

易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 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

送出日期：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 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	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 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贵金属投资明细	42
7.9 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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43

§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
§ 9 重大事件揭示	45
9.1 基金份额持有人大会决议.....	45
9.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
9.4 基金投资策略的改变.....	45
9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
9.8 其他重大事件.....	47
§ 10 影响投资者决策的其他重要信息	48
10.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§ 11 备查文件目录	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金	
基金简称	易方达恒固 18 个月封闭式债券	
基金主代码	017798	
基金运作方式	契约型封闭式	
基金合同生效日	2023 年 3 月 6 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	
报告期末基金份额总额	7,832,586,442.73 份	
基金合同存续期	18 个月	
下属分级基金的基金简称	易方达恒固 18 个月封闭式 债券 A	易方达恒固 18 个月封闭 式债券 C
下属分级基金的交易代码	017798	017799
报告期末下属分级基金的份额总额	7,639,432,465.36 份	193,153,977.37 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	<p>基金管理人应根据资产估值方法不同，对投资的债券资产实行分单元管理。一是持有到期型单元，本单元投资的债券以收取合同现金流量为目的采用买入并持有至到期的投资管理策略，该单元内的资产采用摊余成本法估值。二是交易型单元，基金管理人可根据投资管理的需要和对市场的判断，对该单元内的资产采用灵活的投资管理策略，采用市价法估值。为确保上述两类债券的严格隔离，基金管理人在购买债券伊始即根据投资目的对其分别标记为市价法估值债券品种和摊余成本法估值债券品种，并分别计入上述两个单元进行运营管理。每笔债券投资分类标识确定后在封闭期内不可随意更改，所投债券一旦归入持有到期型单元原则上不可自由卖出，确有必要的，基金管理人可以基于持有人利益优先原则或根据基金合同的有关规定，在不违反《企业会计准则》的前提下，履行内部程序后按照会计准则对尚未到期的债券资产进行处置。</p> <p>在封闭期内，本基金投资前应对所投资的债券确认是否采用买入并持有至到期策略。对买入持有至到期策略的债券，以收取合同现金流量为目的，所投资资产到期日（或回售日）不得晚于封闭期到期日。对买入持有至到期策略的含回售权的债券，债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。对买入持有到期策略的债券，基金管理人应按照会计准则进行会计处理，确保基金估值充分体现相关风险。对于以市价法计量的债券资产，基金管理人可根据对宏观经济、市场利率、资金供求、市场收益率曲线、流动性、信用风险等因素的分析，在适度范围内调整该部分债券的平均久期，并对债券类属资产和具体持仓个券进行</p>

	优化配置和调整。除此之外，本基金还可采用息差策略、可转换债券及可交换债券投资策略、银行存款、同业存单投资策略、信用债投资策略、衍生产品投资策略等。
业绩比较基准	中债-优选投资级信用债财富指数（1-3 年）收益率*30%+中债-优选投资级信用债财富指数（1 年以下）收益率*50%+一年期定期存款基准利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		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； 广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510620; 519031	100140
法定代表人		刘晓艳	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	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; 广东省珠海市横琴新区 荣粤道 188 号 6 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	易方达恒固 18 个月封闭式债券 A	易方达恒固 18 个月封闭式债券 C
本期已实现收益	97,013,904.97	2,208,407.35
本期利润	109,726,590.80	2,529,551.81
加权平均基金份额本期利润	0.0144	0.0131
本期加权平均净值利润率	1.42%	1.30%
本期基金份额净值增长率	1.43%	1.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	易方达恒固 18 个月封闭式债券 A	易方达恒固 18 个月封闭式债券 C
期末可供分配利润	111,972,347.78	2,567,314.47
期末可供分配基金份额利润	0.0147	0.0133
期末基金资产净值	7,763,531,869.34	196,027,708.80
期末基金份额净值	1.0162	1.0149
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	易方达恒固 18 个月封闭式债券 A	易方达恒固 18 个月封闭式债券 C
基金份额累计净值增长率	3.75%	3.41%

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.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

易方达恒固 18 个月封闭式债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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

过去一个月	0.27%	0.01%	0.25%	0.01%	0.02%	0.00%
过去三个月	0.73%	0.01%	0.90%	0.02%	-0.17%	-0.01%
过去六个月	1.43%	0.01%	1.65%	0.02%	-0.22%	-0.01%
过去一年	2.86%	0.01%	2.94%	0.02%	-0.08%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.75%	0.01%	4.27%	0.02%	-0.52%	-0.01%

易方达恒固 18 个月封闭式债券 C

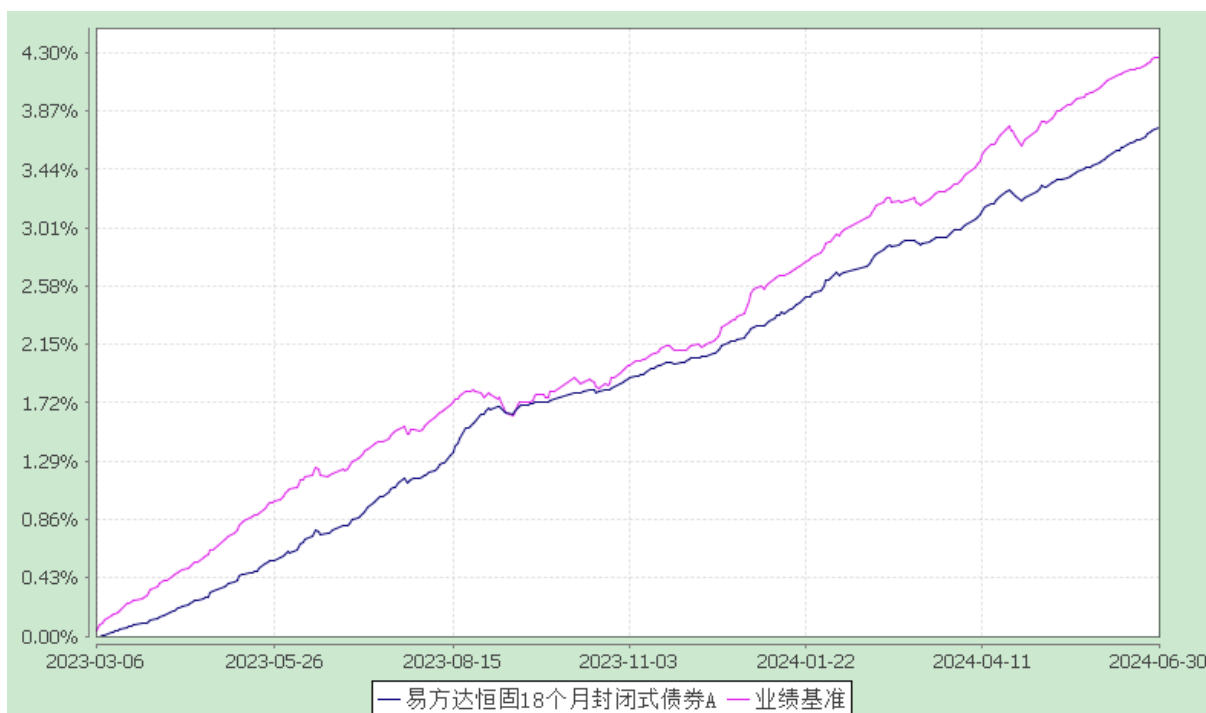
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.26%	0.01%	0.25%	0.01%	0.01%	0.00%
过去三个月	0.67%	0.01%	0.90%	0.02%	-0.23%	-0.01%
过去六个月	1.31%	0.01%	1.65%	0.02%	-0.34%	-0.01%
过去一年	2.61%	0.01%	2.94%	0.02%	-0.33%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.41%	0.01%	4.27%	0.02%	-0.86%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

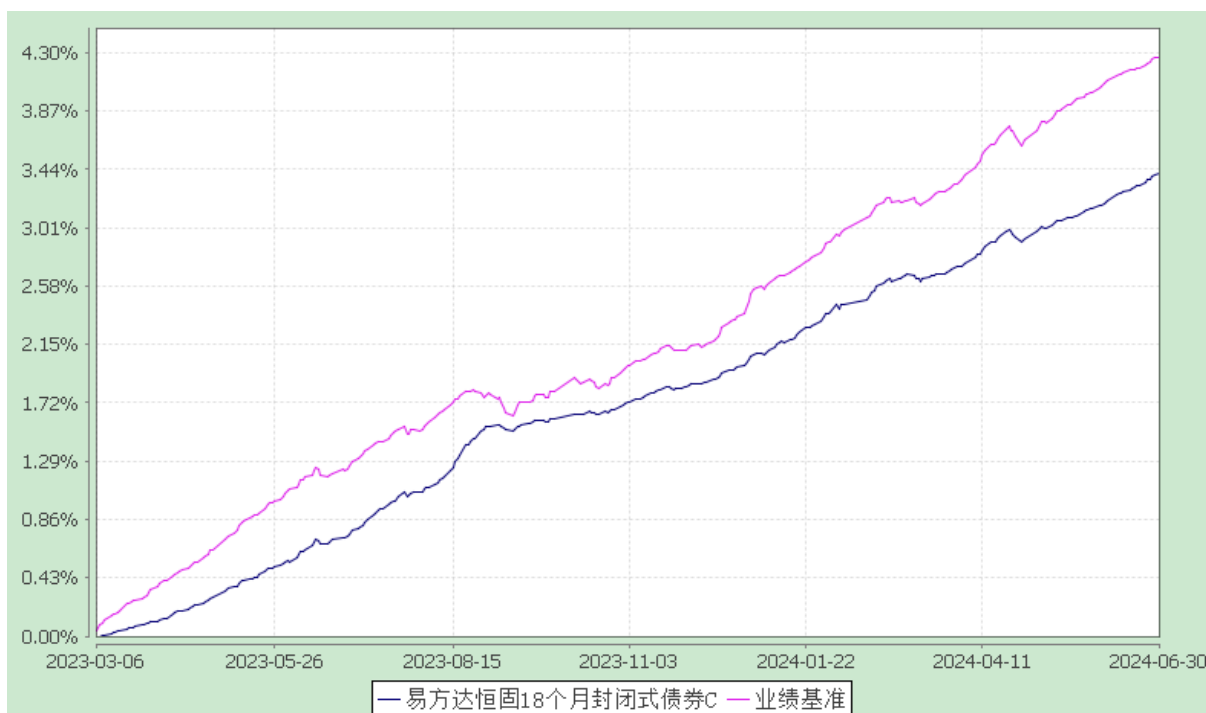
易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023 年 3 月 6 日至 2024 年 6 月 30 日)

易方达恒固 18 个月封闭式债券 A



易方达恒固 18 个月封闭式债券 C



注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为3.75%，同期业绩比较基准收益率为4.27%；C类基金份额净值增长率为3.41%，同期业绩比较基准收益率为4.27%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，本基金管理人成立于2001年4月17日，注册资本13,244.2万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

纪玲云	本基金的基金经理，易方达信用债券、易方达瑞财混合、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、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	2023-03-06	-	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。
刘琬姝	本基金的基金经理助理，易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债、易方达恒利 3 个月定开债券发起式的基金经理，易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒春纯债一年定开债券发起式、易方达安源中短债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达年年恒实纯债一年定开债券发起式、易方达稳丰 90 天滚动短债（自 2021 年 08 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日）、易方达富惠纯债债券、易方达恒惠定开债券发起式、易方达兴利 180 天持有债券的基金经理助理，固定收益研究员	2023-04-04	-	12 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投资经理助理。

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/基金经理助理，“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。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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、规范化的投资研究和决策流程、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，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，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 31 次，其中 26 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，5 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济在小幅恢复后出现边际走弱。一季度经济表现相对较好，一是来自出口需求的增长，二是财政支出加速带动制造业和基建投资保持较高增速，三是春节假期旅游的火爆带动了社会消费品零售总额回升，四是生产端恢复较为显著。进入二季度后，基建投资和消费数据有显著走弱，生产动力在产销比下滑的情况下也出现下降，出口数据高位走平，显示进一步推动向上的动力不足，而房地产市场则继续表现疲弱，持续放松的政策尚未对市场预期带来显著的影响。经济整体依然表现为需求相对不足的状态。

政策面基本保持了平稳。财政延续“开前门、堵后门”的方向，在保持一定的基建投资增速和化解地方政府债务风险之间取得平衡。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。房地产政策继续宽松。在 4 月份政治局会议提出“统筹研究消化存量房产和优化增量住房的政策措施”之后，5 月 17 日央行连发 3 条重磅房地产新政，此后各地政府在首付比例、房贷利率等方面都进行了较大力度的放松，目前政策效果持续性还有待观察。

在上述基本面和政策面的环境下，债券市场收益率水平出现较为显著的下行。截至上半年末，10 年国债收益率较去年底下行 35BP，绝对收益水平创历史新低。信用债利率下行幅度更大，3 年 AAA 信用债与国开债利差压缩 18BP，5 年 AAA-二级资本债和 10 年 AA+产业债则分别压缩 31BP 和 46BP。

操作上，组合上半年主要进行市值部分债券的灵活操作，继续把握机会进行持有到期类资产的配置，并跟随基金剩余封闭期的减少而逐步降低组合的风险敞口。组合在保持了相对稳健的风险收益特征的基础上，获得了较好的持有期回报。

4.4.2 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 1.0162 元，本报告期份额净值增长率为 1.43%，同期业绩比较基准收益率为 1.65%；C 类基金份额净值为 1.0149 元，本报告期份额净值增长率为 1.31%，同期业绩比较基准收益率为 1.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为下半年宏观经济依然处于结构化转型的压力期，在地产行业和地方政府债务风险管控的大背景下，经济基本面呈现转型初期需求不足的特征。

从结构上看，出口有望维持相对偏好的状态，但边际上可能受到国际政治经济局势的影响，存在一定的波动风险。而基建投资因为政府类债券大概率在下半年多发，我们可能看到一定的财政向上对冲的力量。房地产有望在低位波动，随着放松政策的不断出台，进一步大幅下滑的风险不大。消费则继续呈现以价换量的特点，向上的推动力不足，但仍然存在一定的韧性。综合来看，我们认为宏观经济在下半年可能延续平稳偏弱的状态，但宏观政策的取向和力度仍是最需要关注的焦点。

在此基本面背景下，债券市场收益率中枢波动下行的趋势没有发生变化。虽然上半年收益率中枢已经下行不少，但是我们对下半年债券市场的走势依然不悲观。考虑到债券收益率各类利差水平已经压缩至低位，央行持续大幅降息的可能性较低，债券资产获取资本利得收益的空间可能小于上半年。

本组合将延续之前的投资思路，保持稳健的风险收益特征，积极稳妥操作，争取在剩余的封闭期内继续为投资人提供稳定有竞争力的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和

基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达恒固 18 个月封闭式债券 A:本报告期内实施的利润分配金额为 160,428,082.01 元。

易方达恒固 18 个月封闭式债券 C:本报告期内实施的利润分配金额为 3,669,926.15 元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和

完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,712,377.68	1,820,397.65
结算备付金		107,630,537.74	63,313,420.69
存出保证金		34,507.28	35,351.51
交易性金融资产	6.4.7.2	2,820,086,657.03	3,275,909,868.55
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,820,086,657.03	3,275,909,868.55
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	31,006,879.45	-
债权投资	6.4.7.5	6,390,447,634.50	7,818,830,335.78
其中：债券投资		6,080,529,931.86	7,236,198,454.53
资产支持证券投资		309,917,702.64	582,631,881.25
其他投资		-	-
应收清算款		-	10,105,272.92
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,350,918,593.68	11,170,014,647.10
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		1,388,474,967.22	3,155,629,521.99
应付清算款		-	25,830.89
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,954,435.81	2,038,202.79
应付托管费		325,739.30	339,700.46
应付销售服务费		40,115.60	41,806.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		415,036.51	394,724.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	148,721.10	143,417.04
负债合计		1,391,359,015.54	3,158,613,203.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	7,832,586,442.73	7,832,586,442.73
未分配利润	6.4.7.9	126,973,135.41	178,815,000.96
净资产合计		7,959,559,578.14	8,011,401,443.69
负债和净资产总计		9,350,918,593.68	11,170,014,647.10

注：1.本基金合同生效日为 2023 年 3 月 6 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0162 元，C 类基金份额净值 1.0149 元；基金份额总额 7,832,586,442.73 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 7,639,432,465.36 份，C 类基金份额总额 193,153,977.37 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 6 日（基 金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		152,289,928.17	93,729,745.71
1.利息收入		82,620,966.17	55,574,594.51
其中：存款利息收入	6.4.7.10	738,620.03	3,230,388.21
债券利息收入		74,828,479.43	46,051,697.96
资产支持证券利息收入		7,038,794.89	3,305,941.87
买入返售金融资产收入		15,071.82	2,986,566.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		56,635,131.71	30,061,071.41

其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	56,531,025.44	30,062,167.07
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	104,106.27	-1,095.66
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	13,033,830.29	8,090,771.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	3,307.92
减：二、营业总支出		40,033,785.56	26,312,868.21
1. 管理人报酬		11,805,968.85	7,496,197.69
2. 托管费		1,967,661.48	1,249,366.28
3. 销售服务费		242,416.74	153,989.53
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		26,221,267.60	15,707,290.51
其中：卖出回购金融资产支出		26,221,267.60	15,707,290.51
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-575,502.58	1,532,630.27
7. 税金及附加		245,655.23	134,980.16
8. 其他费用	6.4.7.19	126,318.24	38,413.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		112,256,142.61	67,416,877.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		112,256,142.61	67,416,877.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		112,256,142.61	67,416,877.50

注：本基金合同生效日为 2023 年 3 月 6 日，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,832,586,442.73	178,815,000.96	8,011,401,443.69

产			
二、本期期初净资产	7,832,586,442.73	178,815,000.96	8,011,401,443.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-51,841,865.55	-51,841,865.55
（一）、综合收益总额	-	112,256,142.61	112,256,142.61
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-164,098,008.16	-164,098,008.16
四、本期期末净资产	7,832,586,442.73	126,973,135.41	7,959,559,578.14
项目	上年度可比期间		
	2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	7,832,586,442.73	-	7,832,586,442.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	67,416,877.50	67,416,877.50
（一）、综合收益总额	-	67,416,877.50	67,416,877.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回	-	-	-

款			
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	7,832,586,442.73	67,416,877.50	7,900,003,320.23

注：本基金合同生效日为 2023 年 3 月 6 日，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]3245 号《关于准予易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,832,586,442.73 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,936,107.74 份基金份额。本基金为契约型封闭式基金，存续期限为 18 个月。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息

红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,712,377.68
等于：本金	1,690,579.32
加：应计利息	21,798.36
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,712,377.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	354,871,771.34	5,250,606.05	360,665,206.05	542,828.66
交易所				

	市场				
	银行间市场		30,398,650.98		
	合计	2,417,132,155.50		2,459,421,450.98	11,890,644.50
	合计	2,772,003,926.84	35,649,257.03	2,820,086,657.03	12,433,473.16
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,772,003,926.84	35,649,257.03	2,820,086,657.03	12,433,473.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	31,006,879.45	-
合计	31,006,879.45	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日					
	初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值	
债券	交易所市场	2,305,000.00	1,205,151.88	53,027,541.97	127,675.19	2,359,105.018.66
	银行间市场	3,635,000.00	2,669,744.40	84,006,856.83	251,688.03	3,721,424.913.20
	小计	5,940,000.00	3,874,896.28	137,034,398.80	379,363.22	6,080,529.931.86
资产支持证券	306,290,000	66,235.88	3,574,551.8	13,085.11	309,917.7	

	.00		7		02.64
其他	-	-	-	-	-
合计	6,246,290,000.00	3,941,132.16	140,608,950.67	392,448.33	6,390,447,634.50

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	974,462.15	-	-	974,462.15
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	610,048.42	-	-	610,048.42
本期转回	1,192,062.24	-	-	1,192,062.24
其他变动	-	-	-	-
期末余额	392,448.33	-	-	392,448.33

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	59,213.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	59,213.50
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	148,721.10

6.4.7.8 实收基金

易方达恒固 18 个月封闭式债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,639,432,465.36	7,639,432,465.36
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,639,432,465.36	7,639,432,465.36

易方达恒固 18 个月封闭式债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	193,153,977.37	193,153,977.37
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	193,153,977.37	193,153,977.37

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

易方达恒固 18 个月封闭式债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	175,386,524.82	-585,629.63	174,800,895.19
本期期初	175,386,524.82	-585,629.63	174,800,895.19
本期利润	97,013,904.97	12,712,685.83	109,726,590.80
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-160,428,082.01	-	-160,428,082.01
本期末	111,972,347.78	12,127,056.20	124,099,403.98

易方达恒固 18 个月封闭式债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,028,833.27	-14,727.50	4,014,105.77
本期期初	4,028,833.27	-14,727.50	4,014,105.77
本期利润	2,208,407.35	321,144.46	2,529,551.81
本期基金份额交易产生的	-	-	-

变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,669,926.15	-	-3,669,926.15
本期末	2,567,314.47	306,416.96	2,873,731.43

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	66,975.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	671,302.01
其他	342.67
合计	738,620.03

6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	42,459,566.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	14,071,458.70
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	56,531,025.44

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,609,401,784.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,515,157,296.21
减：应计利息总额	80,141,196.93

减：交易费用	31,832.50
买卖债券差价收入	14,071,458.70

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	104,106.27
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	104,106.27

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	277,321,086.80
减：卖出资产支持证券成本总额	271,259,505.21
减：应计利息总额	5,957,475.32
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	104,106.27

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	13,033,830.29
——股票投资	-
——债券投资	13,033,830.29

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	13,033,830.29

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30 日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-575,502.58
其他债权投资	-
其他	-
合计	-575,502.58

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	18,210.64
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	126,318.24

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

易方达恒固 18 个月封闭式债券 A：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2024

年 8 月 28 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.227 元。

易方达恒固 18 个月封闭式债券 C：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2024 年 8 月 28 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.210 元。

根据《易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》，本基金将在封闭期到期日（2024 年 9 月 6 日）对基金份额进行自动赎回，基金合同将于封闭期到期日的次日（2024 年 9 月 7 日）自动终止并进入基金财产清算程序。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年3月6日（基金合同生 效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,805,968.85	7,496,197.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,333,663.91	2,081,873.39
应支付基金管理人的净管理费	8,472,304.94	5,414,324.30

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年3月6日（基金合同生 效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,967,661.48	1,249,366.28

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关 联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达恒固 18 个月 封闭式债券 A	易方达恒固 18 个月封 闭式债券 C	合计

易方达基金管理有限 公司	-	1,706.56	1,706.56
中国工商银行	-	91,741.38	91,741.38
广发证券	-	346.18	346.18
合计	-	93,794.12	93,794.12
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达恒固18个月 封闭式债券A	易方达恒固18个月封 闭式债券C	合计
易方达基金管理有限 公司	-	1,084.10	1,084.10
中国工商银行	-	58,276.61	58,276.61
广发证券	-	219.88	219.88
合计	-	59,580.59	59,580.59

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达恒固 18 个月封闭式债券 A

无。

易方达恒固 18 个月封闭式债券 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年3月6日(基金合同生效日) 至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	1,712,377.68	66,975.35	1,268,529.82	3,006,814.64

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达恒固 18 个月封闭式债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润分 配合计	备注
		场 内	场 外					
1	2024-01-11	-	2024-	0.210	160,428,082.	-	160,428,082.	-

			01-11		01		01	
合计				0.210	160,428,082.01	-	160,428,082.01	-

注：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2024 年 8 月 28 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.227 元。

易方达恒固 18 个月封闭式债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024-01-11	-	2024-01-11	0.190	3,669,926.15	-	3,669,926.15	-
合计				0.190	3,669,926.15	-	3,669,926.15	-

注：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2024 年 8 月 28 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.210 元。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,388,474,967.22 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102101565	21 中铁股 MTN004	2024-07-01	102.21	1,790,000	182,959,881.40
101901150	19 赣高速	2024-07-02	102.78	1,800,000	185,005,177.42

	MTN002				
102101527	21 首钢 MTN002A	2024-07-02	102.41	1,053,000	107,836,296.53
102101645	21 中交建 MTN002	2024-07-02	102.07	1,053,000	107,480,430.36
102101794	21 中车集 MTN001	2024-07-02	102.09	306,000	31,238,781.85
102101681	21 鲁高速 MTN006(革命 老区)	2024-07-03	102.16	1,053,000	107,577,135.96
102101794	21 中车集 MTN001	2024-07-03	102.09	1,053,000	107,498,161.07
2120071	21 上海银行	2024-07-03	102.15	290,000	29,623,460.78
2122050	21 农银租赁 债 01	2024-07-03	102.18	1,816,000	185,556,330.82
1922034	19 建信金融 债 02	2024-07-04	102.42	1,664,000	170,419,170.68
2028006	20 邮储银行 永续债	2024-07-04	102.24	737,000	75,350,294.44
2028023	20 招商银行 永续债 01	2024-07-04	105.80	316,000	33,433,093.55
2128033	21 建设银行 二级 03	2024-07-04	105.75	600,000	63,449,508.20
232400018	24 宁波银行 二级资本债 01	2024-07-04	101.28	632,000	64,007,401.64
2328021	23 兴业银行 小微债 01	2024-07-04	103.24	453,000	46,768,715.11
合计				14,616,000	1,498,203,839.81

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投

资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 113.14%(2023 年 12 月 31 日：138.69%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	10,387,344.26	31,262,698.37
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	1,526,004,588.69	1,886,911,708.93
合计	1,536,391,932.95	1,918,174,407.30

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
--------	-------------------	---------------------

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	6,820,649,400.60	8,475,791,249.92
AAA 以下	52,561,311.24	118,142,665.86
未评级	0.00	0.00
合计	6,873,210,711.84	8,593,933,915.78

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	309,917,702.64	582,631,881.25
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	309,917,702.64	582,631,881.25

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	491,013,944.10	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	491,013,944.10	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,712,377.68	-	-	-	1,712,377.68
结算备付金	107,630,537.74	-	-	-	107,630,537.74
存出保证金	34,507.28	-	-	-	34,507.28
交易性金融资产	1,195,245,443.72	1,240,487,111.54	384,354,101.77	-	2,820,086,657.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	31,006,879.45	-	-	-	31,006,879.45
债权投资	6,390,447,634.50	-	-	-	6,390,447,634.50
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,726,077,380.37	1,240,487,111.54	384,354,101.77	-	9,350,918,593.68
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,388,474,967.22	-	-	-	1,388,474,967.22
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,954,435.81	1,954,435.81
应付托管费	-	-	-	325,739.30	325,739.30
应付销售服务费	-	-	-	40,115.60	40,115.60
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	415,036.51	415,036.51
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	148,721.10	148,721.10
负债总计	1,388,474,967.22	-	-	2,884,048.32	1,391,359.0

					15.54
利率敏感度缺口	6,337,602,413.15	1,240,487,111.54	384,354,101.77	-2,884,048.32	7,959,559,578.14
上年度末					
2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,820,397.65	-	-	-	1,820,397.65
结算备付金	63,313,420.69	-	-	-	63,313,420.69
存出保证金	35,351.51	-	-	-	35,351.51
交易性金融资产	1,693,055,094.76	684,670,421.87	898,184,351.92	-	3,275,909,868.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	7,818,830,335.78	-	-	-	7,818,830,335.78
应收清算款	-	-	-	10,105,272.92	10,105,272.92
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,577,054,600.39	684,670,421.87	898,184,351.92	10,105,272.92	11,170,014,647.10
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,155,629,521.99	-	-	-	3,155,629,521.99
应付清算款	-	-	-	25,830.89	25,830.89
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,038,202.79	2,038,202.79
应付托管费	-	-	-	339,700.46	339,700.46
应付销售服务费	-	-	-	41,806.20	41,806.20
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	394,724.04	394,724.04
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	143,417.04	143,417.04
负债总计	3,155,629,521.99	-	-	2,983,681.42	3,158,613,203.41
利率敏感度缺口	6,421,425,078.40	684,670,421.87	898,184,351.92	7,121,591.50	8,011,401,443.69

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	13,090,519.69	23,047,235.67
	2.市场利率上升25个基点	-12,997,316.71	-22,920,515.95

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，但可持有因可转债转股所形成的股票、因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	2,820,086,657.03
第三层次	-
合计	2,820,086,657.03

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、债权投资、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

本期末本基金持有的债权投资账面价值为 6,390,447,634.50 元，公允价值为 6,416,624,450.67 元(上年度末：账面价值为 7,818,830,335.78 元，公允价值为 7,834,946,495.93 元)。

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国

基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于本期末，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,210,534,291.53	98.50
	其中：债券	8,900,616,588.89	95.18
	资产支持证券	309,917,702.64	3.31
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	31,006,879.45	0.33
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	109,342,915.42	1.17
8	其他各项资产	34,507.28	0.00
9	合计	9,350,918,593.68	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资交易。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,144,696,307.27	52.07
	其中：政策性金融债	205,344,749.39	2.58
4	企业债券	1,149,300,744.27	14.44
5	企业短期融资券	280,057,981.43	3.52
6	中期票据	2,835,547,611.82	35.62
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	491,013,944.10	6.17
9	其他	-	-
10	合计	8,900,616,588.89	111.82

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112405198	24 建设银行 CD198	3,000,000	294,453,613.15	3.70
2	2122050	21 农银租赁债 01	2,500,000	255,446,490.67	3.21
3	1922034	19 建信金融债 02	2,000,000	204,830,733.99	2.57
4	102101565	21 中铁股 MTN004	2,000,000	204,424,448.49	2.57
5	2120071	21 上海银行	1,900,000	194,084,743.05	2.44

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180611	G 电建 A2	1,100,000	107,306,062.38	1.35
2	193398	PR 产 3A	900,000	87,971,726.25	1.11
3	189951	21 十局优	800,000	82,190,583.97	1.03
4	260693	悦信 07 优	200,000	20,367,394.97	0.26
5	180245	禾昱一 3A	300,000	12,081,935.07	0.15

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，海通证券股份有限公司在本报告期内被中国证券监督管理委员会立案调查，在报告编制日前一年内曾受到新昌县市场监督管理局、中国证券监督管理委员会的处罚。农银金融租赁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上海监管局的处罚。上海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上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。兴业证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局黑龙江省分局的处罚。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的处罚。中国交通建设股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家税务总局甘孜藏族自治州税务局的处罚。

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。

7.12.2 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规定的备选股票库情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,507.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,507.28

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金持有的部分固定收益类证券估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销,每日计提损益,并以预期信用损失为基础确认损失准备。本报告中投资组合报告公允价值部分对该部分固定收益类证券以摊余成本列示。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达恒固 18 个月封闭式债券 A	11,521	663,087.62	4,600,716,380.00	60.22%	3,038,716,085.36	39.78%
易方达恒固 18 个月封闭式债券 C	4,248	45,469.39	0.00	0.00%	193,153,977.37	100.00%
合计	15,769	496,707.87	4,600,716,380.00	58.74%	3,231,870,062.73	41.26%

§9 重大事件揭示

9.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

9.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

9.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

9.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

9.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为川财证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

9.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例
长江证券	275,841,650.00	36.70%	23,383,000,000.00	24.32%	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	90,571,720.00	12.05%	8,748,000,000.00	9.10%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	223,635,500.00	29.75%	892,000,000.00	0.93%	-	-
国信证券	80,870,800.00	10.76%	46,646,200,000.00	48.52%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	80,716,600.00	10.74%	16,468,819,000.00	17.13%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

9.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-10
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2024-01-19
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	证券时报	2024-03-29
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2024-04-20
5	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金成立于 2023 年 3 月 6 日，基金合同生效后封闭运作 18 个月，2024 年 9 月 6 日为封闭期到期日，根据基金合同约定，本基金将在封闭期到期日对基金份额进行自动赎回，基金合同将于 2024 年 9 月 7 日自动终止并进入基金财产清算程序，请投资者关注基金管理人届时发布的相关公告。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达恒固 18 个月封闭式债券型证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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

二〇二四年八月三十日