

易方达裕祥回报债券型证券投资基金

2022 年年度报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

§ 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。本年度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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	5
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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 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.....	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§ 5	托管人报告.....	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§ 6	审计报告.....	17
6.1	审计意见.....	18
6.2	形成审计意见的基础.....	18
6.3	其他信息.....	18
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任.....	18
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任.....	18
§ 7	年度财务报表.....	20
7.1	资产负债表.....	20
7.2	利润表.....	21
7.3	净资产（基金净值）变动表.....	23
7.4	报表附注.....	25
§ 8	投资组合报告.....	55
8.1	期末基金资产组合情况.....	55
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	56
8.3	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.....	57

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6	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	61
8.7	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	61
8.8	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	61
8.9	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	61
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	61
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12	投资组合报告附注	62
§ 9	基金份额持有人信息	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	64
§ 10	开放式基金份额变动	65
§ 11	重大事件揭示	65
11.1	基金份额持有人大会决议	65
11.2	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	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4	基金投资策略的改变	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8	其他重大事件	68
§ 12	备查文件目录	69
12.1	备查文件目录	69
12.2	存放地点	69
12.3	查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达裕祥回报债券型证券投资基金
基金简称	易方达裕祥回报债券
基金主代码	002351
交易代码	002351
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 1 月 22 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,544,662,162.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，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	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；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；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合指数收益率×80%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	朱萍
	联系电话	020-85102688	021-61618888
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95528
传真		020-38798812	021-63602540
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码		510620	200001
法定代表人		刘晓艳	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	1,011,043,084.67	2,393,063,919.00	1,418,054,748.54

本期利润	-2,722,439,006.00	3,966,354,773.30	2,141,638,269.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1118	0.1462	0.1853
本期加权平均净值利润率	-6.61%	8.76%	12.45%
本期基金份额净值增长率	-3.91%	9.50%	14.81%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	2,553,376,924.51	11,051,984,071.54	2,337,584,184.85
期末可供分配基金份额利润	0.1377	0.2636	0.1548
期末基金资产净值	27,954,162,017.08	72,949,111,338.61	23,984,298,977.33
期末基金份额净值	1.507	1.740	1.589
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	67.21%	74.00%	58.90%

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

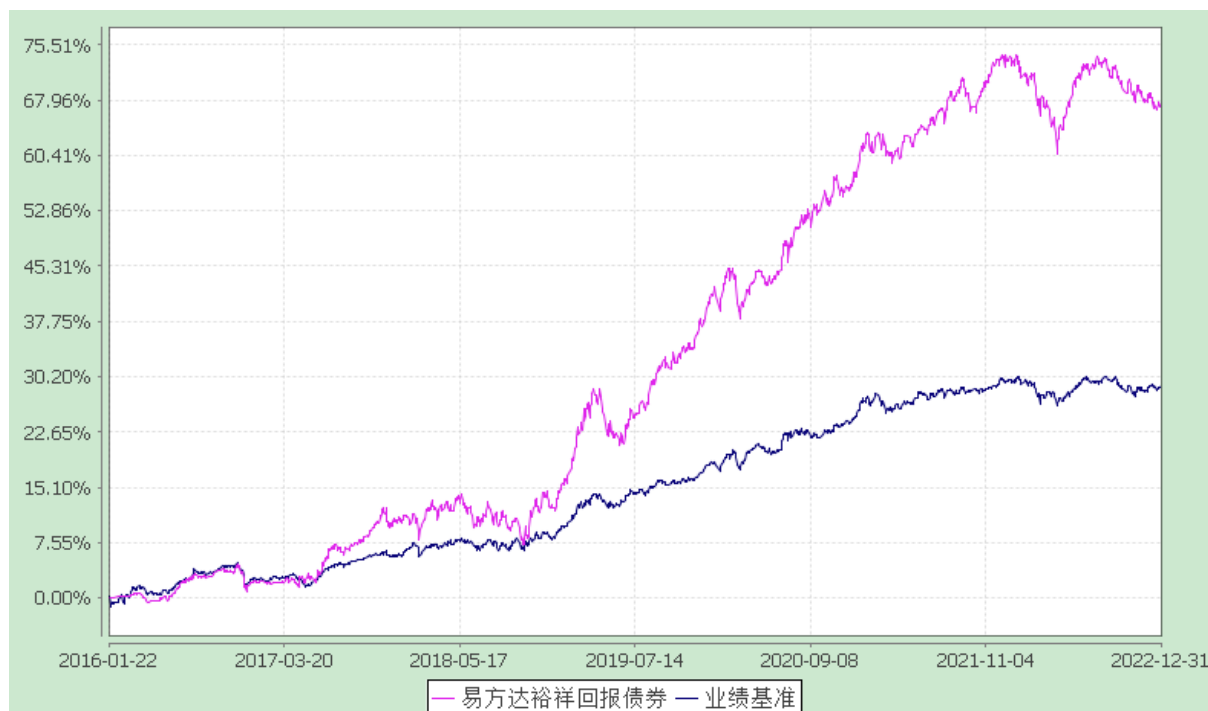
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-1.24%	0.26%	0.31%	0.18%	-1.55%	0.08%
过去六个月	-3.13%	0.24%	-0.94%	0.16%	-2.19%	0.08%
过去一年	-3.91%	0.33%	-0.78%	0.19%	-3.13%	0.14%
过去三年	20.81%	0.34%	9.34%	0.19%	11.47%	0.15%
过去五年	51.18%	0.40%	21.71%	0.19%	29.47%	0.21%
自基金合同生效起至今	67.21%	0.36%	28.86%	0.18%	38.35%	0.18%

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

易方达裕祥回报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

（2016 年 1 月 22 日至 2022 年 12 月 31 日）

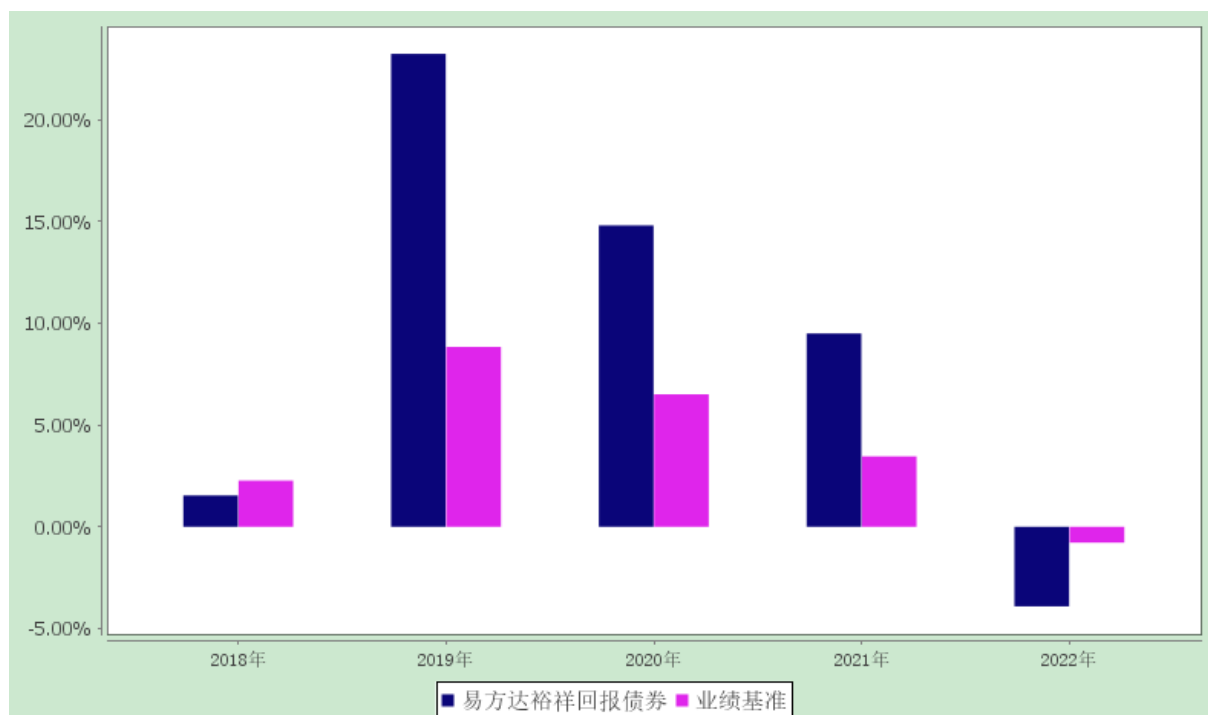


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 67.21%，同期业绩比较基准收益率为 28.86%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达裕祥回报债券型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2022 年	1.650	1,842,252,924.53	1,242,248,789.97	3,084,501,714.50	-
合计	1.650	1,842,252,924.53	1,242,248,789.97	3,084,501,714.50	-

§ 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。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，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		
林森	本基金的基金经理（报告期内已离职），易方达安心回馈混合（自 2015 年 11 月 28 日至 2022 年 05 月 06 日）、易方达瑞程混合（自 2017 年 01 月 26 日至 2022 年 05 月 06 日）、易方达瑞通混合（自 2017 年 03 月 07 日至 2022 年 05 月 06 日）、易方达瑞弘混合（自 2017 年 03 月 07 日至 2022 年 05 月 06 日）、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券（自 2018 年 02 月 10 日至 2022 年 05 月 06 日）、易方达高等级信用债债券（自 2018 年 03 月 24 日至 2022 年 05 月 06 日）的基金经理	2017-07-28	2022-05-07	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任道富银行风险管理部风险管理经理、外汇利率交易部利率交易员，太平洋资产管理公司（PIMCO）基金管理部基金经理，易方达基金管理有限公司固定收益全策略投资部联席总经理、基金经理助理，易方达新益混合、易方达新收益混合、易方达瑞选混合的基金经理。
林	本基金的基金经理，易方达安心回	2021-	-	10 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾

虎	馈混合、易方达磐泰一年持有混合的基金经理，易方达裕富债券（自 2020 年 07 月 09 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达招易一年持有混合（自 2020 年 07 月 09 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达磐恒九个月持有混合（自 2020 年 08 月 11 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达磐固六个月持有混合（自 2020 年 09 月 15 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦兴一年持有混合（自 2020 年 12 月 01 日至 2022 年 05 月 19 日）、易方达悦享一年持有混合（自 2020 年 12 月 08 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦通一年持有混合（自 2020 年 12 月 18 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦盈一年持有混合（自 2021 年 02 月 05 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦弘一年持有混合（自 2021 年 02 月 25 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦安一年持有债券（自 2021 年 04 月 28 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达宁易一年持有混合（自 2021 年 04 月 30 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达稳泰一年持有混合（自 2021 年 05 月 22 日至 2022 年 07 月 06 日）、易方达悦信一年持有混合（自 2021 年 06 月 09 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦夏一年持有混合（自 2021 年 07 月 05 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦丰一年持有混合（自 2021 年 09 月 28 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦浦一年持有混合（自 2021 年 11 月 16 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达悦融一年持有混合（自 2022 年 01 月 05 日至 2022 年 05 月 24 日）的基金经理助理	09-08			任宏源证券研究所固定收益分析师，国信证券研究所宏观分析师，易方达基金管理有限公司基金经理助理。
王晓晨	本基金的基金经理，易方达增强回报债券、易方达投资级信用债债券、易方达中债新综指发起式（LOF）（自 2014 年 07 月 05 日至 2022 年 05 月 16 日）、易方达双债增强债券、易方达恒安定开债券发起式（自 2018 年 05 月 15 日至 2022 年 09 月	2022-04-30	-	19 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集中交易室债券交易员、债券交易主管、固定收益总部总经理助理、固定收益基金投资部副总经理、固定收益投资部副总经理，易方达货币、易方达保证金货币、易方达保本一号混合、易方

	07 日)、易方达富财纯债债券(自 2018 年 10 月 26 日至 2022 年 06 月 17 日)、易方达安瑞短债债券、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式的基金经理,固定收益全策略投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员,易方达资产管理(香港)有限公司就证券提供意见负责人员(RO)、提供资产管理负责人员(RO)				达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达纯债债券、易方达恒益定开债券发起式、易方达新鑫混合、易方达中债 1-3 年国开行债券指数、易方达中债 3-5 年国开行债券指数、易方达中债 1-3 年政金债指数、易方达中债 3-5 年政金债指数的基金经理,易方达资产管理(香港)有限公司基金经理。
胡文伯	本基金的基金经理助理,易方达双债增强债券的基金经理,易方达高等级信用债债券(自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 05 月 19 日)、易方达稳健收益债券、易方达增强回报债券、易方达永旭定期开放债券、易方达中债新综指发起式(LOF)、易方达信用债债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕惠定开混合发起式、易方达裕如混合、易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达安源中短债债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式、易方达富惠纯债债券的基金经理助理	2019-09-12	-	8 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。
张凯岷	本基金的基金经理助理,易方达岁丰添利债券(LOF)的基金经理,易方达双债增强债券、易方达岁丰添利债券(LOF)(自 2016 年 03 月 16 日至 2022 年 07 月 05 日)、易方达投资级信用债债券、易方达增强回报债券、易方达中债 1-3 年国开行债券指数、易方达中债 3-5 年国开行债券指数、易方达中债 1-3 年政金债指数、易方达中债 3-5 年政金债指数(自 2019 年 12 月 10 日至 2022 年 10 月 16 日)、易方达恒安定开债券发起式、易方达高等级信用债债券、易方达裕景添利 6 个月	2021-02-10	-	11 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。

	定期开放债券、易方达安心回馈混合（自 2021 年 02 月 10 日至 2022 年 05 月 24 日）、易方达瑞通混合（自 2021 年 02 月 10 日至 2022 年 05 月 19 日）、易方达瑞弘混合（自 2021 年 02 月 10 日至 2022 年 05 月 19 日）、易方达瑞程混合（自 2021 年 02 月 10 日至 2022 年 08 月 02 日）、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				
王丹	本基金的基金经理助理，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、易方达投资级信用债债券、易方达安瑞短债债券、易方达增强回报债券的基金经理助理	2022-05-14	-	7 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任海通证券股份有限公司研究员，远大物产集团有限公司投资经理助理，富国基金管理有限公司研究员、基金经理助理。

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.自2023年1月1日起，胡文伯不再担任本基金的基金经理助理。

5.根据2023年3月4日《易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理变更公告》，自2023年3月4日起，林虎不再担任本基金的基金经理，王晓晨仍担任本基金的基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的

适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 42 次，其中 27 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，15 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。

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

2022 年国内宏观经济受到海内外多种因素影响，面临较大挑战。年初俄乌冲突爆发，给全球政治、贸易、能源带来了巨大的影响，发达经济体普遍面临滞胀风险，海外增长前景恶化。虽然 2022 年上半年我国出口维持较高增速，但在下半年出现了明显放缓和拖累。国内随后又经历了疫情的多次反复，消费受到压制，社会消费品零售额同比增速逐步下行，制造业也不时受到疫情的影响。地产景气度全年都较弱，月度销售数据同比增速维持在低位，同时行业投资增速也继续下行，地产上下游产业链都受到了较大影响，对经济负面影响较大。

债券市场在 2022 年经历了牛熊转换，1-10 月虽然有一些波动和分化，但在宽松的货币环境和较强的配置需求下，债券资产总体表现仍然较好。结构上，由于央行较长时间维持了相对宽松的货币政策，市场资金面一直处于宽松的态势，短端债券表现较好，长端债券则同时受疫情和稳增长预期扰动，维持窄幅震荡的格局，债券市场整体收益率曲线陡峭化。11 月以后，地产政策不断放松叠加疫情防控政策优化，市场对于国内经济增长的乐观预期快速升温，导致债券收益率大幅走高，短端收益率上行幅度大于长端，曲线由牛陡迅速切换至熊平。同时在债券下跌的过程中，部分银行理财产品的净值出现了超客户预期的调整，引发了集中赎回，导致信用债的收益率进一步上行，信用利差显著扩大。

股票市场方面，2022 年市场整体下行。1-4 月，地缘政治摩擦升级及国内疫情扩散是市场整体下跌的主要超预期风险。5-6 月，随着国内疫情得到控制、复工复产稳步推进以及稳增长政策的落实，市场对疫后经济修复的预期回暖，同时人民币贬值暂缓，海外资金回流 A 股，汽车、新能源、消费等板块均出现较大幅度反弹。7-10 月，经济基本面疲软，受到疫情和地产的双重压制，叠加海外加息扰动，市场震荡下行。11-12 月，稳增长政策发力，地产和防疫政策加速放松，市场小幅反弹。

报告期内本基金维持了中性的杠杆水平。债券方面，组合主要持仓高等级信用债以获取票息收益；股票方面，组合仓位基本稳定，2022 年权益市场波动较大，虽然债券资产进行了部分对冲，但组合中权益资产的下跌还是对基金净值造成了损失。转债方面，鉴于股票仓位已经不低，同时组合今年的风险预算有限，我们在转债部分保持了较低的仓位。

4.4.2 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 1.507 元，本报告期份额净值增长率为-3.91%，同期业绩比较基准收益率为-0.78%。

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 2023 年，随着疫情的逐渐消散，国内经济触底回升是大概率事件，但是修复的高度仍然具

有不确定性。2022 年影响经济的两个主要因素是疫情和地产。2023 年在第一波疫情达峰后，疫情的影响预计会越来越弱；地产方面，稳地产的各种政策不断出台，虽然目前三四线城市的需求改善还未出现，但是一线城市的情绪已经有了较为明显的恢复，2022 年 12 月 15 日国务院副总理刘鹤表示“房地产是国民经济的支柱产业”，随后中央财办也表示“要充分认识到房地产行业的重要性”。此外，地方政府在年初的发声，也体现出地方政府发展经济的较强意愿。但我们认为经济的修复高度仍面临较大的不确定性，一方面，美国经济在 2023 年大概率放缓或进入衰退，外需存在一定压力；另一方面，疫情三年，企业与个人的资产负债表均等待修复，政府尤其是地方政府的资产负债表也面临挑战，可能会影响到财政支出的力度。综合来看，2023 年经济将逐渐进入复苏通道，但复苏的高度较难预判，地产、外需和财政支出力度是主要的决定因素。

鉴于国内经济处于修复的过程中，货币政策预计仍是稳健的政策基调，以年为单位仍有降准的必要性和可能性，拉长时间维度的资金利率可能仍在低位。债券市场方面，在经历 2022 年四季度收益率的大幅上行后，债券资产尤其是中短期债券已经具备较好的配置价值。展望全年，债券可能呈现区间震荡走势。

对于权益市场，疫情期间企业的产能投放普遍克制，疫后国内经济逐步修复，随着需求的改善，企业整体盈利有望修复。随着经济和风险偏好的逐步修复，2023 年权益市场的表现或将好于 2022 年，我们整体持谨慎乐观态度。组合计划重点配置一些历史数据验证优秀、行业地位高、竞争力强、护城河深，同时景气度向上、估值合理的优质标的。

基于以上判断，本基金债券部分将继续维持合理的久期和组合杠杆，提高债券资产的流动性。组合将精选个券，重点关注信用风险，积极寻找交易机会。权益部分，组合将继续按照追求确定性的思路，自下而上精选个股。组合构建上，我们倾向于维持较高的个股分散度，并注重股债宏观对冲效果，希望能降低组合波动，提升组合夏普比率，给投资者带来更好的持有体验。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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

（1）不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上的核心价值观，加强员工合规风控、廉洁从业教育培训并完善合规监督考评机制，筑牢廉洁从业的红线认识，不断提高员工合规风控意识。

(2) 坚持投资合规风险闭环管理,认真贯彻落实法律法规、基金合同和公司制度的各项控制要求,持续完善投资合规风控制度流程和系统工具,加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示、情况核查和结果跟踪;持续推动投资、研究、交易等业务部门完善相应内控机制;加强公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制,有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

(3) 持续提升产品合规审查质量,督促健全基金募集申请材料质量内控机制和工具手段;坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提,审慎评估论证各类新产品与新业务方案,全面充分揭示产品风险特征,切实保护投资者合法权益。

(4) 持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求,加强营销宣传、销售、客服等环节的合规管控,深入落实投资者适当性管理,妥善处理客户投诉纠纷,切实加大投资者教育和保护力度,着力提高投资者获得感。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定,完善信息披露管理工作机制流程,不断提高信息披露文件制作、审核、报送的系统化水平,做好公司及旗下各基金的信息披露工作,确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 贯彻落实风险为本的工作方法,进一步修订制度流程、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用,建立健全洗钱风险自评估工作机制,扎实开展风险自评估,持续完善风险管控措施,不断提高反洗钱合规和风险管理水平。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据,有计划、有重点地对投研交易、基金销售、产品运营、信息技术、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查,同时参考国际标准,聘请外部机构开展内控合规评估和业绩标准鉴证,报告期内通过 ISAE3402 (国际鉴证业务准则 3402 号) 内控鉴证和 GIPS (全球投资业绩标准) 鉴证,通过内外部不同视角审视公司内控机制和执行情况,提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,努力防范和控制重大风险,充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 3,084,501,714.50 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对易方达裕祥回报债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对易方达裕祥回报债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

安永华明（2023）审字第 60468000_G15 号

易方达裕祥回报债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达裕祥回报债券型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达裕祥回报债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达裕祥回报债券型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达裕祥回报债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

易方达裕祥回报债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达裕祥回报债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达裕祥回报债券型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出

具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达裕祥回报债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达裕祥回报债券型证券投资基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

昌华 马婧

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2023 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达裕祥回报债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,856,984.52	1,726,959.20
结算备付金		15,339,715.74	437,195,604.42
存出保证金		1,441,447.84	2,681,493.26
交易性金融资产	7.4.7.2	33,810,038,342.65	82,069,040,355.88
其中：股票投资		5,071,859,176.65	14,277,454,813.68
基金投资		-	-
债券投资		28,584,850,893.54	67,323,768,642.20
资产支持证券投资		153,328,272.46	467,816,900.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	107,000,253.50
应收清算款		494,466,606.71	4,766,896.97
应收股利		-	-
应收申购款		2,675,110.66	59,139,569.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	960,474,641.59
资产总计		34,325,818,208.12	83,642,025,774.06
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,612,169,440.67	10,589,373,930.11
应付清算款		225,500,556.00	14,522,381.71
应付赎回款		518,323,010.28	50,390,414.20
应付管理人报酬		10,393,923.17	23,385,462.57
应付托管费		2,598,480.81	5,846,365.62
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		901,817.22	3,452,804.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,768,962.89	5,943,076.29
负债合计		6,371,656,191.04	10,692,914,435.45
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	18,544,662,162.99	41,930,708,370.35
未分配利润	7.4.7.8	9,409,499,854.09	31,018,402,968.26
净资产合计		27,954,162,017.08	72,949,111,338.61
负债和净资产总计		34,325,818,208.12	83,642,025,774.06

注：1.报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.507 元，基金份额总额 18,544,662,162.99 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：易方达裕祥回报债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-2,426,909,507.92	4,352,718,945.63
1.利息收入		4,206,848.08	1,496,327,696.45
其中：存款利息收入	7.4.7.9	3,687,431.06	6,707,252.05
债券利息收入		-	1,466,787,543.97
资产支持证券利息收入		-	22,004,355.51
买入返售金融资产收入		519,417.02	828,544.92
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,249,616,004.68	1,250,151,987.39
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-164,767,775.75	910,380,130.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,280,951,171.92	211,990,409.07
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	11,133,017.01	226,325.32
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	122,299,591.50	127,555,122.89
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-3,733,482,090.67	1,573,290,854.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	52,749,729.99	32,948,407.49
减：二、营业总支出		295,529,498.08	386,364,172.33
1. 管理人报酬		167,023,460.93	180,163,404.86
2. 托管费		41,755,865.35	45,040,851.18
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		84,327,886.74	125,297,979.41

其中：卖出回购金融资产支出		84,327,886.74	125,297,979.41
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		2,067,217.75	4,090,229.91
8. 其他费用	7.4.7.18	355,067.31	31,771,706.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,722,439,006.00	3,966,354,773.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,722,439,006.00	3,966,354,773.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,722,439,006.00	3,966,354,773.30

注：1.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年度利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

2.上表中以下本期数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：本年度报告利润表中“投资收益”项目对应品种的投资收益已扣减对应投资品种产生的交易费用。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达裕祥回报债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	41,930,708,370.35	31,018,402,968.26	72,949,111,338.61
二、本期期初净资产（基金净值）	41,930,708,370.35	31,018,402,968.26	72,949,111,338.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-23,386,046,207.36	-21,608,903,114.17	-44,994,949,321.53
（一）、综合收益总额	-	-2,722,439,006.00	-2,722,439,006.00
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	-23,386,046,207.36	-15,801,962,393.67	-39,188,008,601.03

号填列)			
其中：1.基金申购款	9,998,712,072.46	6,894,776,576.78	16,893,488,649.24
2.基金赎回款	-33,384,758,279.82	-22,696,738,970.45	-56,081,497,250.27
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-3,084,501,714.50	-3,084,501,714.50
四、本期期末净资产(基金净值)	18,544,662,162.99	9,409,499,854.09	27,954,162,017.08
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	15,098,409,604.05	8,885,889,373.28	23,984,298,977.33
二、本期期初净资产(基金净值)	15,098,409,604.05	8,885,889,373.28	23,984,298,977.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	26,832,298,766.30	22,132,513,594.98	48,964,812,361.28
(一)、综合收益总额	-	3,966,354,773.30	3,966,354,773.30
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	26,832,298,766.30	18,166,158,821.68	44,998,457,587.98
其中：1.基金申购款	43,389,976,755.89	29,122,524,607.08	72,512,501,362.97
2.基金赎回款	-16,557,677,989.59	-10,956,365,785.40	-27,514,043,774.99
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	41,930,708,370.35	31,018,402,968.26	72,949,111,338.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达裕祥回报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[2016]13 号《关于准予易方达裕祥回报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《易方达裕祥回报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, 《易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 1 月 22 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 681,094,039.00 份基金份额, 其中认购资金利息折合 12,942.02 份基金份额。本基金为契约型开放式基金, 存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司, 基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制, 同时, 在信息披露和估值方面, 也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外, 均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债), 并形成其他单位的金融负债(或资产)或权

益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定

的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的相关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公

允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3)每一基金份额享有同等分配权；

(4)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工

具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,726,959.20 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 6,602.54 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,733,561.74 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 437,195,604.42 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 196,738.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 437,392,342.42 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,681,493.26 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,206.70 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,682,699.96 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 107,000,253.50 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 7,265.39 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 107,007,518.89 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 960,474,641.59 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 6,602.54 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 196,738.00 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 1,206.70 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 960,262,828.96 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 7,265.39 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 82,069,040,355.88 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 960,262,828.96 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 83,029,303,184.84 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,589,373,930.11 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 1,688,414.22 元。经上述重分类后，卖

出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,591,062,344.33 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,688,414.22 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 1,688,414.22 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,856,984.52	1,726,959.20
等于：本金	1,831,723.70	1,726,959.20
加：应计利息	25,260.82	-
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	1,856,984.52	1,726,959.20

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,966,718,995.46	-	5,071,859,176.65	-894,859,818.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,945,083,169.16	94,873,193.88	6,841,517,726.43	-198,438,636.61
	银行间市场	21,645,936,778.91	277,149,967.11	21,743,333,167.11	-179,753,578.91
	合计	28,591,019,948.07	372,023,160.99	28,584,850,893.54	-378,192,215.52

资产支持证券		152,534,075.28	679,872.46	153,328,272.46	114,324.72
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		34,710,273,018.81	372,703,033.45	33,810,038,342.65	-1,272,937,709.61
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		12,281,296,393.51	-	14,277,454,813.68	1,996,158,420.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	14,268,731,927.38	-	14,341,001,242.20	72,269,314.82
	银行间市场	52,591,010,510.61	-	52,982,767,400.00	391,756,889.39
	合计	66,859,742,437.99	-	67,323,768,642.20	464,026,204.21
资产支持证券		467,457,143.32	-	467,816,900.00	359,756.68
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		79,608,495,974.82	-	82,069,040,355.88	2,460,544,381.06

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2022 年 12 月 31 日
----	-------------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	107,000,253.50	-
合计	107,000,253.50	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	960,474,641.59
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	960,474,641.59

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	199.56	4.18
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,657,663.33	4,023,557.89
其中：交易所市场	1,420,814.91	3,795,299.40
银行间市场	236,848.42	228,258.49
应付利息	-	1,688,414.22

预提费用	111,100.00	231,100.00
合计	1,768,962.89	5,943,076.29

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	41,930,708,370.35	41,930,708,370.35
本期申购	9,998,712,072.46	9,998,712,072.46
本期赎回（以“-”号填列）	-33,384,758,279.82	-33,384,758,279.82
本期末	18,544,662,162.99	18,544,662,162.99

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

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	11,051,984,071.54	19,966,418,896.72	31,018,402,968.26
本期利润	1,011,043,084.67	-3,733,482,090.67	-2,722,439,006.00
本期基金份额交易产生的变动数	-6,425,148,517.20	-9,376,813,876.47	-15,801,962,393.67
其中：基金申购款	2,741,027,686.06	4,153,748,890.72	6,894,776,576.78
基金赎回款	-9,166,176,203.26	-13,530,562,767.19	-22,696,738,970.45
本期已分配利润	-3,084,501,714.50	-	-3,084,501,714.50
本期末	2,553,376,924.51	6,856,122,929.58	9,409,499,854.09

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	520,405.36	1,565,437.66
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	3,122,428.83	5,100,545.62
其他	44,596.87	41,268.77
合计	3,687,431.06	6,707,252.05

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-164,767,775.75	910,380,130.11
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-164,767,775.75	910,380,130.11

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	12,200,729,646.65	9,515,441,017.20
减：卖出股票成本总额	12,339,302,621.16	8,605,060,887.09
减：交易费用	26,194,801.24	-
买卖股票差价收入	-164,767,775.75	910,380,130.11

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	1,154,398,116.24	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	126,553,055.68	211,990,409.07
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	1,280,951,171.92	211,990,409.07
----	------------------	----------------

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	93,013,875,053.88	21,038,395,080.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	91,473,253,275.15	20,446,519,211.32
减：应计利息总额	1,413,338,564.72	379,885,459.85
减：交易费用	730,158.33	-
买卖债券差价收入	126,553,055.68	211,990,409.07

7.4.7.12 资产支持证券投资收益**7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	11,133,085.05	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-68.04	226,325.32
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	11,133,017.01	226,325.32

7.4.7.12.2 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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	435,306,423.90	213,048,228.42
减：卖出资产支持证券成本总额	424,923,068.04	207,226,044.27
减：应计利息总额	10,383,423.90	5,595,858.83

减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-68.04	226,325.32

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	122,299,591.50	127,555,122.89
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	122,299,591.50	127,555,122.89

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-3,733,482,090.67	1,573,290,854.30
——股票投资	-2,891,018,238.98	724,911,378.12
——债券投资	-842,218,419.73	847,505,184.95
——资产支持证券投资	-245,431.96	874,291.23
——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	-3,733,482,090.67	1,573,290,854.30

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	52,749,729.99	32,947,581.10
其他	-	826.39
合计	52,749,729.99	32,948,407.49

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	111,100.00	111,100.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	31,500.00	31,500.00
银行汇划费	91,267.31	90,826.35
其他	1,200.00	1,200.00
交易费用	-	31,417,080.62
合计	355,067.31	31,771,706.97

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1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。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东

广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

注：1. 珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）自 2022 年 9 月 9 日起名称分别变更为珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）。

2. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	167,023,460.93	180,163,404.86
其中：支付销售机构的客户维护费	13,300,135.17	7,669,584.73

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	41,755,865.35	45,040,851.18

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日

银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	242,353,413.84	102,746,888.36	-	-	-	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	491,959,008.51	182,735,671.24	-	-	1,300,000,000.00	198,310.27

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	153,902,413.58	0.3670%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规

定支付。

7.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行-活期存款	1,856,984.52	520,405.36	1,726,959.20	1,565,437.66

注：本基金的上述银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

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	2022-11-04	-	2022-11-04	0.330	413,140,749.84	233,962,290.72	647,103,040.56	-
2	2022-12-21	-	2022-12-21	1.320	1,429,112,174.69	1,008,286,499.25	2,437,398,673.94	-
合计				1.650	1,842,252,924.53	1,242,248,789.97	3,084,501,714.50	-

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
112450	22 沪杭优	2022-11-24	1-6 个月（含）	新发流通受限	100.00	100.29	900,000	90,000,000.00	90,261,290.96	-
112561	22 和闽优	2022-12-13	1-6 个月（含）	新发流通受限	100.00	100.17	200,000	20,000,000.00	20,034,717.81	-

7.4.12.2 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暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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 2,738,527,984.70 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
092280014	22 上海银行二级资本债 01	2023-01-03	100.36	988,000	99,156,751.91
2128028	21 邮储银行二级 01	2023-01-03	100.87	2,609,000	263,163,840.02
220206	22 国开 06	2023-01-03	101.05	2,922,000	295,262,416.11
220211	22 国开 11	2023-01-03	100.54	6,295,000	632,889,469.45
220305	22 进出 05	2023-01-03	101.67	68,000	6,913,837.59
220402	22 农发 02	2023-01-03	102.12	2,500,000	255,305,342.47
2228001	22 邮储银行永续债 01	2023-01-03	101.33	4,952,000	501,781,601.45
2120089	21 北京银行永续债 01	2023-01-04	101.75	3,333,000	339,117,865.64
092280014	22 上海银行二级资本债 01	2023-01-05	100.36	512,000	51,384,875.49
092280080	22 光大银行二级资本债 01A	2023-01-05	97.91	976,000	95,559,491.51

102000296	20 中化工(疫情防控债)MTN005B	2023-01-05	102.81	500,000	51,404,660.27
102100192	21 首旅 MTN003	2023-01-05	103.99	300,000	31,195,536.99
102280982	22 洋河 MTN002	2023-01-05	101.57	100,000	10,157,366.58
102281054	22 沪杭甬 MTN001	2023-01-05	101.37	300,000	30,411,690.41
102281528	22 保利发展 MTN004	2023-01-05	101.40	295,000	29,913,961.78
102282433	22 宁沪高 MTN003	2023-01-05	98.36	500,000	49,177,671.23
101900235	19 豫投资 MTN001	2023-01-06	104.99	1,100,000	115,486,492.60
102280189	22 中车集 MTN001	2023-01-06	102.32	1,500,000	153,487,232.88
102281208	22 中电投 MTN016	2023-01-06	101.43	580,000	58,827,346.96
合计				30,330,000	3,070,597,451.34

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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 2,873,641,455.97 元，于 2023 年 1 月 3 日、2023 年 1 月 4 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金在日常经营活动中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。

7.4.13.2 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 2022 年 12 月 31 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 94.75%(2021 年 12 月 31 日：85.99%)。

7.4.13.2.1 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	10,232,916.16	51,672,468.49
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	1,744,744,767.13	3,907,025,523.31
合计	1,754,977,683.29	3,958,697,991.80

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。

7.4.13.2.2 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 2022年12月31日	上年度末 2021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

7.4.13.2.3 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 2022年12月31日	上年度末 2021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

7.4.13.2.4 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	22,289,939,153.80	52,935,935,687.74
AAA 以下	1,555,414,529.32	6,586,196,351.25
未评级	2,984,519,527.13	4,798,201,725.88
合计	26,829,873,210.25	64,320,333,764.87

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。

7.4.13.2.5 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	153,328,272.46	452,536,337.78
AAA 以下	0.00	20,280,276.71
未评级	0.00	0.00
合计	153,328,272.46	472,816,614.49

7.4.13.2.6 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.3 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开放式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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2022 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,856,984.52	-	-	-	1,856,984.52
结算备付金	15,339,715.74	-	-	-	15,339,715.74
存出保证金	1,441,447.84	-	-	-	1,441,447.84
交易性金融资产	2,894,102,042.20	15,692,716,186.25	10,151,360,937.55	5,071,859,176.65	33,810,038,342.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	494,466,606.71	494,466,606.71
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,675,110.66	2,675,110.66
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,912,740,190.30	15,692,716,186.25	10,151,360,937.55	5,569,000,894.02	34,325,818,208.12
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	5,612,169,440.67	-	-	-	5,612,169,440.67
应付清算款	-	-	-	225,500,556.00	225,500,556.00
应付赎回款	-	-	-	518,323,010.28	518,323,010.28
应付管理人报酬	-	-	-	10,393,923.17	10,393,923.17
应付托管费	-	-	-	2,598,480.81	2,598,480.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	901,817.22	901,817.22
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,768,962.89	1,768,962.89
负债总计	5,612,169,440.67	-	-	759,486,750.37	6,371,656,191.04
利率敏感度缺口	-2,699,429,250.37	15,692,716,186.25	10,151,360,937.55	4,809,514,143.65	27,954,162,017.08
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,726,959.20	-	-	-	1,726,959.20
结算备付金	437,195,604.42	-	-	-	437,195,604.42
存出保证金	2,681,493.26	-	-	-	2,681,493.26
交易性金融资产	6,466,270,294.40	40,049,471,790.47	21,275,843,457.33	14,277,454,813.68	82,069,040,355.88
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	107,000,253.50	-	-	-	107,000,253.50
应收证券清算款	-	-	-	4,766,896.97	4,766,896.97
应收利息	-	-	-	960,474,641.59	960,474,641.59
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	59,139,569.24	59,139,569.24
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,014,874,604.78	40,049,471,790.47	21,275,843,457.33	15,301,835,921.44	83,642,025,772.08

			3	8	4.06
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	10,589,373,930.11	-	-	-	10,589,373,930.11
应付证券清算款	-	-	-	14,522,381.71	14,522,381.71
应付赎回款	-	-	-	50,390,414.20	50,390,414.20
应付管理人报酬	-	-	-	23,385,462.57	23,385,462.57
应付托管费	-	-	-	5,846,365.62	5,846,365.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	4,023,557.89	4,023,557.89
应交税费	-	-	-	3,452,804.95	3,452,804.95
应付利息	-	-	-	1,688,414.22	1,688,414.22
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	231,104.18	231,104.18
负债总计	10,589,373,930.11	-	-	103,540,505.34	10,692,914,435.45
利率敏感度缺口	-3,574,499,325.33	40,049,471,790.47	21,275,843,457.33	15,198,295,416.14	72,949,111,338.61

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。

7.4.13.4.1.2 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	178,684,922.69	409,609,180.88
	2.市场利率上升 25 个基点	-176,840,668.24	-405,053,354.41

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,071,859,176.65	18.14	14,277,454,813.68	19.57
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,071,859,176.65	18.14	14,277,454,813.68	19.57

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,911,632,260.05	3,891,971,368.53
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,911,632,260.05	-3,891,971,368.53

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	6,603,806,199.56	15,921,842,659.33
第二层次	27,206,232,143.09	66,147,197,696.55
第三层次	-	-
合计	33,810,038,342.65	82,069,040,355.88

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	5,071,859,176.65	14.78
	其中：股票	5,071,859,176.65	14.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,738,179,166.00	83.72
	其中：债券	28,584,850,893.54	83.28
	资产支持证券	153,328,272.46	0.45

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	17,196,700.26	0.05
8	其他各项资产	498,583,165.21	1.45
9	合计	34,325,818,208.12	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	252,017,968.00	0.90
C	制造业	3,720,330,353.04	13.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	105,088,464.62	0.38
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	292,129,863.56	1.05
H	住宿和餐饮业	2,497,380.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	126,865,611.13	0.45
J	金融业	314,734,218.33	1.13
K	房地产业	72,692,352.20	0.26
L	租赁和商务服务业	170,856,383.77	0.61
M	科学研究和技术服务业	14,646,582.00	0.05
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	5,071,859,176.65	18.14

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601799	星宇股份	3,036,598	386,771,487.26	1.38
2	600219	南山铝业	107,332,064	350,975,849.28	1.26
3	601088	中国神华	7,500,000	207,150,000.00	0.74
4	600660	福耀玻璃	5,822,147	204,182,695.29	0.73
5	600438	通威股份	4,989,086	192,478,937.88	0.69
6	300124	汇川技术	2,403,074	167,013,643.00	0.60
7	600057	厦门象屿	14,434,851	148,245,919.77	0.53
8	601166	兴业银行	7,859,682	138,251,806.38	0.49
9	000858	五粮液	698,530	126,217,385.70	0.45
10	600031	三一重工	7,807,991	123,366,257.80	0.44
11	600887	伊利股份	3,922,600	121,600,600.00	0.43
12	600030	中信证券	6,043,645	120,328,971.95	0.43
13	300682	朗新科技	5,071,044	111,461,547.12	0.40
14	600298	安琪酵母	2,445,368	110,579,540.96	0.40
15	603712	七一二	3,162,844	110,446,512.48	0.40
16	603236	移远通信	1,080,777	108,963,937.14	0.39
17	601111	中国国航	10,021,273	106,225,493.80	0.38
18	300394	天孚通信	4,187,460	106,152,111.00	0.38
19	601117	中国化学	13,235,323	105,088,464.62	0.38
20	600760	中航沈飞	1,791,643	105,044,029.09	0.38
21	000887	中鼎股份	7,118,100	102,998,907.00	0.37
22	600690	海尔智家	4,061,972	99,355,835.12	0.36
23	002120	韵达股份	6,819,662	98,066,739.56	0.35
24	603666	亿嘉和	2,991,871	95,111,579.09	0.34
25	002241	歌尔股份	5,292,854	89,078,732.82	0.32
26	300408	三环集团	2,877,700	88,374,167.00	0.32
27	002078	太阳纸业	7,480,702	86,177,687.04	0.31
28	600600	青岛啤酒	750,821	80,713,257.50	0.29
29	000069	华侨城 A	13,638,340	72,692,352.20	0.26
30	000933	神火股份	4,317,900	64,595,784.00	0.23
31	002475	立讯精密	1,957,700	62,156,975.00	0.22
32	002318	久立特材	3,573,350	59,460,544.00	0.21
33	600210	紫江企业	10,669,500	53,347,500.00	0.19
34	600703	三安光电	2,999,945	51,479,056.20	0.18

35	002402	和而泰	3,351,390	48,863,266.20	0.17
36	601628	中国人寿	1,312,000	48,701,440.00	0.17
37	601156	东航物流	2,619,200	39,968,992.00	0.14
38	000423	东阿阿胶	935,521	38,075,704.70	0.14
39	600581	八一钢铁	9,349,400	37,023,624.00	0.13
40	601816	京沪高铁	6,678,585	32,858,638.20	0.12
41	600522	中天科技	2,000,000	32,300,000.00	0.12
42	688200	华峰测控	115,583	31,955,232.01	0.11
43	600523	贵航股份	1,623,700	31,727,098.00	0.11
44	688696	极米科技	184,958	30,740,019.60	0.11
45	300628	亿联网络	499,982	30,293,909.38	0.11
46	300580	贝斯特	1,554,400	28,942,928.00	0.10
47	601058	赛轮轮胎	2,656,508	26,618,210.16	0.10
48	688128	中国电研	1,536,657	26,246,101.56	0.09
49	600316	洪都航空	1,038,200	26,152,258.00	0.09
50	002223	鱼跃医疗	784,193	24,984,388.98	0.09
51	002027	分众传媒	3,384,800	22,610,464.00	0.08
52	002371	北方华创	100,000	22,530,000.00	0.08
53	002242	九阳股份	1,219,500	20,097,360.00	0.07
54	601899	紫金矿业	2,000,000	20,000,000.00	0.07
55	600188	兖矿能源	579,600	19,462,968.00	0.07
56	603681	永冠新材	816,070	17,447,576.60	0.06
57	688127	蓝特光学	1,000,000	15,930,000.00	0.06
58	603596	伯特利	194,200	15,497,160.00	0.06
59	002557	洽洽食品	302,652	15,132,600.00	0.05
60	600941	中国移动	222,203	15,036,477.01	0.05
61	600004	白云机场	1,000,000	15,010,000.00	0.05
62	600817	宇通重工	1,647,284	14,660,827.60	0.05
63	603259	药明康德	180,822	14,646,582.00	0.05
64	688233	神工股份	236,307	9,641,325.60	0.03
65	000786	北新建材	338,500	8,760,380.00	0.03
66	002271	东方雨虹	250,000	8,392,500.00	0.03
67	600036	招商银行	200,000	7,452,000.00	0.03
68	600460	士兰微	200,000	6,558,000.00	0.02
69	601666	平煤股份	500,000	5,405,000.00	0.02
70	002507	涪陵榨菜	130,000	3,350,100.00	0.01
71	600754	锦江酒店	42,800	2,497,380.00	0.01
72	000733	振华科技	9,500	1,085,185.00	0.00
73	688268	华特气体	8,848	656,964.00	0.00
74	603444	吉比特	1,175	367,587.00	0.00
75	873223	荣亿精密	4,400	14,124.00	0.00
76	831278	泰德股份	1,900	6,023.00	0.00
77	301301	川宁生物	500	4,475.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	432,817,472.17	0.59
2	601398	工商银行	373,420,476.26	0.51
3	000858	五粮液	279,023,947.33	0.38
4	000933	神火股份	255,795,573.59	0.35
5	300124	汇川技术	251,439,985.97	0.34
6	601088	中国神华	239,503,850.00	0.33
7	600660	福耀玻璃	234,469,234.23	0.32
8	600600	青岛啤酒	225,723,279.31	0.31
9	601111	中国国航	221,801,579.88	0.30
10	600887	伊利股份	219,853,538.50	0.30
11	600030	中信证券	181,923,951.18	0.25
12	601318	中国平安	176,756,316.62	0.24
13	300408	三环集团	140,074,831.52	0.19
14	600057	厦门象屿	134,059,407.81	0.18
15	600298	安琪酵母	128,067,528.47	0.18
16	601799	星宇股份	118,656,940.41	0.16
17	002120	韵达股份	113,675,673.17	0.16
18	600031	三一重工	113,317,559.09	0.16
19	600760	中航沈飞	103,535,298.07	0.14
20	600690	海尔智家	102,457,789.59	0.14

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600438	通威股份	984,094,834.83	1.35
2	600089	特变电工	766,622,822.42	1.05
3	002241	歌尔股份	691,832,237.63	0.95
4	603596	伯特利	447,917,339.24	0.61
5	603179	新泉股份	443,271,668.83	0.61
6	002080	中材科技	366,804,439.90	0.50

7	601398	工商银行	364,718,680.40	0.50
8	603236	移远通信	361,328,796.79	0.50
9	300138	晨光生物	291,385,653.31	0.40
10	600585	海螺水泥	274,040,229.35	0.38
11	000933	神火股份	260,577,583.76	0.36
12	603018	华设集团	251,750,377.26	0.35
13	601689	拓普集团	248,426,532.06	0.34
14	603997	继峰股份	228,931,523.63	0.31
15	601166	兴业银行	226,775,744.46	0.31
16	600888	新疆众和	221,030,155.46	0.30
17	600219	南山铝业	211,269,238.60	0.29
18	000733	振华科技	210,839,422.31	0.29
19	600933	爱柯迪	193,932,470.08	0.27
20	601318	中国平安	173,006,548.20	0.24

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,024,725,223.11
卖出股票收入（成交）总额	12,200,729,646.65

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	18,422,420,410.42	65.90
	其中：政策性金融债	2,250,337,610.97	8.05
4	企业债券	3,382,591,630.10	12.10
5	企业短期融资券	132,180,932.60	0.47
6	中期票据	5,107,856,806.56	18.27
7	可转债（可交换债）	1,539,801,113.86	5.51

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,584,850,893.54	102.26

8.6 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	2228004	22 工商银行二级 01	10,400,000	1,059,213,045.48	3.79
2	2128025	21 建设银行二级 01	10,000,000	1,010,488,767.12	3.61
3	2128039	21 中国银行二级 03	9,400,000	944,633,813.70	3.38
4	220206	22 国开 06	8,100,000	818,489,243.84	2.93
5	220211	22 国开 11	8,000,000	804,307,506.85	2.88

8.7 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	112450	22 沪杭优	900,000	90,261,290.96	0.32
2	112561	22 和闽优	200,000	20,034,717.81	0.07
3	193732	至通 02A2	180,000	18,155,152.11	0.06
4	165862	20 花 02A1	100,000	10,228,312.33	0.04
5	156659	PR 产 1A	100,000	10,018,281.56	0.04
6	169304	20 曹操 A3	100,000	4,630,517.69	0.02

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，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。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中国银行保险监督管理委员会的处罚。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中国银行保险监督管理委员会的处罚。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。兴业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。中国邮政储蓄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。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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,441,447.84
2	应收清算款	494,466,606.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,675,110.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	498,583,165.21

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	113050	南银转债	220,169,990.01	0.79
2	113011	光大转债	205,475,291.40	0.74
3	110072	广汇转债	173,071,231.47	0.62
4	110079	杭银转债	87,514,188.11	0.31
5	127018	本钢转债	68,649,540.88	0.25
6	113033	利群转债	54,813,969.05	0.20
7	110047	山鹰转债	51,233,706.46	0.18
8	128129	青农转债	44,315,506.58	0.16
9	113013	国君转债	40,773,326.38	0.15
10	110045	海澜转债	36,956,727.36	0.13
11	127045	牧原转债	36,209,813.09	0.13
12	127016	鲁泰转债	30,558,121.93	0.11
13	113052	兴业转债	25,453,595.89	0.09
14	110053	苏银转债	23,855,119.86	0.09
15	113542	好客转债	21,442,211.70	0.08
16	128125	华阳转债	14,969,756.86	0.05
17	113530	大丰转债	14,886,934.76	0.05
18	128138	侨银转债	13,203,428.00	0.05
19	123044	红相转债	12,947,572.60	0.05
20	128108	蓝帆转债	12,546,979.62	0.04
21	123004	铁汉转债	12,436,159.47	0.04
22	128083	新北转债	12,307,739.22	0.04
23	113048	晶科转债	12,182,726.03	0.04
24	113584	家悦转债	11,996,662.79	0.04
25	113606	荣泰转债	11,848,989.04	0.04
26	127040	国泰转债	11,526,605.48	0.04
27	128109	楚江转债	11,368,678.11	0.04
28	127019	国城转债	10,961,835.06	0.04
29	123113	仙乐转债	10,637,797.26	0.04
30	113056	重银转债	9,713,449.32	0.03
31	113596	城地转债	9,296,196.70	0.03
32	113037	紫银转债	9,295,242.78	0.03
33	123049	维尔转债	9,099,029.57	0.03
34	127044	蒙娜转债	8,123,453.35	0.03
35	132018	G 三峡 EB1	7,854,090.95	0.03
36	113604	多伦转债	6,417,796.40	0.02
37	128105	长集转债	6,300,960.95	0.02
38	110077	洪城转债	6,124,261.64	0.02
39	128072	翔鹭转债	5,986,614.60	0.02

40	127055	精装转债	5,786,790.41	0.02
41	113631	皖天转债	5,736,867.12	0.02
42	127052	西子转债	5,690,938.36	0.02
43	123132	回盛转债	5,639,986.30	0.02
44	110080	东湖转债	5,573,465.75	0.02
45	110086	精工转债	5,456,350.69	0.02
46	123142	申昊转债	5,444,847.91	0.02
47	128127	文科转债	5,329,184.93	0.02
48	127061	美锦转债	5,323,990.49	0.02
49	123149	通裕转债	5,303,763.27	0.02
50	113569	科达转债	5,109,689.51	0.02
51	128063	未来转债	4,933,828.44	0.02
52	127047	帝欧转债	4,800,226.03	0.02
53	123056	雪榕转债	2,144,772.60	0.01
54	127032	苏行转债	16,653.20	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
95,659	193,862.18	16,481,350,385.35	88.87%	2,063,311,777.64	11.13%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	3,796,627.85	0.0205%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016 年 1 月 22 日)基金份额总额	681,094,039.00
本报告期期初基金份额总额	41,930,708,370.35
本报告期基金总申购份额	9,998,712,072.46
减：本报告期基金总赎回份额	33,384,758,279.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	18,544,662,162.99

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本基金管理人于 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

经上海浦东发展银行股份有限公司决定，总行资产托管部原总经理孔建同志自 2022 年 11 月 7 日起不再担任资产托管部总经理职务，由李国光同志担任部门负责人。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 7 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服

务，本报告年度的审计费用为 111,100.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
德邦证券	1	6,330,239,872.24	34.73%	3,798,143.87	30.42%	-
华创证券	1	366,434,987.18	2.01%	219,860.17	1.76%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	644,609,272.42	3.54%	515,688.68	4.13%	-
开源证券	3	1,091,703,595.93	5.99%	873,362.91	7.00%	-
平安证券	1	818,715,019.05	4.49%	491,233.50	3.94%	-
申万宏源	3	2,283,642,237.15	12.53%	1,824,027.83	14.61%	-
天风证券	1	1,585,561,510.12	8.70%	1,268,450.43	10.16%	-
信达证券	1	132,333,058.78	0.73%	79,399.83	0.64%	-
招商证券	1	1,975,765,023.51	10.84%	1,580,612.05	12.66%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	1,394,620,490.81	7.65%	836,772.31	6.70%	-
中信建投	1	175,350,447.05	0.96%	140,279.92	1.12%	-
中信证券	1	1,426,329,667.52	7.83%	855,809.98	6.86%	-

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德邦证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、开源证券股份有限公司。

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。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。

11.7.2 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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
德邦证券	6,640,651,730.74	42.49%	127,271,000,000.00	32.26%	-	-
华创证券	173,682,735.29	1.11%	855,000,000.00	0.22%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	507,245,449.29	3.25%	2,345,000,000.00	0.59%	-	-
开源证券	471,412,270.40	3.02%	6,244,728,000.00	1.58%	-	-
平安证券	227,175,954.27	1.45%	4,600,000,000.00	1.17%	-	-
申万宏源	3,027,957,910.27	19.37%	110,280,200,000.00	27.95%	-	-
天风证券	496,776,914.23	3.18%	35,728,000,000.00	9.06%	-	-
信达证券	539,922,528.58	3.45%	7,436,973,000.00	1.89%	-	-
招商证券	1,448,316,948.31	9.27%	34,447,994,000.00	8.73%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	1,389,411,756.52	8.89%	44,595,000,000.00	11.30%	-	-
中信建投	100,058,606.	0.64%	1,900,000,	0.48%	-	-

	58		000.00			
中信证券	605,920,810.12	3.88%	18,810,000,000.00	4.77%	-	-

11.8 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	易方达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-01-21
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报	2022-03-30
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-04-22
8	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-28
9	易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-30
10	易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-07
11	易方达裕祥回报债券型证券投资基金恢复大额申购及大额转换转入业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-11
12	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
13	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-14
14	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2022-05-14

		金电子披露网站	
15	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-07-07
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-07-20
17	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	上海证券报	2022-08-30
18	易方达裕祥回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-10-25
19	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-10-26
20	易方达裕祥回报债券型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-03
21	易方达裕祥回报债券型证券投资基金恢复机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-04
22	易方达裕祥回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-11-18
23	易方达裕祥回报债券型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-20
24	易方达裕祥回报债券型证券投资基金恢复机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-21

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达裕祥回报债券型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达裕祥回报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。

12.2 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。

12.3 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

二〇二三年三月三十日