

易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

2022 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年七月二十日

§ 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 2022 年 7 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 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	1,327,275,212.17 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 (2022年4月1日-2022年6月30日)
1.本期已实现收益	20,636,476.24
2.本期利润	54,198,962.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0410
4.期末基金资产净值	1,422,613,482.68

5.期末基金份额净值	1.0718
------------	--------

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

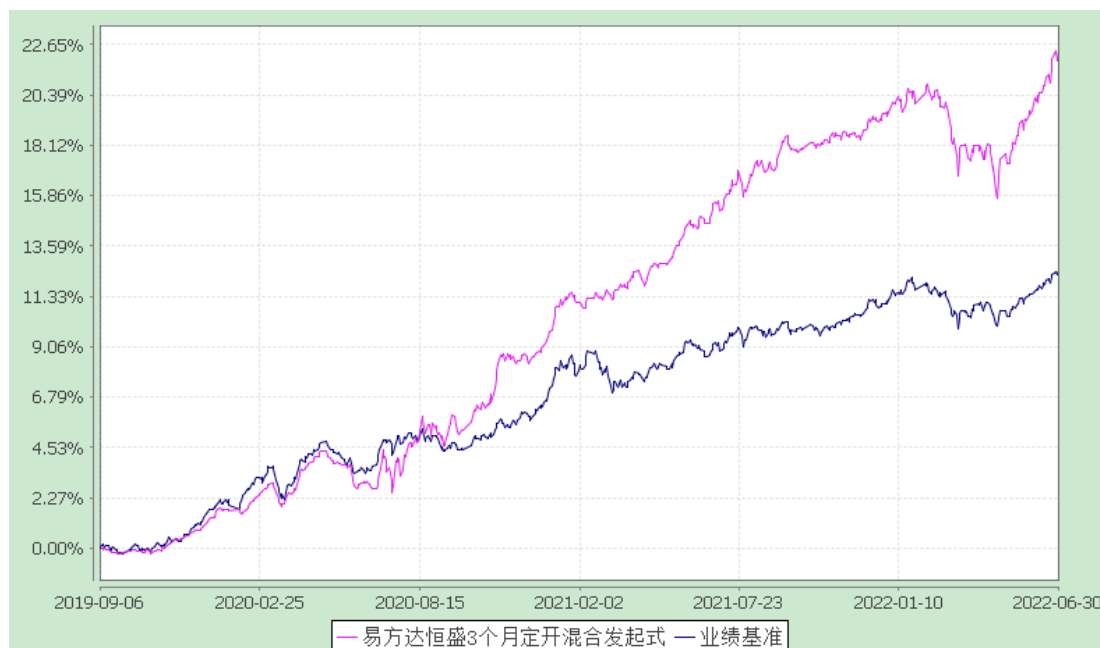
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.88%	0.30%	1.61%	0.14%	2.27%	0.16%
过去六个月	2.22%	0.28%	0.78%	0.15%	1.44%	0.13%
过去一年	5.91%	0.23%	2.88%	0.13%	3.03%	0.10%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	22.37%	0.19%	12.49%	0.13%	9.88%	0.06%

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2022年6月30日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 22.37%，同期业绩比较基准收益率为 12.49%。

§ 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型证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒益定期开放债券型发	2019-09-06	-	16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、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)基金经理、易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金

	<p>起式证券投资基金的基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理（自2019年11月02日至2022年06月08日）、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理（自2020年03月10日至2022年05月16日）、易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理（自2020年03月10日至2022年06月17日）、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员</p>				<p>基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达裕景添利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达丰惠混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理、易方达科润混合型证券投资基金（LOF）基金经理。</p>
纪玲云	<p>本基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达恒利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达裕华利率债3个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕兴3个月定期开放债券型证券投资基金的基金经</p>	2019-09-06	-	13年	<p>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年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理、易方达科润混合型证券投资基金（LOF）基金经理。</p>

理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、固定收益分类资产研究管理部总经理				
--	--	--	--	--

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，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12次，其中7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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度突如其来的新冠疫情，导致经济在稳增长的政策基调下出现了显著下

行。3月份开始各项经济指标已经出现一定下滑，而4月份随着疫情的发酵，工业生产、社会消费品零售额、地产投资、基建投资、出口等数据均出现断崖式下行，市场预期大幅走弱。在此期间决策层不断强化稳增长政策力度，并伴随着疫情逐步得到控制，物流和生产逐步放开，各项经济指标自5月份开始恢复，其中工业增加值和零售数据恢复较快，出口增速也回到历史同期高点。但固定资产投资的数据仍然较弱，其中制造业投资相对平稳，而地产和基建投资数据依然较差。金融数据在“宽信用”政策下体现出供给意愿较强但需求不足的特征。虽然在政策刺激下，我们看到金融数据呈现震荡向上态势，但是在内生增长动力不足的情况下，可能很难回到持续高增的状态。从五月份后各项经济指标反弹的顺序、结构和力度看，稳增长政策正在发挥作用，但是内生性增长动力依然不足，我们认为只有真正激发出经济内生性的活力才能使经济真正回到正常增长轨道上来。因而，就业、消费、民间投资等更能代表经济内生性活力的指标未来更值得关注。

为应对突发疫情的负面影响，宏观刺激政策不断推出，但我们认为整体看仍保持了较为克制的态度。财政政策通过加速专项债的发行使用，提升基建对冲力度；货币政策保持宽松但仍有定力，整体实现了实体经济融资成本的下行，但并未出现资本市场大水漫灌的情况。

在上述基本面和政策组合下，债券市场收益率呈现窄幅波动的特点。整体运行较为平稳，短端品种收益率有所下行，信用债表现相对较好。具体来看，10年国债收益率在2.7-2.85%之间震荡，较1季度末小幅上行3BP；1年以内品种收益率普遍下行20-30BP；信用债券收益率也普遍下行20-30BP。权益市场在二季度出现见底回升的走势。股票资产在4月份继续下跌之后，于5-6月份走出一波显著的反弹行情。沪深300指数二季度整体上涨6.21%，创业板指数上涨5.68%。行业方面汽车、食品饮料、电力设备、美容护理等板块表现较好。可转债表现也较为突出，中证转债指数整体上涨4.68%。

操作上，组合在二季度基本保持了相对偏高的股票仓位，并在5月份进一步增加可转债的仓位，在5-6月份权益市场上涨的行情中获取了较好的收益。债券方面，组合4月份继续增加有效久期至偏高水平，较好地获取了4-5月份收益率下行的资本利得收益；5月下旬之后组合逐步降低有效久期，并在5月底积极运用国债期货降低有效久期至偏低水平，有效避免了6月份以来收益率上行带来的

净值波动。同时组合保持了信用债券为主的持仓结构，获取了较好的持有期静态收益。整体看本基金在过去一个季度坚持了以绝对收益为主的投资策略，积极进行资产配置结构和个券、个股的调整，获取了相对稳健且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 1.0718 元，本报告期份额净值增长率为 3.88%，同期业绩比较基准收益率为 1.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金且发起资金持有期限不满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“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”的披露规定。

§ 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	264,635,026.07	13.85
	其中：股票	264,635,026.07	13.85
2	固定收益投资	1,570,835,893.88	82.24
	其中：债券	1,550,222,007.37	81.16
	资产支持证券	20,613,886.51	1.08
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	14,003,068.49	0.73
	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	56,230,306.73	2.94
7	其他资产	4,410,728.74	0.23
8	合计	1,910,115,023.91	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	2,461,725.80	0.17
B	采矿业	1,332,303.44	0.09
C	制造业	193,814,210.85	13.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,603,134.00	0.32
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	16,394,687.97	1.15
J	金融业	26,830,517.90	1.89
K	房地产业	6,897,858.80	0.48
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	11,815,649.74	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	255,357.10	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	264,635,026.07	18.60

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	600660	福耀玻璃	363,300	15,189,573.00	1.07

2	600346	恒力石化	579,591	12,890,103.84	0.91
3	601799	星宇股份	73,300	12,534,300.00	0.88
4	300347	泰格医药	103,100	11,799,795.00	0.83
5	002415	海康威视	321,732	11,646,698.40	0.82
6	600873	梅花生物	1,019,300	11,497,704.00	0.81
7	600519	贵州茅台	5,500	11,247,500.00	0.79
8	600036	招商银行	258,400	10,904,480.00	0.77
9	603606	东方电缆	116,600	8,931,560.00	0.63
10	002402	和而泰	445,200	8,485,512.00	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	224,198,551.79	15.76
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	465,659,533.76	32.73
5	企业短期融资券	31,041,528.76	2.18
6	中期票据	696,192,952.34	48.94
7	可转债（可交换债）	111,767,254.93	7.86
8	同业存单	-	-
9	其他	21,362,185.79	1.50
10	合计	1,550,222,007.37	108.97

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	102280944	22 大唐发电 MTN001	500,000	50,430,005.48	3.54
2	2128030	21 交通银行二级	400,000	41,530,400.00	2.92
3	2128051	21 工商银	400,000	40,872,089.86	2.87

		行二级 02			
4	149861	22BOEY1	400,000	40,708,712.33	2.86
5	185432	22 焦煤 Y1	400,000	40,630,356.16	2.86

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	183148	G 国电优	100,000	10,203,814.25	0.72
2	193933	和皖 A	100,000	10,193,490.41	0.72
3	165814	PR 安吉 5A	70,000	216,581.85	0.02

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
TF2209	TF2209	-190	-192,175,50 0.00	569,148.58	本交易期内组合利用国债期货空头交易降低组合有效久期，对冲利率上行风险。
公允价值变动总额合计（元）					569,148.58
国债期货投资本期收益（元）					-363,552.61
国债期货投资本期公允价值变动（元）					982,166.61

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，交通银行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上海市分局、中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国工商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	2,443,418.71
2	应收证券清算款	1,967,310.03
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	4,410,728.74

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	110053	苏银转债	5,064,375.07	0.36
2	127018	本钢转债	2,973,513.70	0.21
3	110079	杭银转债	2,930,355.59	0.21
4	128129	青农转债	1,891,082.07	0.13
5	113050	南银转债	1,868,477.74	0.13
6	110073	国投转债	1,604,997.53	0.11
7	127045	牧原转债	1,467,760.13	0.10
8	110083	苏租转债	1,433,252.11	0.10
9	128134	鸿路转债	1,370,160.36	0.10
10	113049	长汽转债	1,353,918.63	0.10
11	127005	长证转债	1,347,189.36	0.09
12	113625	江山转债	1,337,752.15	0.09
13	110080	东湖转债	1,311,921.17	0.09
14	110064	建工转债	1,252,255.07	0.09
15	113549	白电转债	1,243,051.30	0.09
16	127049	希望转2	1,228,156.44	0.09
17	123105	拓尔转债	1,186,610.58	0.08
18	123107	温氏转债	1,176,385.40	0.08
19	113635	升21转债	1,090,334.04	0.08
20	113598	法兰转债	1,087,626.42	0.08
21	127040	国泰转债	1,083,577.91	0.08
22	127019	国城转债	1,059,577.30	0.07
23	128139	祥鑫转债	1,050,845.14	0.07
24	123090	三诺转债	1,032,758.01	0.07
25	113519	长久转债	1,015,474.45	0.07
26	127039	北港转债	960,234.94	0.07
27	113048	晶科转债	957,189.17	0.07
28	113570	百达转债	932,348.12	0.07
29	113591	胜达转债	883,959.30	0.06
30	113030	东风转债	882,123.51	0.06
31	123063	大禹转债	867,930.37	0.06
32	113601	塞力转债	840,295.43	0.06
33	113637	华翔转债	827,007.22	0.06
34	127033	中装转2	819,179.28	0.06
35	123077	汉得转债	803,634.84	0.06
36	110072	广汇转债	797,442.58	0.06
37	128119	龙大转债	780,768.45	0.05
38	123122	富瀚转债	779,002.57	0.05
39	128127	文科转债	772,760.78	0.05
40	113630	赛伍转债	731,088.91	0.05
41	128044	岭南转债	722,401.78	0.05

42	113051	节能转债	720,534.12	0.05
43	118001	金博转债	717,885.15	0.05
44	123085	万顺转2	714,428.12	0.05
45	123120	隆华转债	700,453.64	0.05
46	113047	旗滨转债	699,112.35	0.05
47	128109	楚江转债	668,659.87	0.05
48	113600	新星转债	667,943.71	0.05
49	123127	耐普转债	654,514.15	0.05
50	127052	西子转债	642,554.34	0.05
51	113636	甬金转债	640,314.92	0.05
52	123059	银信转债	631,148.66	0.04
53	127030	盛虹转债	627,162.62	0.04
54	123109	昌红转债	626,414.21	0.04
55	110052	贵广转债	618,129.05	0.04
56	123023	迪森转债	612,093.81	0.04
57	113634	珀莱转债	571,760.71	0.04
58	111001	山玻转债	566,440.16	0.04
59	113619	世运转债	564,890.31	0.04
60	128073	哈尔转债	560,854.68	0.04
61	123103	震安转债	545,613.52	0.04
62	113577	春秋转债	536,442.31	0.04
63	128135	洽洽转债	526,096.55	0.04
64	127029	中钢转债	524,176.64	0.04
65	127027	靖远转债	514,333.42	0.04
66	127022	恒逸转债	512,157.35	0.04
67	110038	济川转债	505,288.03	0.04
68	113599	嘉友转债	495,127.40	0.03
69	128037	岩土转债	494,047.43	0.03
70	123087	明电转债	489,498.05	0.03
71	128048	张行转债	470,540.76	0.03
72	123048	应急转债	462,905.99	0.03
73	113578	全筑转债	457,730.29	0.03
74	113017	吉视转债	438,808.87	0.03
75	127042	嘉美转债	428,283.69	0.03
76	110076	华海转债	330,350.92	0.02
77	123082	北陆转债	105,764.45	0.01
78	113011	光大转债	42,533.86	0.00
79	127032	苏行转债	7,497.61	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	1,315,234,531.83
报告期期间基金总申购份额	12,040,680.34
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	1,327,275,212.17

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.7534

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	0.7534%	10,000,000.00	0.7534%	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	0.7534%	10,000,000.00	0.7534%	-

§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	2022年04月01日~2022年06月30日	1,036,344,694.54	0.00	0.00	1,036,344,694.54	78.08%
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

(1) 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，基金持续营销及募集规模可能受到影响，若基金合同生效之日起三年后的对应日基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止且不得通过召开基金份额持有人大会延续，投资者将面临基金合同终止的风险。

(2) 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

二〇二二年七月二十日