

易方达优质精选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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5	信息披露方式	6
2.6	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.4	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 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	14
6.3	净资产（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	41
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	42
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	42
7.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	43
7.5	报告期内权益投资组合的重大变动	53
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	55
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	55
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	55
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	55

7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	55
7.11	投资组合报告附注	56
§ 8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9	开放式基金份额变动	57
§ 10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
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	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
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	62
§ 11	备查文件目录	63
11.1	备查文件目录	63
11.2	存放地点	63
11.3	查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达优质精选混合型证券投资基金
基金简称	易方达优质精选混合（QDII）
基金主代码	110011
交易代码	110011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 10 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,064,650,878.02 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选优质企业，力求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。
投资策略	资产配置方面，本基金结合宏观经济与市场分析，评估各类资产的预期收益与风险，在基金合同约定的范围内，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，本基金基于深度的研究分析，在内地和香港市场精选具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的优质企业；本基金投资存托凭证的策略依照上述股票投资策略执行。其他投资策略方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资；可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上进行资产支持证券投资；根据风险管理的原则并综合考虑多种因素，可投资股指期货、国债期货、股票期权；可在符合有关法律法规、严格控制风险的前提下，进行证券借贷交易、回购交易、融资交易等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证香港 300 指数收益率×30%+中债总指数收益率×20%
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。 本基金可投资港股通股票以及港股通以外的香港市场挂牌交易的股票，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、股价波动较大的风险等投资于香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有风险。本基金投资香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街1 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	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	葛海蛟

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	无	中国银行(香港)有限公司
注册地址		无	香港中环花园道一号, 中银大厦 12 楼
办公地址		无	香港德辅道中 2A 中国银行大厦 5 楼
邮政编码		无	无

2.5 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

2.6 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）
本期已实现收益	-124,476,129.36
本期利润	-2,040,367,713.22
加权平均基金份额本期利润	-0.6647
本期加权平均净值利润率	-11.08%
本期基金份额净值增长率	-10.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	12,862,987,592.41
期末可供分配基金份额利润	4.1972
期末基金资产净值	16,727,280,200.61
期末基金份额净值	5.4581
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-26.13%

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
过去一个月	3.84%	1.56%	2.41%	0.77%	1.43%	0.79%
过去三个月	-11.59%	1.25%	-3.30%	0.70%	-8.29%	0.55%
过去六个月	-10.92%	1.36%	-0.49%	0.73%	-10.43%	0.63%
过去一年	-18.99%	1.73%	-9.11%	0.89%	-9.88%	0.84%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-26.13%	1.82%	-17.49%	0.97%	-8.64%	0.85%

3.2.2 自基金转型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

易方达优质精选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
 (2021 年 9 月 10 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：1.本基金由原易方达中小盘混合型证券投资基金于 2021 年 9 月 10 日变更注册而来。

2.自基金变更注册至报告期末，基金份额净值增长率为-26.13%，同期业绩比较基准收益率为-17.49%。

§ 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		

张坤	本基金的基金经理，易方达亚洲精选股票（QDII）、易方达蓝筹精选混合、易方达优质企业三年持有混合的基金经理，副总经理级高级管理人员、权益投资决策委员会委员	2021-09-10	-	15 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、研究部总经理助理，易方达中小盘混合、易方达新丝路混合的基金经理。
----	---	------------	---	------	---

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、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相应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，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，A 股市场先涨后跌，沪深 300 指数下跌 0.75%，上证指数上涨 3.65%，而创业板指数下跌 5.61%。香港市场情况类似，恒生指数下跌 4.37%，恒生中国企业指数下跌 4.18%。

上半年，自 2023 年 1 月 8 日起，对新型冠状病毒感染实施“乙类乙管”，近三年按照甲类传染病的防控宣告结束，生活开始逐步恢复到疫情前的状态，年初市场对经济复苏较为乐观。然而二季度以来，市场对经济复苏的力度进行了一定下修，居民消费的意愿并不强劲，超额储蓄仍然维持在较高水平，地产销售和投资仍有一定的压力。此外，市场对长期经济增长受地缘政治的影响程度仍有一定担忧。货币政策方面，6 月 20 日，中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布，1 年期和 5 年期以上 LPR（贷款市场报价利率）均下调了 10 个基点。股票市场方面，上半年分化明显，通信、传媒、计算机行业表现较好，而商贸零售、房地产等行业表现相对落后。

本基金在 2023 年上半年股票仓位基本稳定，并对结构进行了调整，增加了消费等行业的配置，降低了金融等行业的配置；个股方面，增加了业务模式有特色、长期逻辑清晰、估值水平合理的个股的投资比例。

4.5.2 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 5.4581 元，本报告期份额净值增长率为-10.92%，同期业绩比较基准收益率为-0.49%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去一段时间，由于经济恢复情况不及预期，一些投资者对经济前景较为悲观，股票市场的表现又进一步强化了预期。事实上，从股票市场到上市公司，都是同时存在着好的一面和坏的一面。但是，市场先生在一个短周期内往往只会聚焦于一面，不是将好的一面放大，就是将坏的一面放大，

放大哪一面更多取决于这个阶段投资者的情绪，正所谓市场短期是投票机。但是，放大好的一面时，坏的一面却并没有消失，只是被投资者无视了，反之亦然。成熟的投资者更应该全面的思考问题，特别是被市场无视但又持续存在并发挥作用的那一面，这样的认知往往是超额收益的来源，正所谓市场长期是称重机。而称重机称的重量更多是企业自由现金流的的增长，只要一个企业产生的自由现金流不断增长，不论投资者的情绪如何，公司的市值是可以一轮一轮跨越周期创新高的。

站在此时，不论投资者的情绪如何，我们更要聚焦在一些长期不变的重要基本事实或者常识上：第一，我们国家依然是 14 亿人口的统一市场，这意味着企业的研发、销售和生产等有巨大的规模效应，并且作为利基市场可以提供自由现金流助力企业走向全球市场；第二，我国有 1.4 亿的高校毕业生，并且仍以每年 1000 万左右的数量增加，这为从发展中国家迈入中等发达国家必经的产业升级提供了人才基础；第三，随着经济发展，中等收入人群不断扩大，而且收入有望持续增长，虽然疫情对短期有所影响，但未来随着经济增长，中等收入人群依然是消费升级的重要驱动力；第四，改革开放 40 多年来的经济腾飞，以及不少华人在海外取得的巨大成就，都证明了中华民族的勤劳与智慧。虽然这些正面因素，并非不为投资者所知，甚至曾在某个阶段成为市场的核心关注点，但目前的市场却选择了无视。不管如何，这些因素都是不会轻易改变并且持续发挥作用的，只要能充分发挥市场的力量，将人的主观能动性充分发挥，对前景悲观是没有理由的。

更重要的是，目前市场的估值水平很有吸引力，已经到了不少优质公司私有化都可以算得过来账的程度了。我们认为，这样的估值对短期遇到的困难定价非常充分，但对于上述长期有利的因素是没有反映的。因此，对于优质企业的长期投资者，目前隐含的复合回报率是相当有吸引力的。

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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达优质精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：易方达优质精选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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	994,725,327.67	1,054,438,985.42
结算备付金		4,371.41	691,206.94
存出保证金		97,982.46	1,209,180.83
交易性金融资产	6.4.7.2	15,793,838,296.74	17,887,174,179.64
其中：股票投资		15,793,838,296.74	17,887,174,179.64
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		-	34,333,016.97
应收股利		24,690,017.57	-
应收申购款		13,703,193.11	23,264,752.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		16,827,059,188.96	19,001,111,322.01
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		51,406,186.05	-
应付赎回款		23,079,031.77	39,405,398.37
应付管理人报酬		21,190,041.83	23,663,527.21
应付托管费		3,531,673.64	3,943,921.19
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.6	572,055.06	503,612.28
负债合计		99,778,988.35	67,516,459.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	3,064,650,878.02	3,090,140,724.90
未分配利润	6.4.7.8	13,662,629,322.59	15,843,454,138.06
净资产合计		16,727,280,200.61	18,933,594,862.96
负债和净资产总计		16,827,059,188.96	19,001,111,322.01

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.4581 元，基金份额总额 3,064,650,878.02 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达优质精选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	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-1,879,519,910.91	-886,422,700.50
1.利息收入		1,841,289.06	1,627,318.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,841,289.06	1,627,318.36
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		33,796,502.30	-344,219,532.50
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-162,519,544.48	-527,281,282.27
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	196,316,046.78	183,061,749.77
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,915,891,583.86	-549,450,307.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-2,175,911.05	2,738,953.35

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,909,792.64	2,880,867.96
减：二、营业总支出		160,847,802.31	156,470,721.73
1. 管理人报酬		137,509,823.90	133,652,824.91
2. 托管费		22,918,303.94	22,275,470.84
3. 销售服务费		-	-
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	419,674.47	542,425.98
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,040,367,713.22	-1,042,893,422.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,040,367,713.22	-1,042,893,422.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,040,367,713.22	-1,042,893,422.23

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达优质精选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）	3,090,140,724.90	15,843,454,138.06	18,933,594,862.96
二、本期期初净资产（基金净值）	3,090,140,724.90	15,843,454,138.06	18,933,594,862.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,489,846.88	-2,180,824,815.47	-2,206,314,662.35
（一）、综合收益总额	-	-2,040,367,713.22	-2,040,367,713.22
（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）	-25,489,846.88	-140,457,102.25	-165,946,949.13
其中：1.基金申	322,804,477.15	1,637,403,805.25	1,960,208,282.40

购款			
2. 基金赎回款	-348,294,324.03	-1,777,860,907.50	-2,126,155,231.53
(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)	3,064,650,878.02	13,662,629,322.59	16,727,280,200.61
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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)	2,791,221,583.39	17,192,439,943.11	19,983,661,526.50
二、本期期初净资产(基金净值)	2,791,221,583.39	17,192,439,943.11	19,983,661,526.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	162,226,836.50	-246,034,776.80	-83,807,940.30
(一)、综合收益总额	-	-1,042,893,422.23	-1,042,893,422.23
(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)	162,226,836.50	796,858,645.43	959,085,481.93
其中：1. 基金申购款	516,601,439.41	2,672,800,440.22	3,189,401,879.63
2. 基金赎回款	-354,374,602.91	-1,875,941,794.79	-2,230,316,397.70
(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)	2,953,448,419.89	16,946,405,166.31	19,899,853,586.20

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：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达优质精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册而成。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]2431号《关于准予易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册的批复》和基金管理人于2021年9月10日发布的《易方达基金管理有限公司关于易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金,并相应调整基金投资策略和投资比例限制、业绩比较基准、开放日安排、估值条款、基金费用条款、收益分配政策等,基金名称相应变更为“易方达优质精选混合型证券投资基金”。2021年9月10日起,原《易方达中小盘混合型证券投资基金基金合同》失效,《易方达优质精选混合型证券投资基金基金合同》生效。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,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》《易方达优质精选混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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净资产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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、

财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(2)对基金从境内证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

(3)对基金从境内上市公司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，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非

H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(5) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(6) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(7) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	994,725,327.67
等于：本金	994,638,492.88
加：应计利息	86,834.79
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	994,725,327.67

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	19,354,324,207.51	-	15,793,838,296.74	-3,560,485,910.77
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		19,354,324,207.5	-	15,793,838,296.74	-3,560,485,910.77
		1			

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

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	20,708.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	297,374.46
其中：交易所市场	297,374.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	253,972.33

合计	572,055.06
----	------------

6.4.7.7 实收基金

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	3,090,140,724.90	3,090,140,724.90
本期申购	322,804,477.15	322,804,477.15
本期赎回（以“-”号填列）	-348,294,324.03	-348,294,324.03
本期末	3,064,650,878.02	3,064,650,878.02

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

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	13,095,396,733.49	2,748,057,404.57	15,843,454,138.06
本期利润	-124,476,129.36	-1,915,891,583.86	-2,040,367,713.22
本期基金份额交易产生的变动数	-107,933,011.72	-32,524,090.53	-140,457,102.25
其中：基金申购款	1,350,212,732.43	287,191,072.82	1,637,403,805.25
基金赎回款	-1,458,145,744.15	-319,715,163.35	-1,777,860,907.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,862,987,592.41	799,641,730.18	13,662,629,322.59

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	-
结算备付金利息收入	71,847.29
其他	2,395.83
合计	1,841,289.06

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
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	-162,519,544.48

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	1,526,309,897.55
减：卖出股票成本总额	1,682,989,221.54
减：交易费用	5,840,220.49
买卖股票差价收入	-162,519,544.48

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 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	196,316,046.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	196,316,046.78

6.4.7.16 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	-1,915,891,583.86
——股票投资	-1,915,891,583.86
——债券投资	-
——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	-1,915,891,583.86

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	2,909,792.64
合计	2,909,792.64

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 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	64,464.96
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
银行汇划费	17,065.10
港股通证券组合费	190,858.06
其他	69,778.98
合计	419,674.47

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
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

中国银行(香港)有限公司	境外托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

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

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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。

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	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	137,509,823.90	133,652,824.91
其中：支付销售机构的客户维护费	42,593,125.36	40,547,491.00

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等，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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	22,918,303.94		22,275,470.84	

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等，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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

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。

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。

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。

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

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中银香港-活期存款	25,213,333.56	-	91,183,599.06	-
中国银行-活期存款	969,511,994.11	1,767,045.94	1,106,483,344.77	1,506,737.69

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司和中国银行(香港)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 CH	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72
中银国际证券股份有限公司	301397 CH	溯联股份	新股网下发行	3,618	192,730.86
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	301181 CH	标榜股份	新股网下发行	2,564	103,201.00
中银国际证券股份有限公司	600938 CH	中国海油	新股网上发行	3,000	32,400.00

注：中银国际证券股份有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方。

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

本基金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 CH	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	-
001286 CH	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287 CH	中电港	2023-03-30	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324 CH	长青科技	2023-05-12	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328 CH	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360 CH	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367 CH	海森药业	2023-03-30	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804 CH	广康生化	2023-06-15	6个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141 CH	中科磁业	2023-03-27	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157 CH	华塑科技	2023-03-01	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170 CH	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202 CH	朗威股份	2023-06-28	1个月以内	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202 CH	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
30123	飞沃	2023-0	6个月	新股	72.50	58.42	165	11,962	9,639.	-

2 CH	科技	6-08		流通受限				.50	30	
30128 1 CH	科源 制药	2023-0 3-28	6 个月	新股 流通 受限	44.18	25.10	338	10,647 .38	8,483. 80	-
30129 1 CH	明阳 电气	2023-0 6-21	6 个月	新股 流通 受限	38.13	31.03	1,206	45,984 .78	37,422 .18	-
30130 1 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 2 CH	蜂助 手	2023-0 5-09	6 个月	新股 流通 受限	23.80	32.84	408	9,710. 40	13,398 .72	-
30138 6 CH	未来 电器	2023-0 3-21	6 个月	新股 流通 受限	29.99	23.79	378	11,336 .22	8,992. 62	-
30139 7 CH	溯联 股份	2023-0 6-15	6 个月	新股 流通 受限	53.27	40.20	362	19,283 .74	14,552 .40	-
30139 9 CH	英特 科技	2023-0 5-16	6 个月	新股 流通 受限	43.99	51.57	293	12,889 .07	15,110 .01	-
30140 8 CH	华人 健康	2023-0 2-22	6 个月	新股 流通 受限	16.24	16.95	879	14,274 .96	14,899 .05	-
30141 9 CH	阿莱 德	2023-0 2-02	6 个月	新股 流通 受限	24.80	43.85	330	8,184. 00	14,470 .50	-
30142 8 CH	世纪 恒通	2023-0 5-10	6 个月	新股 流通 受限	26.35	30.60	229	6,034. 15	7,007. 40	-
30143 9 CH	泓淋 电力	2023-0 3-10	6 个月	新股 流通 受限	19.99	16.90	949	18,970 .51	16,038 .10	-
30148 6 CH	致尚 科技	2023-0 6-30	1 个月 以内	新股 流通 受限	57.66	57.66	4,338	250,12 9.08	250,12 9.08	-
30148 6 CH	致尚 科技	2023-0 6-30	6 个月	新股 流通 受限	57.66	57.66	482	27,792 .12	27,792 .12	-
30148 8 CH	豪恩 汽电	2023-0 6-26	1 个月 以内	新股 流通 受限	39.78	39.78	2,356	93,721 .68	93,721 .68	-
30148 8 CH	豪恩 汽电	2023-0 6-26	6 个月	新股 流通 受限	39.78	39.78	262	10,422 .36	10,422 .36	-
60106 1 CH	中信 金属	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	6.58	7.58	4,016	26,425 .28	30,441 .28	-
60106 5 CH	江盐 集团	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通	10.36	11.84	875	9,065. 00	10,360 .00	-

				受限						
60113 3 CH	柏诚 股份	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	11.66	12.26	664	7,742. 24	8,140. 64	-
60312 5 CH	常青 科技	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	25.98	24.53	160	4,156. 80	3,924. 80	-
60313 5 CH	中重 科技	2023-0 3-29	6 个月	新股 流通 受限	17.80	17.89	628	11,178 .40	11,234 .92	-
60313 7 CH	恒尚 节能	2023-0 4-10	6 个月	新股 流通 受限	15.90	17.09	139	2,210. 10	2,375. 51	-
60317 2 CH	万丰 股份	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	14.58	16.13	122	1,778. 76	1,967. 86	-
68814 6 CH	中船 特气	2023-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	36.15	38.13	1,011	36,547 .65	38,549 .43	-
68833 4 CH	西高 院	2023-0 6-09	6 个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	888	12,574 .08	14,394 .48	-
68835 2 CH	颀中 科技	2023-0 4-11	6 个月	新股 流通 受限	12.10	12.07	2,361	28,568 .10	28,497 .27	-
68836 1 CH	中科 飞测	2023-0 5-12	6 个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	831	19,611 .60	53,740 .77	-
68842 9 CH	时创 能源	2023-0 6-20	6 个月	新股 流通 受限	19.20	25.53	346	6,643. 20	8,833. 38	-
68843 3 CH	华曙 高科	2023-0 4-07	6 个月	新股 流通 受限	26.66	31.50	418	11,143 .88	13,167 .00	-
68844 3 CH	智翔 金泰	2023-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	37.88	29.49	3,033	114,89 0.04	89,443 .17	-
68846 9 CH	中芯 集成	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	5.69	5.41	13,800	78,522 .00	74,658 .00	-
68847 2 CH	阿特 斯	2023-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	11.10	17.04	6,261	69,497 .10	106,68 7.44	-
68847	晶升	2023-0	6 个月	新股	32.52	42.37	402	13,073	17,032	-

8 CH	股份	4-13		流通受限				.04	.74	
688479 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	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	-
688629 CH	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-

68863 1 CH	莱斯 信息	2023-0 6-19	6 个月	新股 流通 受限	25.28	29.87	336	8,494. 08	10,036 .32	-
---------------	----------	----------------	------	----------------	-------	-------	-----	--------------	---------------	---

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。

本基金可投资港股通股票以及港股通以外的香港市场挂牌交易的股票，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、股价波动较大的风险等投资于香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有风险。本基金投资香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有风险详见招募说明书。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。本基金在境内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；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。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：0.00%)。

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	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。本基金可投资境外市场，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。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，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	994,725,327.67	-	-	-	994,725,327.67
结算备付金	4,371.41	-	-	-	4,371.41
存出保证金	97,982.46	-	-	-	97,982.46
交易性金融资产	-	-	-	15,793,838,296.74	15,793,838,296.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	24,690,017.57	24,690,017.57
应收申购款	-	-	-	13,703,193.11	13,703,193.11
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	994,827,681.54	-	-	15,832,231,507.42	16,827,059,188.96
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	-	-	-	51,406,186.05	51,406,186.05
应付赎回款	-	-	-	23,079,031.77	23,079,031.77
应付管理人报酬	-	-	-	21,190,041.83	21,190,041.83
应付托管费	-	-	-	3,531,673.64	3,531,673.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	572,055.06	572,055.06
负债总计	-	-	-	99,778,988.35	99,778,988.35
利率敏感度缺口	994,827,681.54	-	-	15,732,452,519.07	16,727,280,200.00

				7	0.61
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	1,054,438,985.42	-	-	-	1,054,438,985.42
结算备付金	691,206.94	-	-	-	691,206.94
存出保证金	1,209,180.83	-	-	-	1,209,180.83
交易性金融资产	-	-	-	17,887,174,179.64	17,887,174,179.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	34,333,016.97	34,333,016.97
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	23,264,752.21	23,264,752.21
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,056,339,373.19	-	-	17,944,771,948.82	19,001,111,322.01
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	-	-	-	39,405,398.37	39,405,398.37
应付管理人报酬	-	-	-	23,663,527.21	23,663,527.21
应付托管费	-	-	-	3,943,921.19	3,943,921.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	503,612.28	503,612.28
负债总计	-	-	-	67,516,459.05	67,516,459.05
利率敏感度缺口	1,056,339,373.19	-	-	17,877,255,489.7	18,933,594,862.01

				7	2.96
--	--	--	--	---	------

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

本基金可投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外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				
银行存款	25,091,402.63	122,388.58	-	25,213,791.21
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	7,547,189,863.88	-	7,547,189,863.88
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	25,091,402.63	7,547,312,252.46	-	7,572,403,655.09
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	25,091,402.63	7,547,312,252.46	-	7,572,403,655.09
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				
银行存款	1,446,686.71	77,798,557.34	-	79,245,244.05
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	8,459,311,343.22	-	8,459,311,343.22
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,446,686.71	8,537,109,900.56	-	8,538,556,587.27
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,446,686.71	8,537,109,900.56	-	8,538,556,587.27

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%	-378,620,182.75	-426,927,829.36
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	378,620,182.75	426,927,829.36

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	15,793,838,29 6.74	94.42	17,887,174,17 9.64	94.47
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	15,793,838,29 6.74	94.42	17,887,174,17 9.64	94.47

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%	789,691,910.78	894,358,705.51
	2.业绩比较基准下降 5%	-789,691,910.78	-894,358,705.51

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	15,792,063,384.64
第二层次	461,074.44
第三层次	1,313,837.66
合计	15,793,838,296.74

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

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	15,793,838,296.74	93.86
	其中：普通股	15,793,838,296.74	93.86
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	994,729,699.08	5.91
8	其他各项资产	38,491,193.14	0.23
9	合计	16,827,059,188.96	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 4,519,551,225.24 元，占净值比例 27.02%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国	8,246,648,432.86	49.30
中国香港	7,547,189,863.88	45.12
合计	15,793,838,296.74	94.42

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	475,004,096.00	2.84
材料	93,213.65	0.00
工业	289,920.99	0.00
非必需消费品	3,948,191,079.09	23.60
必需消费品	7,129,738,579.30	42.62
保健	802,022,851.74	4.79
金融	1,608,277,593.60	9.61

信息技术	475,449.40	0.00
电信服务	1,828,939,101.84	10.93
公用事业	35,447.47	0.00
房地产	-	-
其他-GICS 未分类	770,963.66	0.00
合计	15,793,838,296.74	94.42

注：1.以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

2.本基金本报告期末持有的部分股票尚无 GICS 行业分类，因此将其归入“其他-GICS 未分类”。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证 券交易 所	中国香港	5,430,000	1,660,106,124.24	9.92
2	Kweichow Moutai Co.,Ltd.	贵州茅台酒股份有限公司	600519 CH	上海证 券交易 所	中国	980,000	1,657,180,000.00	9.91
3	Luzhou Laojiao Co.,Ltd	泸州老窖股份有限公司	000568 CH	深圳证 券交易 所	中国	7,350,000	1,540,339,500.00	9.21
4	Wuliangye Yibin Co.,Ltd	宜宾五粮液股份有限公司	000858 CH	深圳证 券交易 所	中国	9,230,000	1,509,751,100.00	9.03
5	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	江苏洋河酒厂股份有限公司	002304 CH	深圳证 券交易 所	中国	11,033,000	1,449,184,550.00	8.66
6	JD.com, Inc.	京东集团股份有限公司	9618 HK	香港证 券交易 所	中国香港	9,700,067	1,184,088,653.10	7.08
7	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	600036 CH	上海证 券交易 所	中国	35,800,000	1,172,808,000.00	7.01
8	Inner Mongolia	内蒙古伊利实业集	600887 CH	上海证 券交易	中国	32,000,000	906,240,000.00	5.42

	Yili Industrial Group Co.,Ltd.	团股份有 限公司		所				
9	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴 集团控股 有限公司	9988 HK	香港证 券交易 所	中国香港	11,800,000	883,404,356.80	5.28
10	Meituan	美团	3690 HK	香港证 券交易 所	中国香港	6,600,000	744,203,816.40	4.45
11	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	药明生物 技术有限 公司	2269 HK	香港证 券交易 所	中国香港	20,000,000	692,406,980.00	4.14
12	CNOOC Limited	中国海洋 石油有限 公司	883 HK	香港证 券交易 所	中国香港	46,000,000	475,004,096.00	2.84
13	H World Group Limited	华住集团 有限公司	1179 HK	香港证 券交易 所	中国香港	17,000,000	474,128,215.00	2.83
14	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	香港交易 及结算所 有限公司	388 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,600,000	435,469,593.60	2.60
15	Yum China Holdings, Inc.	百胜中国 控股有限 公司	9987 HK	香港证 券交易 所	中国香港	930,000	378,646,122.24	2.26
16	Li Ning Co. Ltd.	李宁有限 公司	2331 HK	香港证 券交易 所	中国香港	7,300,000	283,688,636.10	1.70
17	NetEase, Inc	网易公司	9999 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,200,000	168,832,977.60	1.01
18	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	海吉亚医 疗控股有 限公司	6078 HK	香港证 券交易 所	中国香港	2,800,000	109,457,465.60	0.65
19	Giant Biogene Holding	巨子生物 控股有限 公司	2367 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,800,000	57,752,827.20	0.35

	Co Ltd							
20	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co.,Ltd.	山西杏花村汾酒厂股份有限公司	600809 CH	上海证券交易所	中国	50,100	9,272,007.00	0.06
21	Shenzhen Zesum Technology Co.,Ltd	深圳市致尚科技股份有限公司	301486 CH	深圳证券交易所	中国	4,820	277,921.20	0.00
22	Nanjing Les Information Technology Co., Ltd	南京莱斯信息技术股份有限公司	688631 CH	上海证券交易所	中国	3,357	108,400.08	0.00
23	CSI Solar Co., Ltd.	阿特斯阳光电力集团股份有限公司	688472 CH	上海证券交易所	中国	6,261	106,687.44	0.00
24	Longhorn Auto Co.,Ltd.	深圳市豪恩汽车电子装备股份有限公司	301488 CH	深圳证券交易所	中国	2,618	104,144.04	0.00
25	Chongqing Genrix Biopharmaceutical Co., Ltd.	重庆智翔金泰生物制药股份有限公司	688443 CH	上海证券交易所	中国	3,033	89,443.17	0.00
26	Hunan Yuneng New Energy Battery Material Co.,Ltd.	湖南裕能新能源电池材料股份有限公司	301358 CH	深圳证券交易所	中国	2,023	86,766.47	0.00
27	Suzhou Longway Electronic Machinery Co.,Ltd	苏州朗威电子机械股份有限公司	301202 CH	深圳证券交易所	中国	3,060	79,009.20	0.00
28	Semiconductor	绍兴中芯集成电路	688469 CH	上海证券交易所	中国	13,800	74,658.00	0.00

	Manufacturing Electronics (Shaoxing) Corporation	制造股份有限公司		所				
29	Skyverse Technology Co., Ltd.	深圳中科飞测科技股份有限公司	688361 CH	上海证券交易所	中国	831	53,740.77	0.00
30	Wuxi Unicom Technology Co., Ltd.	无锡日联科技股份有限公司	688531 CH	上海证券交易所	中国	346	47,045.62	0.00
31	Peric Special Gases Co., Ltd.	中船(邯郸)派瑞特种气体股份有限公司	688146 CH	上海证券交易所	中国	1,011	38,549.43	0.00
32	Guangdong Mingyang Electric Co., Ltd.	广东明阳电气股份有限公司	301291 CH	深圳证券交易所	中国	1,206	37,422.18	0.00
33	Shaanxi Energy Investment Co., Ltd.	陕西能源投资股份有限公司	001286 CH	深圳证券交易所	中国	3,767	35,447.47	0.00
34	Yili Chuannig Biotechnology Co., Ltd.	伊犁川宁生物技术股份有限公司	301301 CH	深圳证券交易所	中国	3,574	32,023.04	0.00
35	Citic Metal Co., Ltd	中信金属股份有限公司	601061 CH	上海证券交易所	中国	4,016	30,441.28	0.00
36	Shenzhen Cecport Technologies Co., Ltd.	深圳中电港技术股份有限公司	001287 CH	深圳证券交易所	中国	1,386	29,133.72	0.00
37	Hefei Chipmore	合肥硕中科技股份有限公司	688352 CH	上海证券交易所	中国	2,361	28,497.27	0.00

	Technology Co.,Ltd.	有限公司		所				
38	Shanghai Suochen Information Technology Co.,Ltd.	上海索辰信息科技有限公司	688507 CH	上海证券交易所	中国	222	27,108.42	0.00
39	Anhui Xdlk Microsystem Corporation Limited	安徽芯动联科微系统股份有限公司	688582 CH	上海证券交易所	中国	648	26,360.64	0.00
40	Aerospace Nanhu Electronic Information Technology Co., Ltd	航天南湖电子信息技术有限公司	688552 CH	上海证券交易所	中国	956	22,466.00	0.00
41	Beijing Tianma Intelligent Control Technology Co., Ltd.	北京天玛智控科技股份有限公司	688570 CH	上海证券交易所	中国	884	22,391.72	0.00
42	Chongqing Millison Technologies Inc.	重庆美利信科技股份有限公司	301307 CH	深圳证券交易所	中国	687	21,887.82	0.00
43	Hangzhou Aags Medtech Co., Ltd.	杭州安杰思医学科技股份有限公司	688581 CH	上海证券交易所	中国	163	19,238.89	0.00
44	Crystal Growth& Energy Equipment Co.,Ltd.	南京晶升装备股份有限公司	688478 CH	上海证券交易所	中国	402	17,032.74	0.00
45	Beijing Shenzhou Aerospace	北京神舟航天软件技术股份	688562 CH	上海证券交易所	中国	726	16,197.06	0.00

	Software Technology Co., Ltd.	有限公司							
46	Weihai Honglin Electronic Co., Ltd.	威海市泓淋电力技术股份有限公司	301439 CH	深圳证券交易所	中国	949	16,038.10	0.00	
47	Zhejiang Shuangyuan Technology Co., Ltd.	浙江双元科技股份有限公司	688623 CH	上海证券交易所	中国	178	15,448.62	0.00	
48	Guangdong Deerma Technology Co., Ltd.	广东德尔玛科技股份有限公司	301332 CH	深圳证券交易所	中国	1,122	15,405.06	0.00	
49	Zhejiang Extek Technology Co., Ltd.	浙江英特科技股份有限公司	301399 CH	深圳证券交易所	中国	293	15,110.01	0.00	
50	Anhui Huaren Health Pharmaceutical Co., Ltd.	安徽华人健康医药股份有限公司	301408 CH	深圳证券交易所	中国	879	14,899.05	0.00	
51	Shenzhen Leoking Environmental Group Company Limited.	深圳市朗坤环境集团股份有限公司	301305 CH	深圳证券交易所	中国	753	14,826.57	0.00	
52	Chongqing Sulian Plastic Co., Ltd.	重庆溯联塑胶股份有限公司	301397 CH	深圳证券交易所	中国	362	14,552.40	0.00	
53	Shanghai Allied Industrial Co., Ltd.	上海阿莱德实业股份有限公司	301419 CH	深圳证券交易所	中国	330	14,470.50	0.00	

54	Xi'an High Voltage Apparatus Research Institute Co., Ltd.	西安高压电器研究院股份有限公司	688334 CH	上海证券交易所	中国	888	14,394.48	0.00
55	Shanghai New Vision Microelectronics Co., Ltd	上海新相微电子股份有限公司	688593 CH	上海证券交易所	中国	959	13,991.81	0.00
56	Fengzhou Co., Ltd.	蜂助手股份有限公司	301382 CH	深圳证券交易所	中国	408	13,398.72	0.00
57	Farsoon Technologies Co., Ltd.	湖南华曙高科技股份有限公司	688433 CH	上海证券交易所	中国	418	13,167.00	0.00
58	Sichuan Huafeng Technology Co., LTD.	四川华丰科技股份有限公司	688629 CH	上海证券交易所	中国	708	13,161.72	0.00
59	Guangzhou Anyka Microelectronics Co., Ltd.	广州安凯微电子股份有限公司	688620 CH	上海证券交易所	中国	1,016	12,537.44	0.00
60	Rongcheer Industrial Technology (Suzhou) Co., Ltd.	荣旗工业科技(苏州)股份有限公司	301360 CH	深圳证券交易所	中国	134	12,408.40	0.00
61	Zhejiang Taotao Vehicles Co., Ltd.	浙江涛涛车业股份有限公司	301345 CH	深圳证券交易所	中国	266	12,406.24	0.00
62	Shanghai Wisdom Information	上海威士顿信息技术股份有限公司	301315 CH	深圳证券交易所	中国	226	11,553.12	0.00

	Technology Co.,Ltd							
63	Hunan Aerospace Huanyu Communication Technology Co.,Ltd.	湖南航天环宇通信科技股份有限公司	688523 CH	上海证券交易所	中国	472	11,257.20	0.00
64	Zhongzhong Science & Technology (Tianjin) Co., Ltd.	中重科技(天津)股份有限公司	603135 CH	上海证券交易所	中国	628	11,234.92	0.00
65	Zhejiang Zhongke Magnetic Industry Co., Ltd.	浙江中科磁业股份有限公司	301141 CH	深圳证券交易所	中国	262	11,184.78	0.00
66	Jiangxi Salt Industry Group Co., Ltd	江西省盐业集团股份有限公司	601065 CH	上海证券交易所	中国	875	10,360.00	0.00
67	Yonyou Auto Information Technology (Shanghai) Co., Ltd.	用友汽车信息科技(上海)股份有限公司	688479 CH	上海证券交易所	中国	332	9,790.68	0.00
68	Finework (Hu Nan) New Energy Technology Co.,Ltd	湖南飞沃新能源科技股份有限公司	301232 CH	深圳证券交易所	中国	165	9,639.30	0.00
69	Ziel Home Furnishing Technology Co.,	致欧家居科技股份有限公司	301376 CH	深圳证券交易所	中国	420	9,454.20	0.00

	Ltd.							
70	Fujian Nanwang Environment Protection Scien-Tech Co.,Ltd.	福建南王环保科技有限公司	301355 CH	深圳证券交易所	中国	563	9,430.25	0.00
71	Suzhou Future Electrical Company Co.,Ltd.	苏州未来电器股份有限公司	301386 CH	深圳证券交易所	中国	378	8,992.62	0.00
72	Guangzhou Newlife New Material Co., Ltd	广州新莱福新材料股份有限公司	301323 CH	深圳证券交易所	中国	228	8,974.08	0.00
73	Changzhou Shichuang Energy Co.,Ltd.	常州时创能源股份有限公司	688429 CH	上海证券交易所	中国	346	8,833.38	0.00
74	Guangzhou Lingwei Technology Co., Ltd.	广州凌玮科技股份有限公司	301373 CH	深圳证券交易所	中国	277	8,822.45	0.00
75	Wuxi Xinan Technology Co.,Ltd.	无锡锡南科技股份有限公司	301170 CH	深圳证券交易所	中国	250	8,732.50	0.00
76	Shandong Keyuan Pharmaceutical Co.,Ltd.	山东科源制药股份有限公司	301281 CH	深圳证券交易所	中国	338	8,483.80	0.00
77	Jiangsu HHCK Advanced Materials Co.,Ltd.	江苏华海诚科新材料股份有限公司	688535 CH	上海证券交易所	中国	161	8,248.03	0.00
78	Both Engineering	柏诚系统科技股份有限公司	601133 CH	上海证券交易所	中国	664	8,140.64	0.00

	Technology Co.,Ltd.							
79	Hangzhou Huasu Technology Co.,Ltd.	杭州华塑科技股份有限公司	301157 CH	深圳证券交易所	中国	150	7,939.50	0.00
80	Yingde Greatchem Chemicals Co.,Ltd.	广东广康生化科技股份有限公司	300804 CH	深圳证券交易所	中国	226	7,451.22	0.00
81	Yarward Electronics (Shandong) Co., Ltd.	山东亚华电子股份有限公司	301337 CH	深圳证券交易所	中国	232	7,045.84	0.00
82	Shijihengtong Technology Co., Ltd.	世纪恒通科技股份有限公司	301428 CH	深圳证券交易所	中国	229	7,007.40	0.00
83	Jiangsu Evergreen Material Technology Incorporated Company	江苏常青树新材料科技股份有限公司	603125 CH	上海证券交易所	中国	160	3,924.80	0.00
84	Dencare (Chongqing) Oral Care Co.,Ltd.	重庆登康口腔护理用品股份有限公司	001328 CH	深圳证券交易所	中国	145	3,696.05	0.00
85	Wuhu Sanlian Forging Co., Ltd.	芜湖三联锻造股份有限公司	001282 CH	深圳证券交易所	中国	105	3,468.15	0.00
86	Nanchang Mineral Systems Co.,Ltd.	南昌矿机集团股份有限公司	001360 CH	深圳证券交易所	中国	177	2,631.99	0.00
87	Jiangsu Hengshan	江苏恒尚节能科技	603137 CH	上海证券交易所	中国	139	2,375.51	0.00

	g Energy Conservation Technology Co.,Ltd.	股份有限公司		所				
88	Changzhou Evergreen Technology Co., Ltd	常州长青科技股份有限公司	001324 CH	深圳证券交易所	中国	114	2,234.40	0.00
89	Zhejiang Haisen Pharmaceutical Co., Ltd.	浙江海森药业股份有限公司	001367 CH	深圳证券交易所	中国	55	2,171.40	0.00
90	Zhejiang Wanfeng Chemical Co.,Ltd.	浙江万丰化工股份有限公司	603172 CH	上海证券交易所	中国	122	1,967.86	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	573,074,390.42	3.03
2	JD.com, Inc.	9618 HK	356,717,532.37	1.88
3	Meituan	3690 HK	206,180,319.32	1.09
4	Kweichow Moutai Co.,Ltd.	600519 CH	114,209,657.00	0.60
5	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	114,097,030.29	0.60
6	Giant Biogene Holding Co ltd	2367 HK	58,509,070.98	0.31
7	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	002304 CH	36,309,173.00	0.19
8	CNOOC Limited	883 HK	21,625,591.08	0.11
9	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co.,Ltd.	600809 CH	7,456,737.40	0.04
10	Yum China Holdings, Inc.	9987 HK	3,805,721.28	0.02
11	Chongqing Genrix	688443 CH	1,148,862.52	0.01

	Biopharmaceutical Co., Ltd.			
12	Semiconductor Manufacturing Electronics (Shaoxing) Corporation	688469 CH	785,185.86	0.00
13	CSI Solar Co., Ltd.	688472 CH	694,882.20	0.00
14	Wuxi Unicomp Technology Co., Ltd.	688531 CH	527,234.80	0.00
15	Hunan Yuneng New Energy Battery Material Co.,Ltd.	301358 CH	480,772.02	0.00
16	Guangdong Mingyang Electric Co.,Ltd.	301291 CH	459,619.02	0.00
17	Motorcomm Electronic Technology Co., Ltd.	688515 CH	384,836.00	0.00
18	Shanghai Suochen Information Technology Co.,Ltd.	688507 CH	367,112.20	0.00
19	Peric Special Gases Co., Ltd.	688146 CH	365,151.15	0.00
20	Shaanxi Energy Investment Co., Ltd.	001286 CH	361,603.20	0.00

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	461,097,226.25	2.44
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	269,505,022.56	1.42
3	Wuliangye Yibin Co.,Ltd	000858 CH	191,041,524.00	1.01
4	Meituan	3690 HK	118,411,137.20	0.63
5	Kweichow Moutai Co.,Ltd.	600519 CH	110,045,318.10	0.58
6	Yum China Holdings, Inc.	9987 HK	99,147,373.85	0.52
7	Aier Eye Hospital Group Co.,Ltd	300015 CH	79,608,570.13	0.42
8	Xi'An International Medical Investment Company Ltd	000516 CH	76,640,935.63	0.40
9	Li Ning Co. Ltd.	2331 HK	43,439,272.34	0.23
10	Yonghe Medical Group Co., Ltd.	2279 HK	30,400,036.16	0.16
11	Luzhou Laojiao Co.,Ltd	000568 CH	28,063,546.00	0.15
12	Shanghai United Imaging Healthcare Co., Ltd.	688271 CH	1,240,224.47	0.01
13	Hunan Yuneng New Energy Battery Material Co.,Ltd.	301358 CH	964,477.95	0.01
14	Chongqing Genrix Biopharmaceutical Co., Ltd.	688443 CH	951,784.42	0.01

15	Motorcomm Electronic Technology Co., Ltd.	688515 CH	921,491.86	0.00
16	Semiconductor Manufacturing Electronics (Shaoxing) Corporation	688469 CH	788,232.05	0.00
17	CSI Solar Co., Ltd.	688472 CH	768,609.42	0.00
18	Wuxi Unicomp Technology Co., Ltd.	688531 CH	659,794.32	0.00
19	Skyverse Technology Co., Ltd.	688361 CH	531,469.91	0.00
20	Shaanxi Energy Investment Co., Ltd.	001286 CH	483,535.00	0.00

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,505,544,922.50
卖出收入（成交）总额	1,526,309,897.55

注：“买入成本”或“卖出收入”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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招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、中国人民银行的处罚。

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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	97,982.46
2	应收清算款	-
3	应收股利	24,690,017.57
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,703,193.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,491,193.14

7.11.4 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。

7.11.5 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。

§ 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

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

2,413,288	1,269.91	11,003,164.55	0.36%	3,053,647,713.47	99.64%
-----------	----------	---------------	-------	------------------	--------

8.2 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	4,504,044.46	0.1470%

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	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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 9 月 10 日）基金份额总额	3,043,094,297.36
本报告期期初基金份额总额	3,090,140,724.90
本报告期基金总申购份额	322,804,477.15
减：本报告期基金总赎回份额	348,294,324.03
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,064,650,878.02

§ 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	
华金证券	1	56,620,050.09	1.88%	45,296.05	2.34%	-

国泰君安	1	506,285,798.09	16.77%	405,028.96	20.91%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	137,750,449.81	4.56%	41,325.13	2.13%	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	12,010,258.01	0.40%	6,005.14	0.31%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	48,150,299.45	1.60%	24,075.16	1.24%	-
中信建投	2	29,718,247.98	0.98%	17,831.13	0.92%	-
长江证券	2	1,312,075,116.75	43.47%	787,245.07	40.65%	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	193,485,531.02	6.41%	53,245.82	2.75%	-
银河证券	1	9,340,797.84	0.31%	5,604.48	0.29%	-
Goldman Sachs	1	14,643,223.78	0.49%	7,321.62	0.38%	-
UBS Securities Asia Limited	1	33,699,369.81	1.12%	16,849.68	0.87%	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	1	16,125,774.32	0.53%	8,062.89	0.42%	-
安信证券	1	648,390,203.72	21.48%	518,712.15	26.78%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户，无新增交易账户。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下：

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanl	-	-	-	-	-	-	-	-

ey & Co. International PLC								
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong)	-	-	-	-	-	-	-	-

Limit ed								
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于易方达优质精选混合型证券投资基金 2023 年港股通及香港证券交易所非交易日暂停申购、赎回、转换、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	2023-01-10
2	关于旗下部分基金 2023 年 1 月 19 日至 2023 年 1 月 20 日因港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2023-01-16
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	上海证券报	2023-01-20
4	关于旗下部分基金在 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购、赎回、转换、定期定额投	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2023-03-03

	资业务的公告	电子披露网站	
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	上海证券报	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	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	2023-03-31
7	关于旗下部分基金 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 4 月 10 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	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	2023-04-03
8	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	上海证券报	2023-04-21
9	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	2023-04-22
10	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	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	2023-05-23
11	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	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	2023-06-15
12	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	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	2023-06-16

§ 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中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金的文件；
- 2.《易方达优质精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达优质精选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和营业执照。

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