

# 易方达岁丰添利债券型证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年四月二十日

## § 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 2024 年 4 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 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	易方达岁丰添利债券（LOF）
场内简称	易基岁丰添利 LOF
基金主代码	161115
基金运作方式	契约型，本基金合同生效后三年内（含三年）封闭运作，在深圳证券交易所上市交易。封闭期结束后，本基金转为上市开放式基金（LOF）。
基金合同生效日	2010 年 11 月 9 日
报告期末基金份额总额	5,550,758,329.62 份
投资目标	本基金通过主要投资债券品种，力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在非信用类固定收益品种（国债、央行票据等）、信用

	<p>类固定收益品种（含可转换债券）、新股（含增发）申购之间的配置：1）基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和风险；2）基于对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析，考察其对固定收益市场信用利差的影响；3）基于可转换债券发行公司的基本面，债券利率水平、票息率及派息频率、信用风险等固定收益因素，以及期权定价模型，对可转换债券进行定价分析并制定相关投资策略；4）基于对新股（含增发股）发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析，预测新股（含增发股）申购的收益率以及风险；5）基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。</p>	
业绩比较基准	中债新综合财富指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达岁丰添利债券（LOF）A	易方达岁丰添利债券（LOF）C
下属分级基金的交易代码	161115	017156
报告期末下属分级基金的份额总额	4,996,639,538.63 份	554,118,790.99 份

注：自 2022 年 11 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 11 月 8 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 (2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日)	
	易方达岁丰添利债券 (LOF) A	易方达岁丰添利债券 (LOF) C
	1.本期已实现收益	70,276,924.58
2.本期利润	121,624,904.14	10,595,199.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0282	0.0257
4.期末基金资产净值	8,122,711,242.05	897,585,251.18
5.期末基金份额净值	1.6256	1.6198

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

###### 易方达岁丰添利债券（LOF）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	1.79%	0.07%	1.98%	0.06%	-0.19%	0.01%
过去六个月	2.16%	0.07%	3.41%	0.05%	-1.25%	0.02%
过去一年	3.53%	0.07%	5.85%	0.05%	-2.32%	0.02%
过去三年	13.18%	0.08%	14.97%	0.05%	-1.79%	0.03%
过去五年	37.26%	0.20%	23.35%	0.04%	13.91%	0.16%

自基金合同生效起至今	203.61%	0.36%	71.24%	0.03%	132.37%	0.33%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

## 易方达岁丰添利债券（LOF）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	1.72%	0.07%	1.98%	0.06%	-0.26%	0.01%
过去六个月	2.03%	0.07%	3.41%	0.05%	-1.38%	0.02%
过去一年	3.26%	0.07%	5.85%	0.05%	-2.59%	0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.11%	0.08%	6.33%	0.05%	-3.22%	0.03%

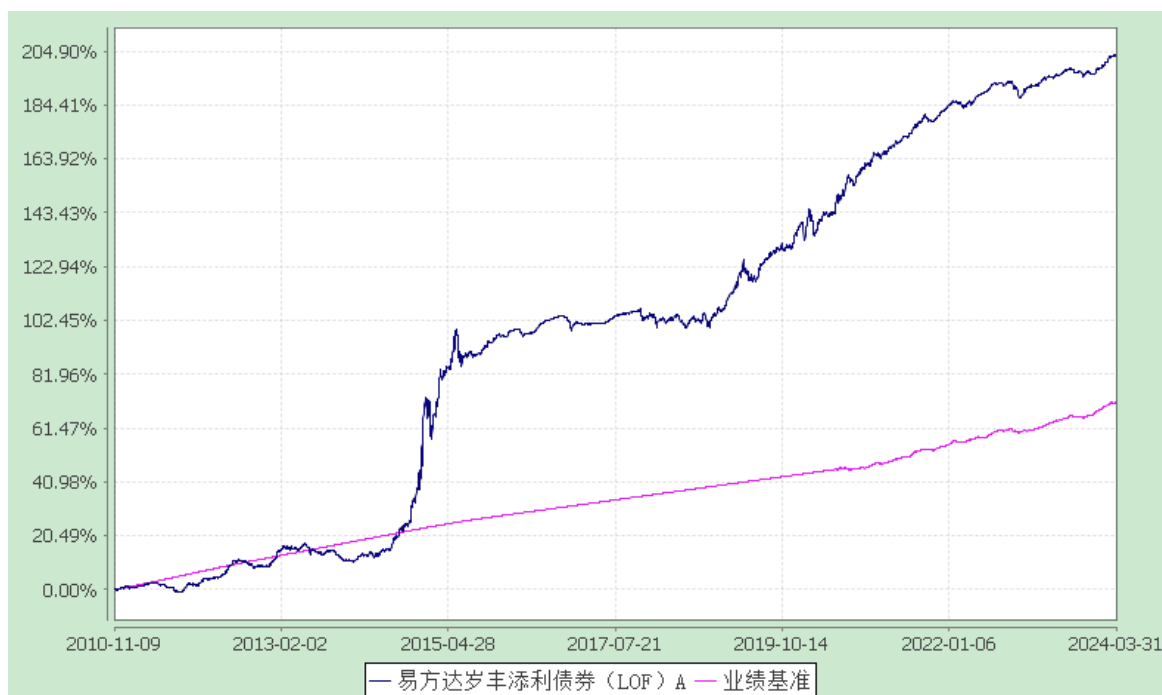
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达岁丰添利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

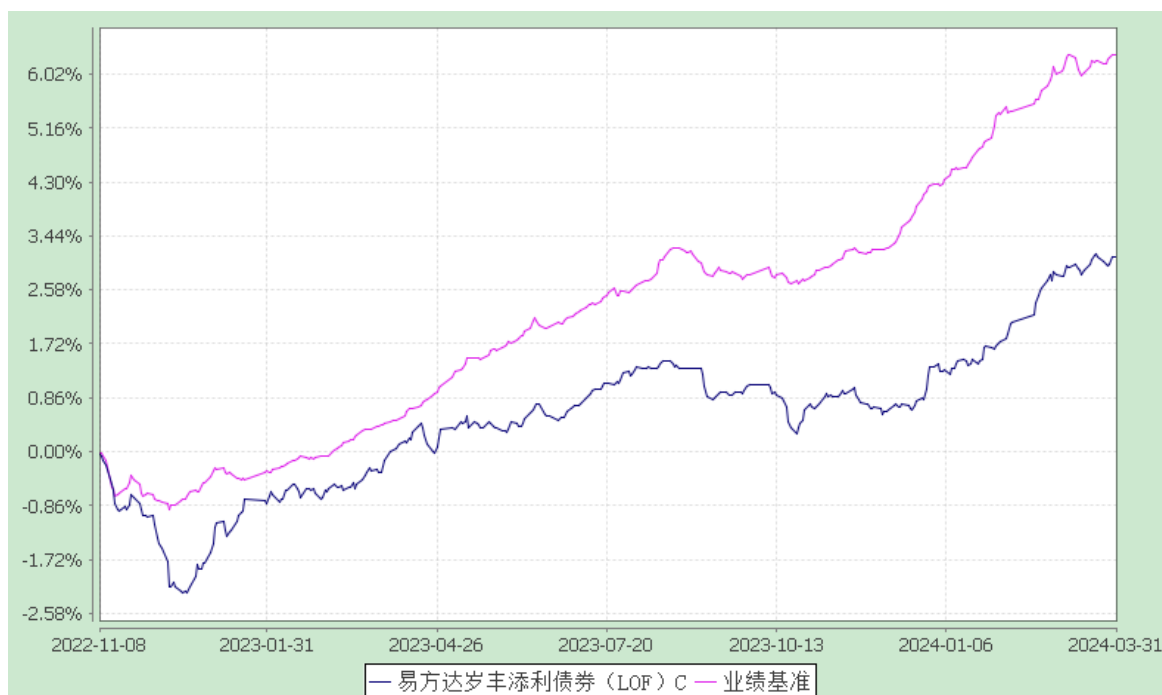
易方达岁丰添利债券（LOF）A

（2010 年 11 月 9 日至 2024 年 3 月 31 日）



### 易方达岁丰添利债券 (LOF) C

(2022 年 11 月 8 日至 2024 年 3 月 31 日)



注：1.自 2022 年 11 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 11 月 8 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自 2020 年 7 月 9 日起，本基金业绩比较基准由“三年期银行定期存款收益率+1.2%”调整为“中债新综合财富指数”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别

根据相应的指标计算。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 203.61%，同期业绩比较基准收益率为 71.24%；C 类基金份额净值增长率为 3.11%，同期业绩比较基准收益率为 6.33%。

## § 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、易方达信用债债券、易方达裕惠定开混合发起式、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达高等级信用债债券的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员、基础设施资产管理委员会委员	2019-01-04	-	18 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，易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达纯债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕惠回报债券、易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达高等级信用债债券、易方达丰惠混合、易方达瑞富混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合、易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达富惠纯债债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开债券指数、易方达恒惠定开债券发起式、易方达科润

					混合（LOF）的基金经理。
张凯嶼	本基金的基金经理，易方达双债增强债券、易方达投资级信用债债券、易方达增强回报债券、易方达高等级信用债债券、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达裕祥回报债券、易方达稳健增长混合、易方达平稳增长混合、易方达科汇灵活配置混合、易方达稳健回报混合、易方达稳健增利混合、易方达稳健添利混合的基金经理助理	2022-07-06	-	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员。

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，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 10 次，其中 8 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，2 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

一季度经济基本面数据出现较为显著的恢复，主要体现在以下几个方面。首先，全球总需求的恢复较好地支撑了中国的出口。1-2 月份的出口数据延续了 2023 年 11 月份以来的回升，劳动密集型产品是主要的贡献力量，全球电子周期的回升提振了这一趋势。其次，财政发力效果逐步显现。得益于去年四季度大量的政府债券发行，今年 1-2 月份财政支出加速，制造业投资与基建投资维持在历史较高水平。第三，春节假期旅游的火爆带动了社会消费品零售总额回升。第四，与需求端相比，生产端的恢复更为显著。1-2 月份工业增加值的环比数据达到历史同期最高水平，其中劳动密集型、食品饮料和上游冶炼化工等制造业生产回升幅度最大。然而，回升的经济数据并未大幅改善微观市场的预期。一方面房地产市场的销售并未出现实质性改善，不少城市仍然处于价格下滑的压力中。另一方面，生产比需求恢复程度更高使得不少微观产品的价格依然疲软。

政策面基本保持了平稳。财政延续“开前门、堵后门”的方向，虽然部分地区的基建投资受到化解地方债务政策的影响，但中央项目的加快推进使得基建投资整体依然保持高位。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。

从债券市场的表现来看，大部分品种的收益率出现 20-40BP 的下行。其中有静态收益、长久期的品种下行更多，譬如 30 年期国债收益率下行 37BP，10 年期 AAA-二级资本债品种收益率下行 48BP，3 年期 AA-城投收益率下行 141BP。从下行节奏上看，1-2 月份收益率基本呈现单边下行状态，3 月份之后表现为 10BP 以内的窄幅振荡。权益市场振荡筑底，结构分化。沪深 300 指数上涨 3.1%，但创业板指数仍然下跌 3.87%。行业方面，银行、石油石化、煤炭、家用电器等行业上涨超过 10%，但医药生物、计算机、电子、综合行业依然下跌 10% 以上。可转债指数先跌后涨，整体下行 0.81%。

操作上，组合在 1-2 月份保持了偏高的债券久期，随后跟随收益率下行逐步降低久期风险敞口。权益方面，可转债持仓主要以债底保护较好的平衡型和偏债型转债为

主，积极挖掘个券的机会，我们认为随着转债债性估值的提升，可转债资产进一步下跌的空间已经较为有限，存在比较好的投资价值。本基金将坚持稳健投资的原则，以获取长期有竞争力的投资收益为目标，力争以优异的业绩回报基金持有人。

#### 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 1.6256 元，本报告期份额净值增长率为 1.79%，同期业绩比较基准收益率为 1.98%；C 类基金份额净值为 1.6198 元，本报告期份额净值增长率为 1.72%，同期业绩比较基准收益率为 1.98%。

#### 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	45,337,750.79	0.47
	其中：股票	45,337,750.79	0.47
2	固定收益投资	9,404,197,316.82	98.39
	其中：债券	8,977,292,151.61	93.92
	资产支持证券	426,905,165.21	4.47
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	43,563,423.67	0.46
7	其他资产	65,278,740.21	0.68
8	合计	9,558,377,231.49	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	21,281,095.04	0.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,056,655.75	0.27
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	-	-
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	-	-
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	45,337,750.79	0.50

## 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	601117	中国化学	3,563,949	24,056,655.75	0.27
2	688308	欧科亿	441,570	8,668,019.10	0.10

3	600933	爱柯迪	365,024	6,628,835.84	0.07
4	603338	浙江鼎力	104,437	5,984,240.10	0.07

#### 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	10,067,846.99	0.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,995,817,437.02	33.21
	其中：政策性金融债	1,233,743,148.60	13.68
4	企业债券	1,123,782,248.96	12.46
5	企业短期融资券	198,639,169.95	2.20
6	中期票据	3,389,656,004.39	37.58
7	可转债（可交换债）	1,259,329,444.30	13.96
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,977,292,151.61	99.52

#### 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	230210	23 国开 10	5,300,000	558,604,360.66	6.19
2	200305	20 进出 05	2,600,000	263,122,136.99	2.92
3	230205	23 国开 05	2,000,000	208,990,246.58	2.32
4	132380060	23 三峡 GN001	2,000,000	205,135,016.39	2.27
5	2028017	20 农业银行永续债 01	1,500,000	156,378,196.72	1.73

#### 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	112450	22 沪杭优	2,600,000	248,534,422.94	2.76

2	260418	G 黄河优	500,000	51,297,268.50	0.57
3	180926	铁托 7 优	300,000	30,435,121.64	0.34
4	199337	博远 022A	300,000	30,122,916.17	0.33
5	199049	甬城投 A	200,000	20,310,508.86	0.23
6	183386	22LJZ 优	200,000	20,141,954.50	0.22
7	144050	华萃 1 优	100,000	10,019,246.58	0.11
8	156521	PR 北辰 A	100,000	8,521,967.14	0.09
9	112813	GC 曹 03A2	100,000	7,521,758.88	0.08

#### 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或原始权益人中，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。

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和原始权益人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	88,598.29
2	应收证券清算款	10,761,139.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	54,429,002.70

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	65,278,740.21

## 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	127045	牧原转债	128,785,760.76	1.43
2	113044	大秦转债	75,921,114.28	0.84
3	113641	华友转债	67,908,362.00	0.75
4	110085	通 22 转债	65,592,968.03	0.73
5	123115	捷捷转债	53,163,408.93	0.59
6	127032	苏行转债	51,882,111.65	0.58
7	113049	长汽转债	46,854,529.21	0.52
8	110059	浦发转债	45,155,328.24	0.50
9	128108	蓝帆转债	43,964,772.01	0.49
10	132020	19 蓝星 EB	40,236,825.39	0.45
11	127089	晶澳转债	32,236,287.15	0.36
12	123056	雪榕转债	31,692,309.98	0.35
13	113050	南银转债	26,692,866.26	0.30
14	113623	凤 21 转债	25,168,501.17	0.28
15	113655	欧 22 转债	24,010,999.97	0.27
16	123121	帝尔转债	22,377,723.18	0.25
17	123107	温氏转债	19,944,737.46	0.22
18	113056	重银转债	19,858,527.21	0.22
19	110095	双良转债	18,048,759.51	0.20
20	123119	康泰转 2	16,063,061.45	0.18
21	110047	山鹰转债	15,734,556.84	0.17
22	113065	齐鲁转债	14,360,710.30	0.16
23	127016	鲁泰转债	13,593,458.00	0.15
24	127049	希望转 2	13,520,637.79	0.15
25	127030	盛虹转债	10,726,787.05	0.12
26	110081	闻泰转债	10,301,241.10	0.11
27	127040	国泰转债	9,416,275.65	0.10
28	113051	节能转债	8,738,592.65	0.10
29	127084	柳工转 2	8,676,834.99	0.10
30	113669	景 23 转债	7,826,548.32	0.09
31	127031	洋丰转债	7,684,302.58	0.09
32	113584	家悦转债	7,675,363.92	0.09
33	123169	正海转债	7,577,493.62	0.08
34	113048	晶科转债	7,560,128.22	0.08

35	113033	利群转债	6,871,372.60	0.08
36	113602	景 20 转债	6,842,414.76	0.08
37	113067	燃 23 转债	6,704,538.65	0.07
38	128081	海亮转债	6,660,945.63	0.07
39	113632	鹤 21 转债	6,578,342.79	0.07
40	127022	恒逸转债	6,497,350.14	0.07
41	128116	瑞达转债	6,163,795.56	0.07
42	127061	美锦转债	5,646,426.44	0.06
43	113062	常银转债	5,595,804.79	0.06
44	123205	大叶转债	5,159,193.22	0.06
45	123196	正元转 02	5,041,274.87	0.06
46	123158	宙邦转债	5,018,815.21	0.06
47	127086	恒邦转债	4,972,273.61	0.06
48	110086	精工转债	4,686,349.32	0.05
49	118030	睿创转债	4,605,695.54	0.05
50	113045	环旭转债	4,575,624.39	0.05
51	118042	奥维转债	4,567,703.01	0.05
52	113058	友发转债	4,392,516.15	0.05
53	127039	北港转债	4,309,017.99	0.05
54	127050	麒麟转债	4,127,990.01	0.05
55	110063	鹰 19 转债	4,012,712.33	0.04
56	128049	华源转债	3,850,365.36	0.04
57	128132	交建转债	3,838,425.99	0.04
58	118044	赛特转债	3,725,537.38	0.04
59	111002	特纸转债	3,629,038.20	0.04
60	127082	亚科转债	3,627,067.73	0.04
61	123049	维尔转债	3,529,555.14	0.04
62	123153	英力转债	3,524,171.41	0.04
63	128130	景兴转债	3,372,760.45	0.04
64	113549	白电转债	3,299,653.15	0.04
65	113674	华设转债	3,277,287.80	0.04
66	113675	新 23 转债	3,232,067.46	0.04
67	113662	豪能转债	3,227,402.21	0.04
68	118043	福立转债	3,211,202.46	0.04
69	113654	永 02 转债	3,129,668.11	0.03
70	110068	龙净转债	3,064,477.38	0.03
71	113046	金田转债	3,010,719.19	0.03
72	118003	华兴转债	2,941,510.30	0.03
73	123217	富仕转债	2,665,182.50	0.03
74	132018	G 三峡 EB1	2,468,118.49	0.03
75	123191	智尚转债	2,304,238.07	0.03
76	127073	天赐转债	2,205,504.15	0.02
77	123152	润禾转债	2,170,161.26	0.02

78	123174	精锻转债	2,160,669.19	0.02
79	123099	普利转债	2,156,898.08	0.02
80	123149	通裕转债	2,151,610.46	0.02
81	123150	九强转债	1,868,822.30	0.02
82	113631	皖天转债	1,854,354.00	0.02
83	123104	卫宁转债	1,775,649.91	0.02
84	110084	贵燃转债	1,696,482.37	0.02
85	123213	天源转债	1,637,161.50	0.02
86	123194	百洋转债	1,486,024.13	0.02
87	123221	力诺转债	1,437,154.65	0.02
88	113637	华翔转债	1,386,817.97	0.02
89	123211	阳谷转债	1,324,323.99	0.01
90	113037	紫银转债	1,215,983.09	0.01
91	111011	冠盛转债	1,211,380.62	0.01
92	127055	精装转债	1,182,147.12	0.01
93	123219	宇瞳转债	1,178,852.02	0.01
94	113667	春 23 转债	1,153,736.00	0.01
95	123185	能辉转债	1,143,673.14	0.01
96	113582	火炬转债	1,137,592.18	0.01
97	110094	众和转债	1,125,243.55	0.01
98	113663	新化转债	1,124,409.49	0.01
99	113634	珀莱转债	1,109,826.38	0.01
100	113666	爱玛转债	1,106,614.29	0.01
101	123114	三角转债	1,101,687.83	0.01
102	127066	科利转债	1,079,981.49	0.01
103	113651	松霖转债	1,062,840.60	0.01
104	127088	赫达转债	1,029,136.80	0.01
105	113664	大元转债	983,111.01	0.01
106	113628	晨丰转债	936,104.90	0.01
107	111005	富春转债	903,882.16	0.01
108	127053	豪美转债	839,275.08	0.01
109	123202	祥源转债	750,077.67	0.01
110	113516	苏农转债	743,041.59	0.01
111	123147	中辰转债	555,468.31	0.01
112	111012	福新转债	553,543.03	0.01
113	123063	大禹转债	550,308.71	0.01
114	128128	齐翔转 2	491,482.88	0.01
115	127015	希望转债	470,855.80	0.01
116	127070	大中转债	408,833.48	0.00
117	118026	利元转债	374,133.63	0.00
118	123120	隆华转债	370,662.92	0.00
119	123039	开润转债	366,256.49	0.00
120	128121	宏川转债	303,696.72	0.00



121	127043	川恒转债	297,422.99	0.00
122	123208	孩王转债	283,336.30	0.00
123	128083	新北转债	245,499.70	0.00
124	113030	东风转债	223,482.66	0.00
125	123204	金丹转债	199,592.15	0.00
126	127078	优彩转债	161,447.86	0.00
127	113676	荣 23 转债	161,294.73	0.00
128	123160	泰福转债	152,541.68	0.00
129	123182	广联转债	138,061.12	0.00
130	123163	金沃转债	136,149.11	0.00
131	123087	明电转债	115,485.20	0.00
132	128105	长集转债	105,113.70	0.00
133	127090	兴瑞转债	89,559.62	0.00
134	123168	惠云转债	88,751.60	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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限 情况说明
1	600933	爱柯迪	6,628,835.84	0.07	非公开发行流通受限

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达岁丰添利债 券（LOF）A	易方达岁丰添利债 券（LOF）C
报告期期初基金份额总额	3,842,744,827.49	324,018,889.79
报告期期间基金总申购份额	2,542,206,874.64	548,527,493.65
减：报告期期间基金总赎回份额	1,388,312,163.50	318,427,592.45
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	4,996,639,538.63	554,118,790.99

## § 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岁丰添利债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达岁丰添利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

二〇二四年四月二十日