

易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金

2022 年第 4 季度报告

2022 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十日

§ 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 易方达悦盈一年持有混合 |
| 基金主代码 | 011302 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 2 月 3 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,157,626,340.63 份 |
| 投资目标 | 本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。 |
| 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、可交换债券进行投资；本基金投资资产支持证券将 |

| | | |
|-------------|---|-----------------|
| | <p>采取自上而下和自下而上相结合的投资策略；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。3、本基金将在行业分析、公司基本面分析及估值水平分析的基础上，进行股票组合的构建。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。4、本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货、股票期权合约进行交易,以对冲投资组合的风险等。</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×8%+中证港股通综合指数收益率×2% | |
| 风险收益特征 | <p>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。</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。</p> | |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达悦盈一年持有混合 A | 易方达悦盈一年持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011302 | 011303 |
| 报告期末下属分级基金 | 1,115,294,242.91 份 | 42,332,097.72 份 |

| | | |
|-------|--|--|
| 的份额总额 | | |
|-------|--|--|

§ 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 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日) | |
|----------------|---|-------------------|
| | 易方达悦盈一年持有 混合 A | 易方达悦盈一年持有 混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 6,998,555.03 | 213,563.78 |
| 2.本期利润 | -15,545,082.72 | -603,451.91 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0133 | -0.0140 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,112,563,302.18 | 41,906,411.09 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9976 | 0.9899 |

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

易方达悦盈一年持有混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 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% | 0.13% | 0.47% | 0.13% | -1.77% | 0.00% |
| 过去六个月 | -1.72% | 0.10% | 0.10% | 0.11% | -1.82% | -0.01% |
| 过去一年 | -2.70% | 0.14% | 0.98% | 0.14% | -3.68% | 0.00% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -0.24% | 0.15% | 4.02% | 0.13% | -4.26% | 0.02% |

易方达悦盈一年持有混合 C

| 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% | 0.13% | 0.47% | 0.13% | -1.87% | 0.00% |
| 过去六个月 | -1.93% | 0.10% | 0.10% | 0.11% | -2.03% | -0.01% |
| 过去一年 | -3.10% | 0.14% | 0.98% | 0.14% | -4.08% | 0.00% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | -1.01% | 0.15% | 4.02% | 0.13% | -5.03% | 0.02% |

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

易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金
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

(2021 年 2 月 3 日至 2022 年 12 月 31 日)

易方达悦盈一年持有混合 A



易方达悦盈一年持有混合 C



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-0.24%，同期业绩比较基准收益率为 4.02%；C 类基金份额净值增长率为-1.01%，同期业绩比较基准收益率为 4.02%。

§ 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，易方达丰华债券、易方达悦享一年持有混合、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，易方达安心回馈混合、易方达磐固六个月持有混合、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 | 2021-02-03 | - | 14 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。 |

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，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 9 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，3 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

四季度国内经济低位走弱，疫情扩散抑制了经济活动，地产产业链持续下行继续拖累经济表现；外部出口延续了三季度下滑的趋势，同比增速继续回落，经济仍然处在潜在产出之下。在内、外需均有压力的情况下，政策加大了调整力度，主要集中在防疫政策和房地产政策。防疫政策逐步放开，“二十条”在多方面放松了管控，降低了疫情对经济活动的影响；在房地产企业融资、预售资金监管等方面，监管层也出台了一系列放松政策。虽然政策见效尚需一段时间，但市场对未来经济预期已有所好转，信心有所恢复。预计后续随着疫情冲击结束，叠加稳增长政策持续发力，2023 年的经济将会呈现企稳复苏的态势。

四季度权益市场整体磨底，全 A 指数上涨 2.9%，沪深 300 指数上涨 1.8%，全年来看收尾于 4 月份的低点。在四季度整体国内疫情政策发生调整的情况下，市场短期面对的高频数据持续走弱和未来经济复苏的矛盾，还需要进一步的数据验证。结构数据也反映出这一点，四季度整体来看，仍是国证 2000 指数（四季度上涨 4.3%）好于大盘指数，反映了对于经济复苏的担忧仍存在。

今年以来，疫情反复、地产疲弱、资金宽松等因素推动债券收益率保持在低位，10 月份债券市场呈震荡走势。但在 11 月份，疫情政策和地产政策均有调整，对未来经济的悲观预期快速修复；回购利率和 NCD（同业存单，下同）利率大幅上行引发投资者对资金面收紧的担忧。上述因素的影响带来债券市场下跌，银行理财、债券基

金等产品净值出现下跌，投资者赎回产品导致产品类账户大幅抛售债券，进而引发负反馈，产品类账户重仓的信用债成为下跌的重灾区。在下跌的第一阶段，10 年国债收益率上行 19bp 到 2.83%。信用债供需弱于利率债，上行幅度也超过利率债，1 年 NCD 利率上行超过 60bp 到 2.65%，3 年 AAA 等级中票收益率上行 54bp 到 3.08%，3 年 AAA 等级二级资本债收益率上行 59bp 到 3.14%，信用利差有所扩大。11 月 22 日央行超预期降准带动债券市场短期企稳，但投资者依然继续赎回产品，机构抛售引发债券市场出现二次调整。在第二波调整中，10 年国债仅上行 9bp 到 2.92%，3 年 AAA 等级中票收益率上行超过 60bp，3 年 AAA 等级二级资本债收益率上行 85bp，信用利差达到历史较高水平。12 月中下旬以来，随着公开市场净投放增加，回购利率和 NCD 利率逐步下行，债券市场的配置类账户加大债券买入力度，收益率企稳下行。10 年国债收益率回到 2.84%，3 年 AAA 等级信用债收益率回落 30-40bp。

受债券市场大幅调整影响，可转债震荡下跌，估值出现压缩，本季度中证转债指数下跌 2.48%，大盘转债表现优于小盘转债。10 月到 11 月，可转债跟随正股呈震荡走势。12 月份以来，债券市场大幅调整，可转债出现连续下跌，小盘转债由于估值较贵、正股走势偏弱，下跌幅度更大。

报告期内，权益方面，由于组合净值整体进入成本区域，结合整体市场已经位于低位，组合将仓位保持在中性。整体持仓结构仍以均衡为主，行业配置上偏重于国内需求度较高的行业，以计算机、耐用消费品、食品饮料、银行为主。债券方面，由于绝对收益率和息差收益较低，组合在 10 月份降低了短端信用债仓位，杠杆率有所下降，但仍然保留了中性的组合久期。在 11 月份债券调整过程中，组合卖出部分利率债降低久期，信用债由于调整过快继续持有。在 12 月份债市第二波调整中，信用债出现超调，组合卖出利率债，替换为信用债，组合久期调整为中性偏低水平，杠杆率提高到偏高水平，力争获取票息收益和骑乘收益。转债方面，由于溢价率仍然处于高位，组合保持低配，等待更合适的加仓机会。

事后反思本轮债券市场调整，“债市下跌引发净值下跌—投资者赎回—机构抛售资产应对赎回—债市继续下跌”的负反馈放大了债券市场波动，产品户重仓持有信用债使得信用债的供需短期急剧恶化，引发信用债超预期下跌，组合净值也受到了较大影响。未来管理人将加强对机构行为的研究，加强信用债的波段操作，适当逆势操作信用债，降低组合净值波动。

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 0.9976 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 0.47%；C 类基金份额净值为 0.9899 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 0.47%。

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 | 88,103,931.01 | 5.53 |
| | 其中：股票 | 88,103,931.01 | 5.53 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,442,366,897.82 | 90.47 |
| | 其中：债券 | 1,282,531,015.69 | 80.45 |
| | 资产支持证券 | 159,835,882.13 | 10.03 |
| 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 | 21,450,345.51 | 1.35 |
| 7 | 其他资产 | 42,355,897.90 | 2.66 |
| 8 | 合计 | 1,594,277,072.24 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 2,718,935.23 元，占净值比例 0.24%。

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 | 59,627,347.78 | 5.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,266,900.00 | 0.89 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | 10,779,788.00 | 0.93 |
| 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 | 4,710,960.00 | 0.41 |
| 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 | 85,384,995.78 | 7.40 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|--------------|--------------|
| 能源 | - | - |
| 材料 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 非必需消费品 | 2,718,935.23 | 0.24 |
| 必需消费品 | - | - |
| 保健 | - | - |
| 金融 | - | - |

| | | |
|------|--------------|------|
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 2,718,935.23 | 0.24 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 600519 | 贵州茅台 | 8,000 | 13,816,000.00 | 1.20 |
| 2 | 601012 | 隆基绿能 | 262,399 | 11,088,981.74 | 0.96 |
| 3 | 600900 | 长江电力 | 488,900 | 10,266,900.00 | 0.89 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 232,200 | 8,052,696.00 | 0.70 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 144,100 | 7,464,380.00 | 0.65 |
| 6 | 601799 | 星宇股份 | 58,200 | 7,412,934.00 | 0.64 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 186,200 | 6,937,812.00 | 0.60 |
| 8 | 603259 | 药明康德 | 58,160 | 4,710,960.00 | 0.41 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 25,008 | 4,518,695.52 | 0.39 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 198,040 | 3,841,976.00 | 0.33 |

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 | 473,225,534.79 | 40.99 |
| | 其中：政策性金融债 | 60,917,953.43 | 5.28 |
| 4 | 企业债券 | 232,467,162.20 | 20.14 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 539,900,330.43 | 46.77 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 36,937,988.27 | 3.20 |

| | | | |
|----|------|------------------|--------|
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,282,531,015.69 | 111.09 |

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 | 2028037 | 20 光大银行永续债 | 500,000 | 51,634,150.68 | 4.47 |
| 2 | 102101005 | 21 中建投资 MTN001 | 500,000 | 51,219,369.86 | 4.44 |
| 3 | 200207 | 20 国开 07 | 500,000 | 50,864,109.59 | 4.41 |
| 4 | 102101795 | 21 宝钢 MTN001(可持续挂钩) | 500,000 | 50,418,375.34 | 4.37 |
| 5 | 102102257 | 21 华润 MTN003 | 500,000 | 50,393,643.84 | 4.37 |

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 | 180297 | 燕山湖 A | 200,000 | 20,185,384.11 | 1.75 |
| 2 | 183194 | 铁建 032A | 200,000 | 20,144,462.47 | 1.74 |
| 3 | 189847 | 21LJZ 优 | 200,000 | 20,143,333.92 | 1.74 |
| 4 | 183105 | 21 电 4A2 | 200,000 | 19,437,014.11 | 1.68 |
| 5 | 183208 | 铁建 033A | 100,000 | 10,043,761.64 | 0.87 |
| 6 | 136539 | 荟柒 5A | 100,000 | 10,021,027.40 | 0.87 |
| 7 | 136550 | 荟柒 7A | 100,000 | 10,019,585.21 | 0.87 |
| 8 | 136418 | 特建发优 | 100,000 | 10,008,689.16 | 0.87 |
| 9 | 183148 | G 国电优 | 100,000 | 9,995,798.90 | 0.87 |
| 10 | 183271 | 联汇 1 优 | 100,000 | 9,971,138.63 | 0.86 |

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，中国光大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北京外汇管理部、中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会北京监管局的处罚。国家开发银行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。招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、中国银行保险监督管理委员会上海监管局、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 | 40,228.12 |
| 2 | 应收证券清算款 | 42,314,469.31 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 1,200.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 42,355,897.90 |

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 | 113052 | 兴业转债 | 11,061,114.63 | 0.96 |
| 2 | 113056 | 重银转债 | 10,715,877.28 | 0.93 |

| | | | | |
|---|--------|-------|--------------|------|
| 3 | 110073 | 国投转债 | 4,517,844.64 | 0.39 |
| 4 | 123107 | 温氏转债 | 2,784,114.85 | 0.24 |
| 5 | 127045 | 牧原转债 | 2,485,233.31 | 0.22 |
| 6 | 127049 | 希望转 2 | 2,187,685.64 | 0.19 |

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 | 易方达悦盈一年持有混合A | 易方达悦盈一年持有混合C |
|---------------------------|------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,265,980,797.25 | 47,749,205.52 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 115,514.81 | 1.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 150,802,069.15 | 5,417,108.80 |
| 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 | 1,115,294,242.91 | 42,332,097.72 |

§ 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悦盈一年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《易方达悦盈一年持有期混合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

二〇二三年一月二十日