

# 易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

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：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

## § 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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 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	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8	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	12
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	15
6.3	净资产（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	45
7.1	期末基金资产组合情况	45
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3	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	46
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6	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	53
7.7	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	53
7.8	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	54
7.9	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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54

7.12	投资组合报告附注.....	54
§ 8	基金份额持有人信息.....	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3	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的情况.....	56
§ 9	开放式基金份额变动.....	56
§ 10	重大事件揭示.....	56
10.1	基金份额持有人大会决议.....	56
10.2	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.....	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4	基金投资策略的改变.....	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8	其他重大事件.....	59
§ 11	备查文件目录.....	60
11.1	备查文件目录.....	60
11.2	存放地点.....	60
11.3	查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	易方达品质动能三年持有混合	
基金主代码	014562	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 7 月 7 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	9,920,028,464.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达品质动能三年持有混合 A	易方达品质动能三年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	014562	014563
报告期末下属分级基金的份额总额	8,611,280,531.68 份	1,308,747,932.71 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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，本基金将通过分析行业景气度及发展趋势、行业竞争格局及变化，确定并动态调整股票资产在各行业之间的配置；本基金将通过定性分析和定量分析相结合的方法，对公司基本面进行持续跟踪分析，优选具有较强发展动能的高品质公司进行投资。本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行。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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×65%+中证港股通综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×15%
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。 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、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。

## 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	张姗
	联系电话	020-85102688	0755-83077987
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95555
传真		020-38798812	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		510620	518040
法定代表人		刘晓艳	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

## 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	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
---------------	--------------------------------------

	易方达品质动能三年持有混合 A	易方达品质动能三年持有混合 C
本期已实现收益	-108,823,020.64	-18,959,702.20
本期利润	-532,467,229.67	-83,024,975.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0619	-0.0635
本期加权平均净值利润率	-6.43%	-6.62%
本期基金份额净值增长率	-6.40%	-6.60%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	易方达品质动能三年持有混合 A	易方达品质动能三年持有混合 C
期末可供分配利润	-831,373,920.39	-130,983,718.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0965	-0.1001
期末基金资产净值	7,779,906,611.29	1,177,764,214.60
期末基金份额净值	0.9035	0.8999
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	易方达品质动能三年持有混合 A	易方达品质动能三年持有混合 C
基金份额累计净值增长率	-9.65%	-10.01%

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

易方达品质动能三年持有混合 A

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
过去一个月	0.17%	0.97%	0.55%	0.78%	-0.38%	0.19%
过去三个月	-6.88%	0.89%	-3.57%	0.69%	-3.31%	0.20%
过去六个月	-6.40%	0.84%	1.46%	0.66%	-7.86%	0.18%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-9.65%	0.70%	-4.72%	0.81%	-4.93%	-0.11%

易方达品质动能三年持有混合 C

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
过去一个月	0.12%	0.97%	0.55%	0.78%	-0.43%	0.19%
过去三个月	-6.99%	0.89%	-3.57%	0.69%	-3.42%	0.20%
过去六个月	-6.60%	0.84%	1.46%	0.66%	-8.06%	0.18%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-10.01%	0.70%	-4.72%	0.81%	-5.29%	-0.11%

### 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

易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金  
 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

(2022 年 7 月 7 日至 2023 年 6 月 30 日)

易方达品质动能三年持有混合 A



易方达品质动能三年持有混合 C



注：1.本基金合同于2022年7月7日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

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-9.65%，同期业绩比较基准收益率为-4.72%；C类基金份额净值增长率为-10.01%，同期业绩比较基准收益率为-4.72%。

## § 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		
陈皓	本基金的基金经理，易方达平稳增长混合、易方达科翔混合、易方达新经济混合、易方达均衡成长股票、易方达创新未来混合（LOF）、易方达港股通成长混合、易方达改革红利混合的基金经理，副总经理级高级管理人员、投资一部总经理、权益投资决策委员会委员	2022-07-07	-	16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行业研究员、基金经理助理、投资一部总经理助理、投资一部副总经理、投资经理，易方达价值精选混合、易方达国防军工混合、易方达供给改革混合、易方达科讯混合、易方达科融混合的基金经理。

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/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。

#### 4.2 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 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、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 23 次，其中 20 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交

易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 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

上半年的 A 股市场大体分为两段行情，一季度由于疫后复苏，经济活动较为强劲，投资者情绪乐观；二季度国内复苏斜率有所放缓，数据环比下滑较快，同时美国经济持续超预期，人民币汇率波动较大，导致市场表现欠佳。上半年市场结构分化剧烈，特别是二季度由于经济基本面较为平淡，市场继续围绕“边际变化”+“主题投资”的路径持续演绎结构性行情，其中 AIGC(人工智能生成内容)相关的 TMT 行业和中特估板块表现较好，传统机构重仓的新能源、消费医药等板块处于资金持续流出的状态。上半年上证指数、中证 500、科创 50 分别上涨 3.65%、2.29%、4.71%，沪深 300、创业板指则下跌了 0.75%、5.61%。

本基金上半年净值表现一般，也基本没有参与上述热点方向。究其原因，首先是我们对今年国内外宏观经济、股市微观结构的前瞻判断有一定偏差，同时后续调整也不够果断和及时；其次我们一直坚持重视性价比、基于深度研究和超额认知驱动的投资范式，本身就与当前淡化估值以及看重主题、变化、轮动的底层逻辑是相斥的；另外我们偏左侧的投资风格在今年强者恒强的市场环境下也相对被动。考虑到未来弱复苏的状态可能持续时间较长，我们也将不断思考如何才能更好的适应这种弱经济、强主题的投资环境。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 0.9035 元，本报告期份额净值增长率为-6.40%，同期业绩比较基准收益率为 1.46%；C 类基金份额净值为 0.8999 元，本报告期份额净值增长率为-6.60%，同期业绩比较基准收益率为 1.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们还是认为利好因素会更多一些，政策方面，国常会表态要推动经济持续回升，并研究相关政策措施，央行降息，预期后续会有进一步的宏观积极政策出台，国内经济大概率见底回升。地缘政治方面，5 月以来，中美关系出现缓和迹象，后续有望企稳改善。结合目前较低的估值水平和极低的投资者预期，我们认为下行空间已较为有限，反弹应是大概率事件。但市场的长期信心能否重建，则有待观察后续政策方向、力度，以及基本面回升的具体情况。

基于经济见底的判断，我们认为下半年的市场风格预计会相对均衡，一方面只要企业盈利能稳住，基本面投资就会变得可研究、可跟踪、可定价；另一方面，越来越多的主题投资标的开始出现减持行为，太阳底下没有新鲜事，过去的经历告诉我们任何一次躁动、火热的市场氛围除了带动更多的博弈，对真正的产业升级没有任何帮助，对 A 股市场长期健康发展也是不利的。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达品质动能三年持有混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达品质动能三年持有混合 C:本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,369,856,268.41	2,080,216,484.65
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	7,600,624,401.60	7,064,186,050.82
其中：股票投资		7,600,624,401.60	7,055,177,446.95
基金投资		-	-

债券投资		-	9,008,603.87
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	433,076,268.58
应收清算款		-	2,605,384.98
应收股利		352,322.40	-
应收申购款		109,544.15	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		8,970,942,536.56	9,580,084,189.03
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,965,701.41	12,236,551.17
应付托管费		1,827,616.90	2,039,425.17
应付销售服务费		384,428.40	429,444.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	65.28
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	93,963.96	245,593.46
负债合计		13,271,710.67	14,951,079.67
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	9,920,028,464.39	9,911,210,292.63
未分配利润	6.4.7.8	-962,357,638.50	-346,077,183.27
净资产合计		8,957,670,825.89	9,565,133,109.36
负债和净资产总计		8,970,942,536.56	9,580,084,189.03

注：1.本基金合同生效日为 2022 年 7 月 7 日，2022 年度实际报告期间为 2022 年 7 月 7 日至 2022 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.9035 元，C 类基金份额净值 0.8999 元；基金份额总额 9,920,028,464.39 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 8,611,280,531.68 份，C 类基金份额总额 1,308,747,932.71 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-530,033,265.88
1.利息收入		3,791,550.90
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,129,735.28
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,661,815.62
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-46,115,334.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-100,674,269.11
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	2,026,540.96
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	52,532,393.88
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.15	-487,709,482.51
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-
<b>减：二、营业总支出</b>		85,458,939.47
1. 管理人报酬		70,988,900.79
2. 托管费		11,831,483.45
3. 销售服务费		2,489,293.57
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-

7. 税金及附加		51.19
8. 其他费用	6.4.7.18	149,210.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		<b>-615,492,205.35</b>
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>-615,492,205.35</b>
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		<b>-615,492,205.35</b>

注：本基金合同生效日为 2022 年 7 月 7 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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）	9,911,210,292.63	-346,077,183.27	9,565,133,109.36
二、本期期初净资产（基金净值）	9,911,210,292.63	-346,077,183.27	9,565,133,109.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,818,171.76	-616,280,455.23	-607,462,283.47
（一）、综合收益总额	-	-615,492,205.35	-615,492,205.35
（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）	8,818,171.76	-788,249.88	8,029,921.88
其中：1. 基金申购款	8,818,171.76	-788,249.88	8,029,921.88
2. 基金赎回款	-	-	-
（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）	9,920,028,464.39	-962,357,638.50	8,957,670,825.89

注：本基金合同生效日为 2022 年 7 月 7 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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：王永铨

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金(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[2021]3814 号《关于准予易方达品质动能三年持有期混合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《易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 7 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 9,911,210,292.63 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,949,112.61 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 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。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 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。

### （5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	292,396,007.94
等于：本金	292,367,575.67
加：应计利息	28,432.27
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	1,077,460,260.47
等于：本金	1,077,377,502.34
加：应计利息	82,758.13
合计	1,369,856,268.41

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	8,202,305,424.14	-	7,600,624,401.60	-601,681,022.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,202,305,424.14	-	7,600,624,401.60	-601,681,022.54

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,703.81
其中：交易所市场	-
银行间市场	4,703.81
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	93,963.96

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 易方达品质动能三年持有混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,604,825,079.00	8,604,825,079.00
本期申购	6,455,452.68	6,455,452.68
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	8,611,280,531.68	8,611,280,531.68

##### 易方达品质动能三年持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,306,385,213.63	1,306,385,213.63
本期申购	2,362,719.08	2,362,719.08
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,308,747,932.71	1,308,747,932.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 易方达品质动能三年持有混合 A

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	-199,391,731.94	-98,947,274.98	-298,339,006.92
本期利润	-108,823,020.64	-423,644,209.03	-532,467,229.67
本期基金份额交易产生的变动数	-160,303.46	-407,380.34	-567,683.80
其中：基金申购款	-160,303.46	-407,380.34	-567,683.80
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-308,375,056.04	-522,998,864.35	-831,373,920.39

##### 易方达品质动能三年持有混合 C

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	-32,713,911.30	-15,024,265.05	-47,738,176.35
本期利润	-18,959,702.20	-64,065,273.48	-83,024,975.68
本期基金份额交易产生的变动数	-68,749.75	-151,816.33	-220,566.08
其中：基金申购款	-68,749.75	-151,816.33	-220,566.08
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-51,742,363.25	-79,241,354.86	-130,983,718.11

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,224,558.39

结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,129,735.28

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-100,674,269.11
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	-100,674,269.11

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	3,103,468,389.43
减：卖出股票成本总额	3,195,115,726.10
减：交易费用	9,026,932.44
买卖股票差价收入	-100,674,269.11

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	14,226.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,012,314.30
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	2,026,540.96

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交	20,418,638.30

总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,380,986.52
减：应计利息总额	24,268.41
减：交易费用	1,069.07
买卖债券差价收入	2,012,314.30

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	52,532,393.88
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	52,532,393.88

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-487,709,482.51
——股票投资	-486,069,009.73
——债券投资	-1,640,472.78
——资产支持证券投资	-
——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	-487,709,482.51

#### 6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

## 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
审计费用		29,752.78
信息披露费		59,507.37
证券出借违约金		-
银行间账户维护费		9,000.00
银行汇划费		23,046.21
港股通证券组合费		27,904.11
合计		149,210.47

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 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。

## 6.4.8.2 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。

## 6.4.9 关联方关系

## 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、证券经纪商、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	2,334,779,537.94	32.49%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	12,202,088.58	56.96%

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	1,451,029.63	32.49%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	70,988,900.79
其中：支付销售机构的客户维护费	31,944,742.30

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,831,483.45

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达品质动能三年持有混合 A	易方达品质动能三年持有混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	11,511.73	11,511.73
招商银行	-	1,533,179.11	1,533,179.11
广发证券	-	54,563.75	54,563.75
合计	-	1,599,254.59	1,599,254.59

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 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 2023年1月1日至2023年6月30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
招商银行	-	-	500,000,00 0.00	20,862.88	-	-

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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

###### 易方达品质动能三年持有混合 A

无。

###### 易方达品质动能三年持有混合 C

无。

#### 6.4.10.6 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
-------	----

	2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	292,396,007.94	905,176.89
广发证券-其他存款	260,445,327.25	203,790.36

注：1.本基金的其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

2.除其他存款外，本基金的上述银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 易方达品质动能三年持有混合 A

本报告期内未发生利润分配。

##### 易方达品质动能三年持有混合 C

本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-

00128 6	陕西 能源	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	9.60	9.41	3,767	36,163 .20	35,447 .47	-
00128 7	中电 港	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	11.88	21.02	1,386	16,465 .68	29,133 .72	-
00132 4	长青 科技	2023-0 5-12	6 个月	新股 流通 受限	18.88	19.60	114	2,152. 32	2,234. 40	-
00132 8	登康 口腔	2023-0 3-29	6 个月	新股 流通 受限	20.68	25.49	145	2,998. 60	3,696. 05	-
00136 0	南矿 集团	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	15.38	14.87	177	2,722. 26	2,631. 99	-
00136 7	海森 药业	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	44.48	39.48	55	2,446. 40	2,171. 40	-
30080 4	广康 生化	2023-0 6-15	6 个月	新股 流通 受限	42.45	32.97	226	9,593. 70	7,451. 22	-
30114 1	中科 磁业	2023-0 3-27	6 个月	新股 流通 受限	41.20	42.69	262	10,794 .40	11,184 .78	-
30115 7	华塑 科技	2023-0 3-01	6 个月	新股 流通 受限	56.50	52.93	150	8,475. 00	7,939. 50	-
30117 0	锡南 科技	2023-0 6-16	6 个月	新股 流通 受限	34.00	34.93	250	8,500. 00	8,732. 50	-
30120 2	朗威 股份	2023-0 6-28	1 个月 以内	新股 流通 受限	25.82	25.82	2,754	71,108 .28	71,108 .28	-
30120 2	朗威 股份	2023-0 6-28	6 个月	新股 流通 受限	25.82	25.82	306	7,900. 92	7,900. 92	-
30123 2	飞沃 科技	2023-0 6-08	6 个月	新股 流通 受限	72.50	58.42	165	11,962 .50	9,639. 30	-
30128 1	科源 制药	2023-0 3-28	6 个月	新股 流通 受限	44.18	25.10	337	10,647 .38	8,458. 70	-
30129 1	明阳 电气	2023-0 6-21	6 个月	新股 流通	38.13	31.03	1,206	45,984 .78	37,422 .18	-

				受限						
30129 3	三博 脑科	2023-0 4-25	6 个月	新股 流通 受限	29.60	71.42	333	9,856. 80	23,782 .86	-
30130 1	川宁 生物	2022-1 2-20	6 个月	新股 流通 受限	5.00	8.96	3,574	17,870 .00	32,023 .04	-
30130 5	朗坤 环境	2023-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	25.25	19.69	753	19,013 .25	14,826 .57	-
30130 7	美利 信	2023-0 4-14	6 个月	新股 流通 受限	32.34	31.86	687	22,217 .58	21,887 .82	-
30131 5	威士 顿	2023-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	32.29	51.12	226	7,297. 54	11,553 .12	-
30132 3	新莱 福	2023-0 5-29	6 个月	新股 流通 受限	39.06	39.36	228	8,905. 68	8,974. 08	-
30133 2	德尔 玛	2023-0 5-09	6 个月	新股 流通 受限	14.81	13.73	1,122	16,616 .82	15,405 .06	-
30133 7	亚华 电子	2023-0 5-16	6 个月	新股 流通 受限	32.60	30.37	232	7,563. 20	7,045. 84	-
30134 5	涛涛 车业	2023-0 3-10	6 个月	新股 流通 受限	73.45	46.64	266	19,537 .70	12,406 .24	-
30135 5	南王 科技	2023-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	17.55	16.75	563	9,880. 65	9,430. 25	-
30135 8	湖南 裕能	2023-0 2-01	6 个月	新股 流通 受限	23.77	42.89	2,023	48,086 .71	86,766 .47	-
30136 0	荣旗 科技	2023-0 4-17	6 个月	新股 流通 受限	71.88	92.60	134	9,631. 92	12,408 .40	-
30137 3	凌玮 科技	2023-0 1-20	6 个月	新股 流通 受限	33.73	31.85	277	9,343. 21	8,822. 45	-
30137 6	致欧 科技	2023-0 6-14	6 个月	新股 流通 受限	24.66	22.51	420	10,357 .20	9,454. 20	-
30138	蜂助	2023-0	6 个月	新股	23.80	32.84	408	9,710.	13,398	-

2	手	5-09		流通受限				40	.72	
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月以内	新股流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月以内	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-

603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688307	中润光学	2023-02-08	6 个月	新股流通受限	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新股流通	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-

				受限						
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
68862	华丰	2023-0	6 个月	新股	9.26	18.59	708	6,556.	13,161	-

9	科技	6-16		流通受限				08	.72	
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
001270	铖昌科技	2023-06-06	6 个月	大宗交易流通受限	70.51	80.51	104,000	7,333,040.00	8,373,040.00	-
603712	七一二	2023-06-20	6 个月	大宗交易流通受限	25.04	28.71	405,900	10,163,736.00	11,653,389.00	-
300775	三角防务	2023-01-04	6 个月	非公开发行流通受限	33.66	33.40	77,403	2,605,384.98	2,585,260.20	-
301018	申菱环境	2023-04-04	6 个月	非公开发行流通受限	32.56	32.79	552,825	17,999,982.00	18,127,131.75	-
600587	新华医疗	2023-02-23	6 个月	非公开发行流通受限	23.38	33.92	855,431	19,999,976.78	29,016,219.52	-
603456	九洲药业	2023-01-18	6 个月	非公开发行流通受限	38.29	26.80	783,494	29,999,985.26	20,997,639.20	-
688071	华依科技	2023-04-21	6 个月	非公开发行流通受限	47.46	56.94	493,566	23,424,642.36	28,103,648.04	-
688008	澜起科技	2023-01-18	6 个月	询价转让流通受限	58.00	56.19	430,000	24,940,000.00	24,161,700.00	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 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为 0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 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为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

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、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。日常经营活动中本基金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。

##### 6.4.13.2 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 2023 年 6 月 30 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 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.09%)。

#### 6.4.13.2.1 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

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。

#### 6.4.13.2.2 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

#### 6.4.13.2.3 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

#### 6.4.13.2.4 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	9,008,603.87
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	9,008,603.87

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。

#### 6.4.13.2.5 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

#### 6.4.13.2.6 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

#### 6.4.13.3 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 2023 年 6 月 30 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。

### 6.4.13.3.1 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。

### 6.4.13.4 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。本基金可通过港股通投资香港市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。香港证券市场每日证券交易价格并无涨跌幅限制，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

#### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	1,369,856,268.41	-	-	-	1,369,856,268.41
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	7,600,624,401.60	7,600,624,401.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	352,322.40	352,322.40
应收申购款	-	-	-	109,544.15	109,544.15
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,369,856,268.41	-	-	7,601,086,268.15	8,970,942,536.56
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	10,965,701.41	10,965,701.41
应付托管费	-	-	-	1,827,616.90	1,827,616.90
应付销售服务费	-	-	-	384,428.40	384,428.40
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	93,963.96	93,963.96
负债总计	-	-	-	13,271,710.67	13,271,710.67
利率敏感度缺口	1,369,856,268.41	-	-	7,587,814,557.48	8,957,670,825.89
上年度末 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	2,080,216,484.65	-	-	-	2,080,216,484.65
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	9,008,603.87	7,055,177,446.95	7,064,186,050.82
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	433,076,268.58	-	-	-	433,076,268.58
应收清算款	-	-	-	2,605,384.98	2,605,384.98
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,513,292,753.23	-	9,008,603.87	7,057,782,831.93	9,580,084,189.03
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	12,236,551.17	12,236,551.17
应付托管费	-	-	-	2,039,425.17	2,039,425.17
应付销售服务费	-	-	-	429,444.59	429,444.59
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	65.28	65.28
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	245,593.46	245,593.46
负债总计	-	-	-	14,951,079.67	14,951,079.67
利率敏感度缺口	2,513,292,753.23	-	9,008,603.87	7,042,831,752.26	9,565,133,109.36

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净

值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	639,856,430.50	-	639,856,430.50
资产合计	-	<b>639,856,430.50</b>	-	<b>639,856,430.50</b>
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	<b>639,856,430.50</b>	-	<b>639,856,430.50</b>
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	488,398,230.96	-	488,398,230.96
资产合计	-	<b>488,398,230.96</b>	-	<b>488,398,230.96</b>
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	<b>488,398,230.96</b>	-	<b>488,398,230.96</b>

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-31,992,821.53	-24,419,911.55
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	31,992,821.53	24,419,911.55

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	7,600,624,401.60	84.85	7,055,177,446.95	73.76
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	7,600,624,401.60	84.85	7,055,177,446.95	73.76

#### 6.4.13.4.3.2 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
1.业绩比较基准上升 5%	447,095,547.01	415,010,433.25
2.业绩比较基准下降 5%	-447,095,547.01	-415,010,433.25

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	7,455,596,072.58
第二层次	461,074.44
第三层次	144,567,254.58
合计	7,600,624,401.60

###### 6.4.14.2.2 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。

###### 6.4.14.3 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。

###### 6.4.14.4 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。

#### 6.4.15 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。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 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	7,600,624,401.60	84.72
	其中：股票	7,600,624,401.60	84.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	1,369,856,268.41	15.27
8	其他各项资产	461,866.55	0.01
9	合计	8,970,942,536.56	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 639,856,430.50 元，占净值比例 7.14%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 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	204,987,973.52	2.29
C	制造业	5,568,934,712.62	62.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,800,374.69	0.92
E	建筑业	10,516.15	0.00

F	批发和零售业	33,417,644.25	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	113,830,365.71	1.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	689,109,796.83	7.69
J	金融业	49,471,956.86	0.55
K	房地产业	104,251,093.09	1.16
L	租赁和商务服务业	20,822,319.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	47,943,282.95	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	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	32,578,428.86	0.36
R	文化、体育和娱乐业	12,594,680.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	6,960,767,971.10	77.71

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	105,299,470.41	1.18
必需消费品	-	-
保健	312,720,965.75	3.49
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	221,835,994.34	2.48
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	639,856,430.50	7.14

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3 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	600845	宝信软件	7,934,453	403,149,556.93	4.50
2	002180	纳思达	11,279,099	386,309,140.75	4.31
3	002594	比亚迪	1,045,105	269,919,268.35	3.01
3	01211	比亚迪股份	41,500	9,565,542.50	0.11
4	600160	巨化股份	14,025,365	193,269,529.70	2.16
5	600399	抚顺特钢	18,868,525	192,458,955.00	2.15
6	002756	永兴材料	2,884,887	180,622,775.07	2.02
7	600276	恒瑞医药	3,684,414	176,483,430.60	1.97
8	603712	七一二	5,291,700	159,253,407.00	1.78
9	300750	宁德时代	646,320	147,871,552.80	1.65
10	000301	东方盛虹	12,453,521	147,200,618.22	1.64
11	688066	航天宏图	2,218,017	135,077,235.30	1.51
12	300068	南都电源	6,740,774	130,501,384.64	1.46
13	01024	快手-W	2,615,000	129,107,855.84	1.44
14	600079	人福医药	4,730,517	127,440,127.98	1.42
15	002025	航天电器	1,902,201	121,360,423.80	1.35
16	000975	银泰黄金	9,950,928	116,425,857.60	1.30
17	600989	宝丰能源	8,667,600	109,298,436.00	1.22
18	603799	华友钴业	2,372,110	108,903,570.10	1.22
19	600760	中航沈飞	2,311,722	104,027,490.00	1.16
20	03690	美团-W	849,020	95,733,927.91	1.07
21	600519	贵州茅台	56,000	94,696,000.00	1.06
22	688687	凯因科技	3,203,865	94,514,017.50	1.06
23	002179	中航光电	2,003,381	90,853,328.35	1.01
24	00700	腾讯控股	294,600	90,067,636.13	1.01
25	605123	派克新材	823,180	89,438,507.00	1.00
26	600988	赤峰黄金	6,579,652	88,562,115.92	0.99
27	600587	新华医疗	2,498,431	87,063,409.52	0.97
28	002007	华兰生物	3,620,204	81,128,771.64	0.91
29	605020	永和股份	3,124,520	80,643,861.20	0.90
30	002402	和而泰	4,743,463	80,544,001.74	0.90
31	603517	绝味食品	2,161,040	80,282,636.00	0.90
32	600420	国药现代	7,088,390	80,027,923.10	0.89
33	300627	华测导航	2,435,069	79,066,690.43	0.88
34	09995	荣昌生物	2,032,500	64,181,908.99	0.72
34	688331	荣昌生物	253,004	14,104,973.00	0.16
35	002149	西部材料	4,610,900	77,417,011.00	0.86
36	01801	信达生物	2,771,500	75,635,920.07	0.84
37	000403	派林生物	3,669,446	73,242,142.16	0.82
38	300101	振芯科技	3,609,048	69,979,440.72	0.78
39	600380	健康元	5,164,956	65,646,590.76	0.73
40	600329	达仁堂	1,446,960	64,954,034.40	0.73

41	300593	新雷能	2,739,490	62,761,715.90	0.70
42	600011	华能国际	6,695,797	62,003,080.22	0.69
43	300406	九强生物	2,519,511	58,780,191.63	0.66
44	001270	铖昌科技	681,047	58,749,243.10	0.66
45	600990	四创电子	1,731,840	54,795,417.60	0.61
46	601089	福元医药	3,295,182	53,711,466.60	0.60
47	002334	英威腾	4,001,899	50,984,193.26	0.57
48	603565	中谷物流	4,700,339	50,763,661.20	0.57
49	002531	天顺风能	3,329,172	50,703,289.56	0.57
50	600048	保利发展	3,818,643	49,756,918.29	0.56
51	300558	贝达药业	1,033,589	49,643,279.67	0.55
52	300773	拉卡拉	2,775,037	48,396,645.28	0.54
53	06078	海吉亚医疗	1,236,600	48,341,107.84	0.54
54	688428	诺诚健华	3,156,771	36,460,705.05	0.41
54	09969	诺诚健华	1,587,000	10,330,066.76	0.12
55	000002	万科 A	3,326,840	46,642,296.80	0.52
56	603633	徕木股份	3,495,548	45,686,812.36	0.51
57	688008	澜起科技	751,824	42,640,834.08	0.48
58	301327	华宝新能	534,662	42,297,110.82	0.47
59	603379	三美股份	1,789,420	42,069,264.20	0.47
60	301117	佳缘科技	649,600	41,977,152.00	0.47
61	605186	健麾信息	830,800	41,124,600.00	0.46
62	300451	创业慧康	4,799,100	40,216,458.00	0.45
63	002332	仙琚制药	3,031,000	40,160,750.00	0.45
64	688276	百克生物	628,182	39,324,193.20	0.44
65	002698	博实股份	2,016,700	35,272,083.00	0.39
66	600976	健民集团	432,400	33,333,716.00	0.37
67	000858	五粮液	201,496	32,958,700.72	0.37
68	600763	通策医疗	336,100	32,554,646.00	0.36
69	002262	恩华药业	1,038,100	32,004,623.00	0.36
70	688776	国光电气	376,752	31,225,205.76	0.35
71	300679	电连技术	943,350	31,177,717.50	0.35
72	600872	中炬高新	815,380	29,997,830.20	0.33
73	000059	华锦股份	4,628,000	29,110,120.00	0.32
74	688681	科汇股份	1,779,394	28,755,007.04	0.32
75	688071	华依科技	493,566	28,103,648.04	0.31
76	688084	晶品特装	309,519	26,887,915.53	0.30
77	301122	采纳股份	752,733	26,812,349.46	0.30
78	601318	中国平安	560,500	26,007,200.00	0.29
79	600391	航发科技	1,070,500	25,809,755.00	0.29
80	301328	维峰电子	450,926	25,675,726.44	0.29
81	000768	中航西飞	955,126	25,549,620.50	0.29
82	603885	吉祥航空	1,622,452	25,034,434.36	0.28
83	688233	神工股份	792,110	25,014,833.80	0.28

84	09688	再鼎医药	1,291,400	25,003,544.41	0.28
85	301011	华立科技	1,058,591	24,802,787.13	0.28
86	300797	钢研纳克	1,316,698	24,279,911.12	0.27
87	600030	中信证券	1,186,287	23,464,756.86	0.26
88	002475	立讯精密	721,200	23,402,940.00	0.26
89	002415	海康威视	679,300	22,491,623.00	0.25
90	688127	蓝特光学	1,224,502	21,587,970.26	0.24
91	603456	九洲药业	783,494	20,997,639.20	0.23
92	688157	松井股份	395,974	20,828,232.40	0.23
93	300662	科锐国际	588,700	20,822,319.00	0.23
94	300332	天壕环境	1,810,100	20,761,847.00	0.23
95	300979	华利集团	418,908	20,417,575.92	0.23
96	002602	世纪华通	2,647,200	20,092,248.00	0.22
97	002928	华夏航空	2,374,947	20,068,302.15	0.22
98	01548	金斯瑞生物科技	1,232,000	19,991,476.74	0.22
99	002937	兴瑞科技	786,900	19,357,740.00	0.22
100	01167	加科思-B	3,450,000	18,703,286.28	0.21
101	300396	迪瑞医疗	567,400	18,434,826.00	0.21
102	301018	申菱环境	552,825	18,127,131.75	0.20
103	600026	中远海能	1,421,200	17,963,968.00	0.20
104	02137	腾盛博药-B	6,183,000	17,899,891.35	0.20
105	002738	中矿资源	341,880	17,415,367.20	0.19
106	603917	合力科技	727,900	17,091,092.00	0.19
107	600557	康缘药业	602,900	16,555,634.00	0.18
108	000807	云铝股份	1,296,000	16,498,080.00	0.18
109	301093	华兰股份	450,400	15,583,840.00	0.17
110	301306	西测测试	399,131	15,506,239.35	0.17
111	601600	中国铝业	2,765,400	15,182,046.00	0.17
112	600196	复星医药	486,300	15,026,670.00	0.17
113	300604	长川科技	300,800	14,284,992.00	0.16
114	300790	宇瞳光学	915,440	13,951,305.60	0.16
115	002463	沪电股份	644,200	13,489,548.00	0.15
116	300144	宋城演艺	1,015,700	12,594,680.00	0.14
117	600581	八一钢铁	2,922,400	11,835,720.00	0.13
118	02171	科济药业-B	1,261,000	11,265,756.60	0.13
119	688696	极米科技	77,882	10,855,971.98	0.12
120	688029	南微医学	129,183	10,536,165.48	0.12
121	300482	万孚生物	377,190	10,044,569.70	0.11
122	300757	罗博特科	109,500	9,637,095.00	0.11
123	000738	航发控制	357,300	8,718,120.00	0.10
124	000733	振华科技	90,652	8,688,994.20	0.10
125	02186	绿叶制药	2,825,000	8,621,204.49	0.10
126	300009	安科生物	858,900	8,589,000.00	0.10
127	301235	华康医疗	255,900	8,142,738.00	0.09

128	001979	招商蛇口	602,600	7,851,878.00	0.09
129	688658	悦康药业	371,153	7,723,693.93	0.09
130	09939	开拓药业-B	2,079,500	6,882,954.10	0.08
131	600765	中航重机	226,500	6,004,515.00	0.07
132	000063	中兴通讯	129,541	5,899,297.14	0.07
133	300203	聚光科技	267,500	5,422,225.00	0.06
134	00013	和黄医药	311,500	5,295,908.44	0.06
135	688268	华特气体	55,664	4,493,754.72	0.05
136	002436	兴森科技	275,800	4,274,900.00	0.05
137	603986	兆易创新	40,200	4,271,250.00	0.05
138	002271	东方雨虹	143,800	3,919,988.00	0.04
139	688020	方邦股份	56,157	2,806,165.29	0.03
140	300294	博雅生物	77,100	2,797,188.00	0.03
141	01119	创梦天地	834,000	2,660,502.37	0.03
142	300775	三角防务	77,403	2,585,260.20	0.03
143	600038	中直股份	58,900	2,345,398.00	0.03
144	300274	阳光电源	19,800	2,309,274.00	0.03
145	301322	绿通科技	28,500	1,600,275.00	0.02
146	300653	正海生物	46,400	1,595,696.00	0.02
147	603225	新风鸣	128,000	1,414,400.00	0.02
148	09996	沛嘉医疗-B	100,000	567,939.68	0.01
149	600867	通化东宝	51,900	541,836.00	0.01
150	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.00
151	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
152	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
153	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
154	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
155	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
156	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
157	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
158	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.00
159	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
160	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
161	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
162	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
163	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
164	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
165	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
166	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
167	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
168	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
169	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
170	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
171	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00

172	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
173	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
174	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
175	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
176	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
177	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
178	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
179	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
180	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
181	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
182	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
183	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
184	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
185	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
186	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
187	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
188	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
189	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
190	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
191	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
192	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
193	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
194	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
195	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
196	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
197	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
198	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
199	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
200	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
201	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
202	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
203	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
204	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
205	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
206	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
207	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
208	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
209	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
210	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
211	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
212	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
213	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
214	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
215	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00

216	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
217	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
218	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
219	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
220	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
221	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
222	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	300014	亿纬锂能	190,318,591.08	1.99
2	603799	华友钴业	184,762,165.10	1.93
3	600276	恒瑞医药	157,076,198.02	1.64
4	600399	抚顺特钢	152,095,444.96	1.59
5	603712	七一二	122,415,206.04	1.28
6	002180	纳思达	115,489,129.73	1.21
7	600160	巨化股份	110,006,636.91	1.15
8	600079	人福医药	104,208,053.01	1.09
9	01801	信达生物	100,834,873.81	1.05
10	600420	国药现代	91,044,339.95	0.95
11	09995	荣昌生物	74,254,812.96	0.78
11	688331	荣昌生物	15,853,620.70	0.17
12	03690	美团-W	82,513,193.13	0.86
13	002007	华兰生物	81,432,674.86	0.85
14	600760	中航沈飞	72,010,117.70	0.75
15	600380	健康元	67,711,300.48	0.71
16	600845	宝信软件	60,723,766.48	0.63
17	002179	中航光电	59,493,945.64	0.62
18	001270	铖昌科技	57,109,327.40	0.60
19	601089	福元医药	57,020,752.61	0.60
20	300406	九强生物	53,892,499.63	0.56

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。

##### 7.4.2 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	600519	贵州茅台	265,321,390.87	2.77

2	300014	亿纬锂能	201,360,047.55	2.11
3	002049	紫光国微	197,931,108.96	2.07
4	600309	万华化学	188,478,189.02	1.97
5	000858	五粮液	128,539,033.17	1.34
6	002465	海格通信	128,230,404.40	1.34
7	01211	比亚迪股份	60,272,744.52	0.63
7	002594	比亚迪	37,859,990.00	0.40
8	300059	东方财富	83,903,303.91	0.88
9	300750	宁德时代	83,057,297.98	0.87
10	603993	洛阳钼业	80,890,621.81	0.85
11	601888	中国中免	70,622,689.51	0.74
12	00883	中国海洋石油	65,615,795.90	0.69
13	000807	云铝股份	62,446,513.33	0.65
14	000762	西藏矿业	61,127,060.69	0.64
15	688008	澜起科技	60,755,450.93	0.64
16	688800	瑞可达	59,472,529.26	0.62
17	600498	烽火通信	56,178,695.04	0.59
18	002531	天顺风能	55,955,907.01	0.58
19	003029	吉大正元	53,623,576.00	0.56
20	002304	洋河股份	52,923,835.00	0.55

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。

#### 7.4.3 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	4,226,631,690.48
卖出股票收入（成交）总额	3,103,468,389.43

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 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。

**7.9 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。

**7.10 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。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 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。

**7.12.2** 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。

**7.12.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	352,322.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	109,544.15
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	461,866.55

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603712	七一二	11,653,389.00	0.13	大宗交易流通受限

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东减持或者特定股东减持，采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%；前款交易的受让方在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
易方达品质动能三年持有混合 A	106,487	80,866.97	43,916,481.30	0.51%	8,567,364,050.38	99.49%
易方达品质动能三年持有混合 C	52,833	24,771.41	46,784,520.98	3.57%	1,261,963,411.73	96.43%
合计	159,320	62,264.80	90,701,002.28	0.91%	9,829,327,462.11	99.09%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达品质动能三年持有混合 A	25,906,047.78	0.3008%
	易方达品质动能三年持有混合 C	2,211,261.48	0.1690%
	合计	28,117,309.26	0.2834%

## 8.3 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的情况

项目	份额级别	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	易方达品质动能三年持有混合 A	>100
	易方达品质动能三年持有混合 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达品质动能三年持有混合 A	0
	易方达品质动能三年持有混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达品质动能三年持有混合 A	易方达品质动能三年持有混合 C
基金合同生效日（2022 年 7 月 7 日）基金份额总额	8,604,825,079.00	1,306,385,213.63
本报告期期初基金份额总额	8,604,825,079.00	1,306,385,213.63
本报告期基金总申购份额	6,455,452.68	2,362,719.08
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,611,280,531.68	1,308,747,932.71

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 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。

## 10.2 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 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起聘任王骏先生为副总经理级高级管理人员（首席市场官）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 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。

## 10.4 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。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
广发证券	3	2,334,779,537.94	32.49%	1,451,029.63	32.49%	-
国信证券	3	3,612,982,249.42	50.28%	2,245,166.00	50.28%	-
中金财富	3	1,238,240,131.33	17.23%	769,369.85	17.23%	-

注：a) 本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

b) 本基金选择的证券经纪商为广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司。广发证券股份有限公司系本基金管理人的股东。本基金管理人与国信证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司不存在关联方关系。

c) 证券经营机构的佣金费率如下：

广发证券股份有限公司：沪深交易所 A 股股票交易佣金率为 0.07%（包含经手费、证管费、过户费），北交所股票交易佣金率为 0.045%（包含经手费），新三板股票交易佣金率为 0.07%（包含经手费），基金交易佣金率为 0.03%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，港股通股票交易佣金率为 0.07065%（包含交易征费及交易费、财汇局交易征费），债券、回购交易佣金率为 0.001%。

国信证券股份有限公司：沪深交易所 A 股股票交易佣金率为 0.069%（包含经手费、证管费），北交所和新三板股票交易佣金率为 0.07%（包含经手费），基金交易佣金率为 0.03%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，港股通股票交易佣金率为 0.06215%，债券、回购交易佣金率为 0.001%。

中国中金财富证券有限公司：沪深交易所 A 股股票交易佣金率为 0.069%（包含经手费、证管费），北交所和新三板股票交易佣金率为 0.07%（包含经手费），基金交易佣金率为 0.03%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，港股通股票交易佣金率为 0.06215%，债券、回购交易佣金率为 0.001%。

d) 本基金管理人负责选择证券经营机构，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、个股分析的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。

e) 基金的证券经营机构的选择程序如下：

- 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经纪服务协议。

#### 10.7.2 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
广发证券	12,202,088.58	56.96%	-	-	-	-
国信证券	6,966,802.00	32.52%	-	-	-	-
中金财富	2,252,686.23	10.52%	-	-	-	-

#### 10.8 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部分基金获配三角防务（300775）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-06
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配九洲药业（603456）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-01-20
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配新华医疗（600587）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-25
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报	2023-03-30
6	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金	中国证券报、基金管理人	2023-04-06

	获配申菱环境（301018）非公开发行 A 股的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
8	易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-18
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-04-21
10	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配华依科技（688071）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
12	关于易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金 2023 年港股通非交易日暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-19
13	关于旗下部分基金 2023 年 5 月 26 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-23
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达品质动能三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 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。

### 11.3 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

二〇二三年八月三十日