易方达丰惠混合型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2　基金产品概况

基金简称	易方达丰惠混合
基金主代码	002602
交易代码	002602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 24 日
报告期末基金份额总额	625,971,345.46 份
投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，通过积极主动的投资管理，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、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。5、本基金将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
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	中国建设银行股份有限公司

§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 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	3,122,695.10
2.本期利润	3,834,078.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0084
4.期末基金资产净值	885,811,944.57
5.期末基金份额净值	1.4151

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.自 2026 年 9 月 14 日起，本基金的基金份额净值计算小数点后保留位数由小数点后 3 位变更为小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

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	0.79%	0.23%	-2.46%	0.32%	3.25%	-0.09%
过去六个月	0.29%	0.30%	1.25%	0.32%	-0.96%	-0.02%
过去一年	3.59%	0.32%	1.26%	0.29%	2.33%	0.03%
过去三年	16.57%	0.27%	14.85%	0.28%	1.72%	-0.01%
过去五年	22.10%	0.23%	13.79%	0.27%	8.31%	-0.04%
过去七年	37.75%	0.32%	28.95%	0.29%	8.80%	0.03%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	47.11%	0.42%	44.91%	0.29%	2.20%	0.13%

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

易方达丰惠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

（2017 年 3 月 24 日至 2026 年 9 月 30 日）

§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		
罗川	本基金的基金经理，易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达新享混合、易方达瑞信混合、易方达瑞选混合的基金经理，易方达悦丰稳健债券、易方达稳健增长混合、易方达稳健回报混合、易方达稳健增利混合、易方达安心回报债券、易方达稳健添利混合的基金经理助理	2025-05-09	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中金基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司研究员。

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 62 次，其中 59 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 次为不同投资经理管理的组合因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资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

宏观环境方面，三季度国内经济延续结构性分化，生产端保持一定韧性，消费与投资需求修复仍不均衡。科技相关领域景气延续，传统部门恢复相对偏缓，出口对经济形成一定支撑。物价表现有所分化，上游价格改善向终端需求的传导仍需观察。海外利率与地缘因素带来阶段性扰动，外部环境仍存在不确定性。

债券市场方面，三季度债券市场整体偏强，收益率震荡下行。资金面总体平稳，配置需求对市场形成支撑，中长端利率有所走低，短端利率波动相对有限。信用债收益率随之下行，信用利差维持较低水平，不同期限和品种间表现有所差异。

股票市场方面，三季度股票市场震荡调整，交易活跃度较前期有所回落，行业与风格表现出现变化。科技成长板块波动加大，资源、红利及部分消费板块相对稳健，大盘蓝筹风格体现一定韧性。企业盈利修复仍有分化，市场对业绩持续性与估值匹配程度的关注有所提升。

转债市场方面，转债定价受到权益市场波动与债券市场表现的共同影响。股性品种对正股变化较为敏感，偏债性品种获得一定债底支撑，不同品种的风险收益特征有所分化。估值水平、正股基本面及转股与赎回条款等因素，仍是影响转债表现的重要变量。

债券方面，久期保持中性略超配，以高等级信用债和金融债为底仓获取票息收益，随着信用利差的持续压缩，将部分超涨的信用债仓位置换为超长期限地方债和国债品种，保持偏低的杠杆水平。股票方面，仓位整体仍维持在中性略偏低水平，旨在控制组合波动、追求更高的风险调整后收益，行业配置相对均衡，风格偏大盘均衡。

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 1.4151 元，本报告期份额净值增长率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为-2.46%。

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	130,358,404.05	14.36
	其中：股票	130,358,404.05	14.36
2	固定收益投资	764,043,303.71	84.16
	其中：债券	723,914,757.95	79.74

	资产支持证券	40,128,545.76	4.42
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	9,919,264.74	1.09
7	其他资产	3,471,374.78	0.38
8	合计	907,792,347.28	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	85,754.00	0.01
B	采矿业	4,072,890.75	0.46
C	制造业	94,191,503.17	10.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	825,661.00	0.09
E	建筑业	272,469.00	0.03
F	批发和零售业	1,338,462.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	763,272.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,662,789.45	0.53
J	金融业	19,010,156.00	2.15
K	房地产业	357,766.00	0.04
L	租赁和商务服务业	197,904.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	3,527,961.68	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	533,831.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	159,750.00	0.02

Q	卫生和社会工作	85,175.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	273,059.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	130,358,404.05	14.72

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	688825	长鑫科技	120,789	4,995,749.49	0.56
2	300750	宁德时代	11,500	3,347,765.00	0.38
3	300502	新易盛	8,300	3,228,700.00	0.36
4	300308	中际旭创	3,900	3,152,916.00	0.36
5	600036	招商银行	75,300	3,106,878.00	0.35
6	603259	药明康德	17,500	2,928,450.00	0.33
7	601318	中国平安	53,900	2,872,331.00	0.32
8	000333	美的集团	31,700	2,539,170.00	0.29
9	601899	紫金矿业	81,500	2,427,885.00	0.27
10	600183	生益科技	17,500	2,274,300.00	0.26

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	62,009,371.02	7.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	399,127,001.09	45.06
	其中：政策性金融债	48,499,869.59	5.48
4	企业债券	117,425,370.80	13.26
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	124,053,506.36	14.00
7	可转债（可交换债）	16,081,698.90	1.82
8	同业存单	-	-

9	其他	5,217,809.78	0.59
10	合计	723,914,757.95	81.72

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	2600006	26 超长特别国债 06	600,000	60,691,989.13	6.85
2	092280134	22 工行二级资本债 04A	500,000	52,158,493.15	5.89
3	312610005	26 交行 TLAC 非资本债 01BC	350,000	35,354,602.74	3.99
4	232680003	26 中行二级资本债 01BC	200,000	20,346,760.55	2.30
5	232680007	26 兴业银行二级资本债 01	200,000	20,332,998.36	2.30

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	269284	至华 2A	100,000	10,048,534.25	1.13
2	269430	耘睿 282A	100,000	10,036,928.77	1.13
3	501103	光睿 13A1	100,000	10,022,890.96	1.13
4	269735	至康 3A	100,000	10,020,191.78	1.13

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2612	IF2612	-19	-24,506,580.00	1,416,991.58	本交易期内利用股指期货调整组合权益仓位，达到预期效果。
公允价值变动总额合计(元)					1,416,991.58
股指期货投资本期收益(元)					54,667.26
股指期货投资本期公允价值变动(元)					1,615,411.58

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的进行股指期货投资，主要选择流动性好的股指期货品种进行交易，调节组合的权益仓位和结构。

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，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金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。兴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国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。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国家金融监督管理总局的处罚。中信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。

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约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,029,725.03

2	应收证券清算款	435,306.36
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,343.39
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,471,374.78

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	127056	中特转债	601,392.33	0.07
2	127049	希望转 2	599,269.28	0.07
3	113056	重银转债	599,087.22	0.07
4	110093	神马转债	598,944.93	0.07
5	113052	兴业转债	598,729.74	0.07
6	113070	渝水转债	598,152.96	0.07
7	127110	广核转债	598,017.36	0.07
8	113067	燃 23 转债	597,391.91	0.07
9	113062	常银转债	597,207.22	0.07
10	113066	平煤转债	596,764.74	0.07
11	127083	山路转债	594,050.81	0.07
12	110099	福能转债	297,865.16	0.03
13	127089	晶澳转债	261,510.16	0.03
14	127085	韵达转债	255,727.36	0.03
15	127102	浙建转债	254,914.61	0.03
16	113631	皖天转债	250,401.16	0.03
17	118034	晶能转债	249,888.62	0.03
18	110087	天业转债	249,609.40	0.03
19	110098	南药转债	248,035.06	0.03
20	113054	绿动转债	247,995.51	0.03
21	127064	杭氧转债	247,742.39	0.03
22	123257	安克转债	239,610.25	0.03
23	110097	天润转债	174,856.24	0.02
24	113700	海天转债	174,766.19	0.02
25	127054	双箭转债	173,614.01	0.02
26	110090	爱迪转债	172,343.10	0.02

27	113682	益丰转债	169,595.35	0.02
28	110086	精工转债	168,950.77	0.02
29	127046	百润转债	167,658.91	0.02
30	111002	特纸转债	166,902.16	0.02
31	123149	通裕转债	166,863.26	0.02
32	113696	伯 25 转债	166,548.43	0.02
33	113659	莱克转债	166,153.29	0.02
34	113652	伟 22 转债	166,083.15	0.02
35	113638	台 21 转债	165,432.85	0.02
36	111017	蓝天转债	165,274.88	0.02
37	127050	麒麟转债	165,212.96	0.02
38	113058	友发转债	164,852.82	0.02
39	113661	福 22 转债	163,689.08	0.02
40	127103	东南转债	163,312.93	0.02
41	110084	贵燃转债	162,775.33	0.02
42	118024	冠宇转债	162,599.92	0.02
43	113647	禾丰转债	156,490.82	0.02
44	127061	美锦转债	99,358.74	0.01
45	123154	火星转债	99,187.09	0.01
46	113656	嘉诚转债	98,958.28	0.01
47	118036	力合转债	98,491.63	0.01
48	123172	漱玉转债	88,241.29	0.01
49	123183	海顺转债	87,754.84	0.01
50	118035	国力转债	87,086.96	0.01
51	127068	顺博转债	87,081.88	0.01
52	123193	海能转债	86,987.09	0.01
53	123194	百洋转债	86,303.01	0.01
54	123171	共同转债	86,209.69	0.01
55	118010	洁特转债	86,193.26	0.01
56	111004	明新转债	85,815.40	0.01
57	123150	九强转债	85,669.23	0.01
58	118052	浩瀚转债	85,620.20	0.01
59	127105	龙星转债	85,492.66	0.01
60	123133	佩蒂转债	84,401.16	0.01
61	113650	博 22 转债	83,792.30	0.01
62	123178	花园转债	83,734.27	0.01
63	113679	芯能转债	83,733.39	0.01
64	113643	风语转债	83,413.73	0.01
65	110095	双良转债	83,292.58	0.01
66	113681	镇洋转债	83,255.21	0.01
67	113665	汇通转债	83,169.39	0.01
68	127099	盛航转债	83,037.37	0.01
69	123144	裕兴转债	83,020.32	0.01

70	113640	苏利转债	82,982.29	0.01
71	113636	甬金转债	82,803.20	0.01
72	127060	湘佳转债	82,784.28	0.01
73	123189	晓鸣转债	82,696.99	0.01
74	123155	中陆转债	82,591.58	0.01
75	111015	东亚转债	82,457.54	0.01
76	113648	巨星转债	81,564.56	0.01
77	127095	广泰转债	80,924.51	0.01
78	123165	回天转债	80,912.80	0.01
79	113695	华辰转债	77,836.17	0.01
80	123250	嘉益转债	77,259.24	0.01

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	688825	长鑫科技	3,884,827.45	0.44	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	372,700,581.34
报告期期间基金总申购份额	259,991,150.58
减：报告期期间基金总赎回份额	6,720,386.46
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	625,971,345.46

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达丰惠混合型证券投资基金注册的文件；

2.《易方达丰惠混合型证券投资基金基金合同》；

3.《易方达丰惠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。

9.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

9.3 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

二〇二六年十月二十七日