主要的跌幅，全年单边下行 11.4%，四季度下跌 7%。市场小盘大盘显著分化，微盘股指数全年涨幅近 50%，大幅跑赢大盘指数。

可转债市场受权益拖累，四季度表现较差，中证转债指数跌幅-3.22%。从结构来看，高价低等级的偏股型品种下跌较多，高等级转债体现了一定的防御性。

权益方面，四季度市场进一步下跌反应出了对宏观经济的担忧：虽然制造业体现出来一定的韧性，但是向上恢复的斜率并不高，地产等宏观数据也没有给予足够的支撑。但是我们仍保持一定的乐观，自下而上观察到的产业趋势仍在继续：（1）汽车、家电等中游制造业依靠自身供给驱动需求，表现出了足够的韧性；（2）高端制造业海外扩张仍在稳步前行。虽然有支撑，这类标的也随着市场整体下行，估值性价比进一步凸显，因此我们保持了较高的仓位。同时，我们也增加了部分以国内需求为主，但是经营有可能改善的行业龙头。我们认为虽然国内需求增速放缓，但这同样给了一些供给层面不是主要矛盾的行业龙头更好的经营壁垒，未来可能会有比较好的利润率改善机会。

债券方面，组合继续保持偏高杠杆水平，以中短久期信用债为底仓，获取票息收益和杠杆收益。同时，组合在 10 月初基于对债券供给和稳增长政策的担忧，卖出长端利率债降低了久期，在 11-12 月份市场波动过程中，组合先加仓了信用债，后加仓了利率债，将久期提高到 2.5 年以上，在 12 月份收益率陡峭化下行中获取了一定的收益。

可转债方面，组合在四季度市场调整过程中，先进行了降仓，重点卖出偏股型和平衡型品种，降低组合弹性；后在 12 月份市场情绪特别悲观的时候，市场增持了平衡低估品种，在最后一周反弹中，获取了一定收益。但由于整个季度对可转债保持了中性略高配置，整体来看拖累了组合表现。

#### 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 1.2436 元，本报告期份额净值增长

率为-0.85%，同期业绩比较基准收益率为 0.03%；C 类基金份额净值为 1.2215 元，本报告期份额净值增长率为-0.95%，同期业绩比较基准收益率为 0.03%。

#### 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	962,560,461.55	13.27
	其中：股票	962,560,461.55	13.27
2	固定收益投资	6,147,289,776.08	84.77
	其中：债券	5,867,613,017.52	80.91
	资产支持证券	279,676,758.56	3.86
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	80,018,470.97	1.10
	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	53,013,992.60	0.73
7	其他资产	8,916,154.02	0.12
8	合计	7,251,798,855.22	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	-	-
C	制造业	931,519,232.57	18.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	288,702.50	0.01
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	30,752,526.48	0.60
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	962,560,461.55	18.74

### 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	601799	星宇股份	1,131,212	148,313,205.32	2.89
2	601702	华峰铝业	4,560,468	81,860,400.60	1.59
3	600933	爱柯迪	2,894,583	63,507,151.02	1.24
4	603197	保隆科技	1,065,128	60,073,219.20	1.17
5	300750	宁德时代	280,360	45,771,573.60	0.89
6	000708	中信特钢	3,100,000	43,524,000.00	0.85
7	000661	长春高新	297,275	43,342,695.00	0.84
8	002648	卫星化学	2,369,415	34,948,871.25	0.68
9	600519	贵州茅台	19,600	33,829,600.00	0.66

10	603259	药明康德	422,648	30,751,868.48	0.60
----	--------	------	---------	---------------	------

## 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	166,580,636.49	3.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,154,016,603.78	61.41
	其中：政策性金融债	277,246,367.48	5.40
4	企业债券	413,715,410.08	8.05
5	企业短期融资券	92,894,640.63	1.81
6	中期票据	1,334,995,779.73	25.99
7	可转债（可交换债）	705,409,946.81	13.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,867,613,017.52	114.24

## 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	2121062	21 北京农商二级	2,600,000	264,783,431.69	5.16
2	2228041	22 农业银行二级 01	2,200,000	227,838,491.80	4.44
3	2128042	21 兴业银行二级 02	2,000,000	204,825,530.05	3.99
4	2128038	21 农业银行永续 债 01	1,900,000	195,240,303.83	3.80
5	2128044	21 工商银行永续 债 02	1,900,000	194,459,704.92	3.79

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	0.99
2	135242	22 萧万 A	500,000	50,488,621.92	0.98
3	189847	21LJZ 优	400,000	40,289,630.68	0.78
4	112887	G 中交泰 A	400,000	39,595,054.60	0.77
5	180297	燕山湖 A	200,000	20,353,034.67	0.40
6	193398	PR 产 3A	200,000	19,738,133.74	0.38
7	180802	铁建 37A1	200,000	18,462,295.78	0.36
8	136708	21 重万优	100,000	10,141,827.30	0.20
9	183144	21 水八 04	100,000	10,072,659.18	0.20
10	183269	铁托 4 优	100,000	10,070,258.08	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，北京农村商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北京监管局的处罚。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	562,383.52
2	应收证券清算款	6,336,803.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,016,967.20
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,916,154.02

#### 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	127061	美锦转债	31,163,555.71	0.61
2	127045	牧原转债	22,320,083.14	0.43
3	118022	锂科转债	21,755,769.86	0.42
4	113037	紫银转债	20,930,015.73	0.41
5	113060	浙 22 转债	18,026,555.12	0.35
6	123178	花园转债	17,957,594.89	0.35
7	113044	大秦转债	14,668,177.52	0.29
8	127067	恒逸转 2	14,427,066.41	0.28
9	110088	淮 22 转债	13,499,823.63	0.26
10	113657	再 22 转债	13,419,965.87	0.26
11	113641	华友转债	13,301,301.51	0.26
12	113050	南银转债	13,019,929.26	0.25
13	113043	财通转债	12,951,539.50	0.25
14	127042	嘉美转债	12,011,791.11	0.23
15	127084	柳工转 2	11,880,031.23	0.23
16	127082	亚科转债	11,345,805.45	0.22
17	127049	希望转 2	11,304,446.19	0.22
18	113033	利群转债	11,193,904.63	0.22
19	113632	鹤 21 转债	11,080,234.92	0.22
20	127050	麒麟转债	10,706,429.78	0.21
21	110093	神马转债	10,666,196.62	0.21
22	123114	三角转债	10,368,127.57	0.20
23	127018	本钢转债	10,184,040.96	0.20
24	127033	中装转 2	10,051,207.79	0.20
25	113021	中信转债	9,598,937.93	0.19
26	127040	国泰转债	9,315,136.92	0.18

27	128130	景兴转债	9,245,176.04	0.18
28	111009	盛泰转债	8,574,419.42	0.17
29	110083	苏租转债	8,494,692.80	0.17
30	127035	濮耐转债	8,491,895.56	0.17
31	123190	道氏转 02	8,263,336.95	0.16
32	110087	天业转债	8,215,279.47	0.16
33	127086	恒邦转债	8,052,468.48	0.16
34	128129	青农转债	7,835,826.43	0.15
35	118009	华锐转债	7,735,256.05	0.15
36	128081	海亮转债	7,578,194.39	0.15
37	127022	恒逸转债	7,488,715.38	0.15
38	113058	友发转债	7,266,103.79	0.14
39	123179	立高转债	7,037,423.80	0.14
40	113052	兴业转债	6,833,129.79	0.13
41	110090	爱迪转债	6,385,628.17	0.12
42	127026	超声转债	6,333,881.54	0.12
43	127047	帝欧转债	6,308,678.40	0.12
44	113644	艾迪转债	5,833,601.18	0.11
45	113655	欧 22 转债	5,588,436.91	0.11
46	123188	水羊转债	5,572,433.07	0.11
47	110086	精工转债	5,524,338.14	0.11
48	128141	旺能转债	5,383,872.97	0.10
49	118031	天 23 转债	5,359,754.13	0.10
50	118033	华特转债	5,307,450.02	0.10
51	118028	会通转债	5,205,449.55	0.10
52	110047	山鹰转债	5,154,779.90	0.10
53	132018	G 三峡 EB1	4,636,878.08	0.09
54	113063	赛轮转债	4,597,261.12	0.09
55	127063	贵轮转债	4,333,684.45	0.08
56	113051	节能转债	4,250,621.35	0.08
57	128128	齐翔转 2	4,168,777.65	0.08
58	111008	沿浦转债	4,133,067.12	0.08
59	123187	超达转债	4,069,581.75	0.08
60	110075	南航转债	3,905,020.20	0.08
61	123194	百洋转债	3,753,061.40	0.07
62	123172	漱玉转债	3,187,564.38	0.06
63	123104	卫宁转债	2,980,797.42	0.06
64	123117	健帆转债	2,818,500.68	0.05
65	123168	惠云转债	2,730,330.46	0.05
66	113662	豪能转债	2,685,517.60	0.05
67	123182	广联转债	2,578,757.40	0.05
68	128042	凯中转债	2,374,663.45	0.05
69	127027	能化转债	2,336,246.58	0.05

70	110045	海澜转债	2,005,490.31	0.04
71	123150	九强转债	1,640,154.30	0.03
72	123099	普利转债	1,516,146.26	0.03
73	111011	冠盛转债	1,242,320.03	0.02
74	123124	晶瑞转 2	1,178,210.60	0.02
75	110084	贵燃转债	652,245.04	0.01
76	127073	天赐转债	550,249.07	0.01
77	110089	兴发转债	472,415.05	0.01
78	113666	爱玛转债	460,149.15	0.01
79	113654	永 02 转债	220,985.29	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	易方达丰华债券A	易方达丰华债券C
报告期期初基金份额总额	4,236,907,499.49	1,553,865,484.79
报告期期间基金总申购份额	42,851,542.79	5,724,043.34
减：报告期期间基金总赎回份额	1,053,433,012.01	639,334,922.88
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	3,226,326,030.27	920,254,605.25

### § 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.中国证监会准予易方达保本一号混合型证券投资基金变更注册为易方达丰华债券型证券投资基金的文件；

2.易方达保本一号混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告；

3.《易方达丰华债券型证券投资基金基金合同》；

4.《易方达丰华债券型证券投资基金托管协议》；

5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

6.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