易方达高端制造混合型发起式证券投资基金

2023 年第 2 季度报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达高端制造混合发起式
基金主代码	009049
交易代码	009049
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 16 日
报告期末基金份额总额	2,772,411,866.28 份
投资目标	本基金主要投资高端制造主题相关公司，在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面，本基金将综合考虑宏观与微观经济、市场与政策等因素，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。股票投资方面，本基金主要投资高端制造主题相关公司；本基金将在地区配置和行业配置基础上，精选具有较强

	竞争优势的公司进行投资。债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。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	中证高端装备制造指数收益率×85%+中债总指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。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。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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 (2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-356,406,240.01
2.本期利润	-164,566,754.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0556

4.期末基金资产净值	4,807,802,918.22
5.期末基金份额净值	1.7342

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

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	-2.86%	0.99%	-1.82%	0.94%	-1.04%	0.05%
过去六个月	-3.70%	0.96%	3.70%	0.91%	-7.40%	0.05%
过去一年	-19.07%	1.20%	-13.52%	1.09%	-5.55%	0.11%
过去三年	59.39%	1.61%	10.01%	1.38%	49.38%	0.23%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	73.42%	1.54%	16.56%	1.39%	56.86%	0.15%

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

易方达高端制造混合型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2020 年 3 月 16 日至 2023 年 6 月 30 日）

注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 73.42%，同期业绩比较基准收益率为 16.56%。

§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		
祁禾	本基金的基金经理，易方达环保主题混合、易方达新丝路混合、易方达智造优势混合、易方达产业升级混合、易方达核心智造混合的基金经理，研究部副总经理、行业研究员	2020-03-16	-	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华泰联合证券有限责任公司研究所研究员，博时基金管理有限公司研究部研究员，易方达基金管理有限公司基金经理助理，易方达科汇灵活配置混合、易方达创新驱动混合的基金经理。

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 15 次，其中 14 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，1 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

2023 年二季度沪深 300 指数下跌 5.15%，同期创业板综合指数下跌 2.93%。对经济复苏的担心，以及对权重股业绩不及预期的担心，使得指数下跌。

制造板块行业在二季度表现较弱，一方面前期因为人工智能主题上涨的标的有明显回调，另一方面对大部分制造业存在供需两弱的担心。此外，在市场存量资金切换明显的结构下，过去三年表现较佳的高端制造行业也成为配置降低的板块。往好的方面看，原材料成本和物流成本显著下降，具有利于改善制造业企业

的经营环境。此外，上半年制造业各领域经过持续去库存，也为经济预期修复后的补库存奠定基础。

本基金配置较多的新能源、石化、电子、家电、机械在内的优质企业，虽然短期跟随行业经受挑战，但这些公司的成长逻辑仍然比较稳固。

选股层面，本基金坚持企业竞争力是长期收益来源的理念，继续选择上述板块中竞争力强、治理优秀的公司进行配置，分享企业的成长价值。

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 1.7342 元，本报告期份额净值增长率为-2.86%，同期业绩比较基准收益率为-1.82%。

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	4,281,359,005.80	86.79
	其中：股票	4,281,359,005.80	86.79
2	固定收益投资	312,409.08	0.01
	其中：债券	312,409.08	0.01
	资产支持证券	-	-
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	610,032,051.34	12.37

7	其他资产	41,145,253.25	0.83
8	合计	4,932,848,719.47	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 810,137,621.07 元，占净值比例 16.85%。

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	175,599,509.64	3.65
C	制造业	3,137,298,709.64	65.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	83,928.25	0.00
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	130,297,353.42	2.71
J	金融业	27,765,760.00	0.58
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	37,242.13	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	69,135.17	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,471,221,384.73	72.20

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	568,892,435.69	11.83

材料	27,482,213.88	0.57
工业	-	-
非必需消费品	32,304,704.03	0.67
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	73,351,391.93	1.53
电信服务	108,106,875.54	2.25
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	810,137,621.07	16.85

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	002129	TCL 中环	14,421,134	478,781,648.80	9.96
2	00386	中国石油化工股份	69,090,000	292,381,155.74	6.08
2	600028	中国石化	25,746,949	163,750,595.64	3.41
3	00857	中国石油股份	55,334,000	276,511,279.95	5.75
3	601857	中国石油	1,586,200	11,848,914.00	0.25
4	603688	石英股份	2,511,266	285,882,521.44	5.95
5	300274	阳光电源	2,382,744	277,899,432.72	5.78
6	300443	金雷股份	5,981,282	212,036,446.90	4.41
7	300316	晶盛机电	2,981,645	211,398,630.50	4.40
8	300775	三角防务	5,643,679	190,643,476.62	3.97
9	002600	领益智造	21,794,617	150,600,803.47	3.13
10	300724	捷佳伟创	1,107,159	124,389,313.65	2.59

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	312,409.08	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	312,409.08	0.01

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	123121	帝尔转债	2,477	312,409.08	0.01

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,009,114.78
2	应收证券清算款	10,146,075.86
3	应收股利	24,676,958.63
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,313,103.98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	41,145,253.25

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	123121	帝尔转债	312,409.08	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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,089,993,922.61
报告期期间基金总申购份额	105,497,738.97
减：报告期期间基金总赎回份额	423,079,795.30
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	2,772,411,866.28

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.3607

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.3607%	10,000,000.00	0.3607%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	0.3607%	10,000,000.00	0.3607%	-

§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高端制造混合型发起式证券投资基金注册的文件；

2.《易方达高端制造混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3.《易方达高端制造混合型发起式证券投资基金托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

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

二〇二三年七月二十日