

# 易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券 投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§ 2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	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、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	11
§ 4	管理人报告.....	12
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§ 5	托管人报告.....	19
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§ 6	审计报告.....	19
6.1	审计意见.....	19
6.2	形成审计意见的基础.....	20
6.3	其他信息.....	20
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任.....	20
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任.....	20
§ 7	年度财务报表.....	21
7.1	资产负债表.....	21
7.2	利润表.....	23
7.3	净资产（基金净值）变动表.....	25
7.4	报表附注.....	26
§ 8	投资组合报告.....	65
8.1	期末基金资产组合情况.....	65
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	66
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	67

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	70
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	71
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	72
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	72
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	73
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	73
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	73
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
8.12	投资组合报告附注 .....	73
§ 9	基金份额持有人信息 .....	75
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	75
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	76
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	76
§ 10	开放式基金份额变动 .....	77
§ 11	重大事件揭示 .....	77
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	77
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	77
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4	基金投资策略的改变 .....	78
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	78
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
11.8	其他重大事件 .....	79
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	81
§ 13	备查文件目录 .....	82
13.1	备查文件目录 .....	82
13.2	存放地点 .....	82
13.3	查阅方式 .....	82

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金	
基金简称	易方达裕惠定开混合发起式	
基金主代码	000436	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 8 月 18 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,543,332,142.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	000436	016344
报告期末下属分级基金的份额总额	2,542,851,722.15 份	480,419.98 份

注：自 2022 年 8 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 8 月 26 日。

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭期与开放期将采取不同的投资策略。1、封闭运作期内，本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。本基金将在严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将投资股票期权、股票指数期权、场外衍生工具等金融

	产品。2、开放运作期内，本基金为方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将增加高流动性投资品种的投资比例，以降低基金净值的波动。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三年期银行定期整存整取存款利率（税后）+1.75%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	龚小武
	联系电话	020-85102688	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95561
传真		020-38798812	021-62159217
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	福建省福州市台江区江滨中大道 398号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		510620	200120
法定代表人		刘晓艳	吕家进

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址

会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年	
	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
本期已实现收益	144,797,265.49	1,962.66	207,220,133.19	-	211,641,579.67	-
本期利润	19,793,641.58	-12,768.20	254,565,584.20	-	167,590,381.41	-
加权平均基金份额本期利润	0.0087	-0.0298	0.1535	-	0.0867	-
本期加权平均净值利润率	0.52%	-1.79%	8.97%	-	5.26%	-
本期基金份额净值增长率	0.52%	-1.67%	9.64%	-	5.44%	-
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
期末可供分配利润	1,662,094,043.06	312,925.11	1,302,490,731.38	-	1,098,441,623.56	-
期末可供分配基金份额	0.6536	0.6514	0.7277	-	0.6000	-

额利润						
期末基金资产净值	4,206,118,831.08	793,580.26	3,195,947,646.17	-	2,981,854,368.55	-
期末基金份额净值	1.654	1.652	1.786	-	1.629	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
基金份额累计净值增长率	119.80%	-1.67%	118.67%	-	99.45%	-

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。

4.自 2022 年 8 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 8 月 26 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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

##### 易方达裕惠定开混合发起式 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
过去三个月	-0.90%	0.22%	1.15%	0.02%	-2.05%	0.20%
过去六个月	-1.37%	0.17%	2.30%	0.01%	-3.67%	0.16%
过去一年	0.52%	0.20%	4.56%	0.01%	-4.04%	0.19%
过去三年	16.20%	0.17%	13.70%	0.01%	2.50%	0.16%
过去五年	36.42%	0.16%	22.83%	0.01%	13.59%	0.15%
自基金合同生效起至今	119.80%	0.20%	39.39%	0.01%	80.41%	0.19%

##### 易方达裕惠定开混合发起式 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----



	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	-1.02%	0.22%	1.15%	0.02%	-2.17%	0.20%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	-1.67%	0.19%	1.60%	0.02%	-3.27%	0.17%

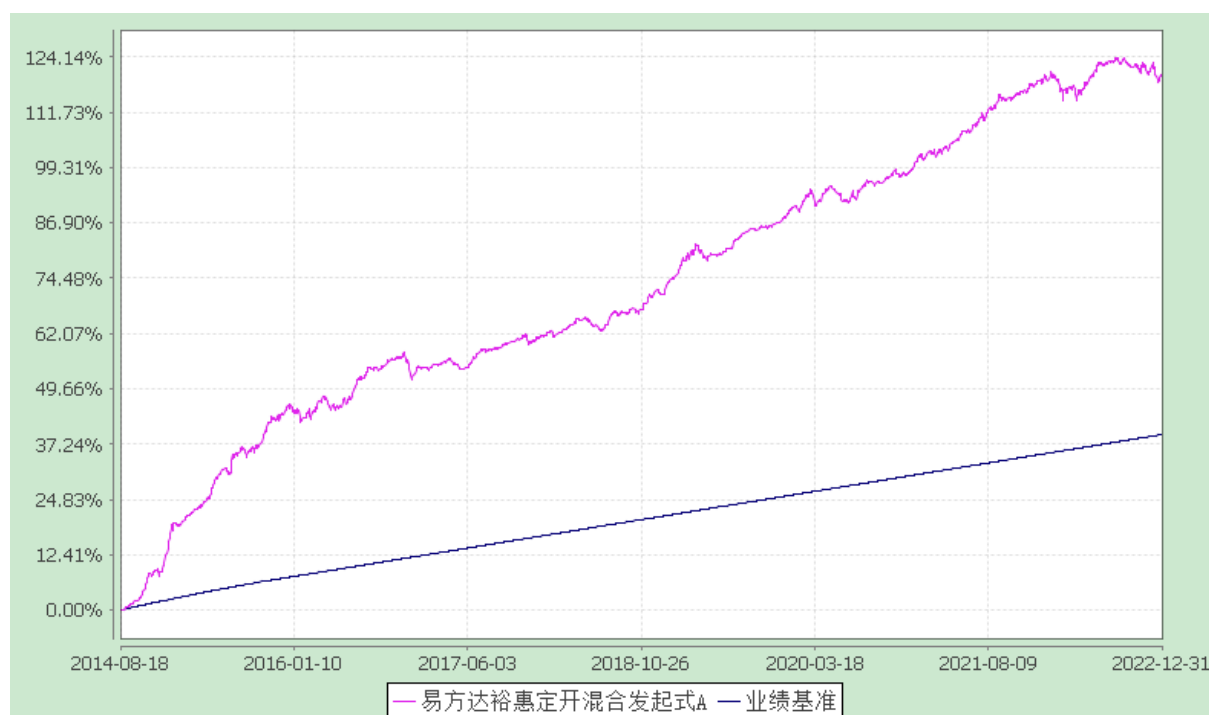
### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

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

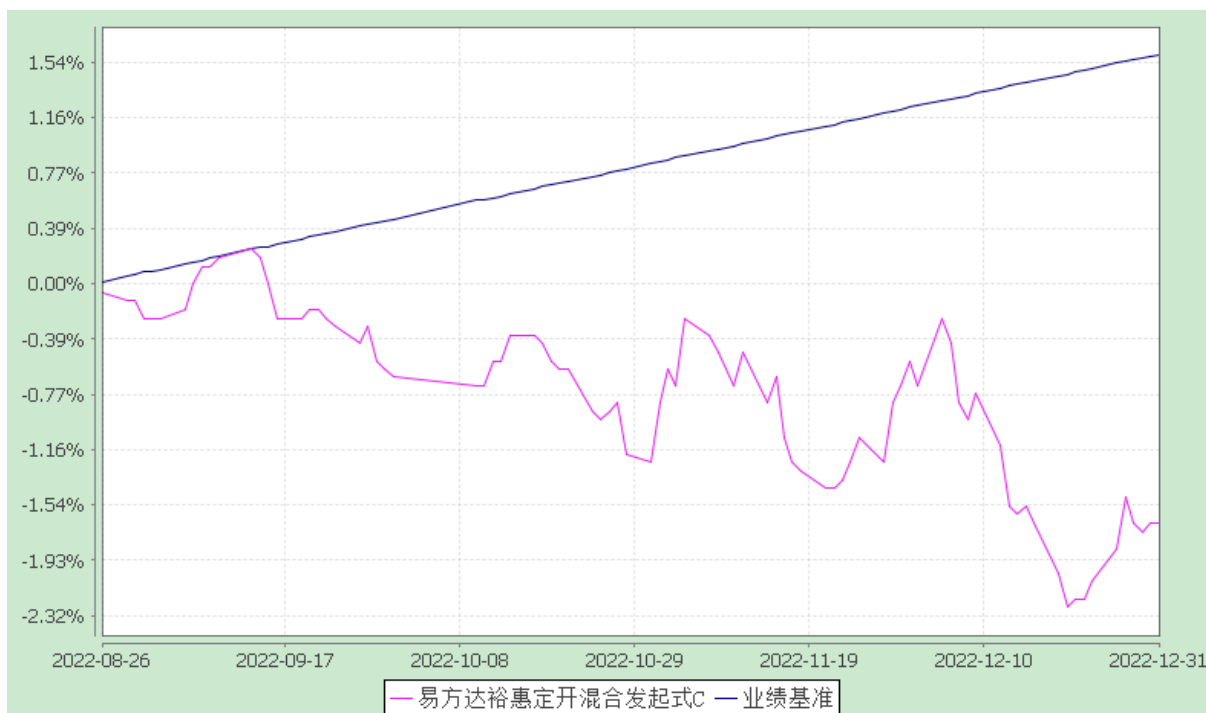
易方达裕惠定开混合发起式 A

(2014 年 8 月 18 日至 2022 年 12 月 31 日)



易方达裕惠定开混合发起式 C

(2022 年 8 月 26 日至 2022 年 12 月 31 日)



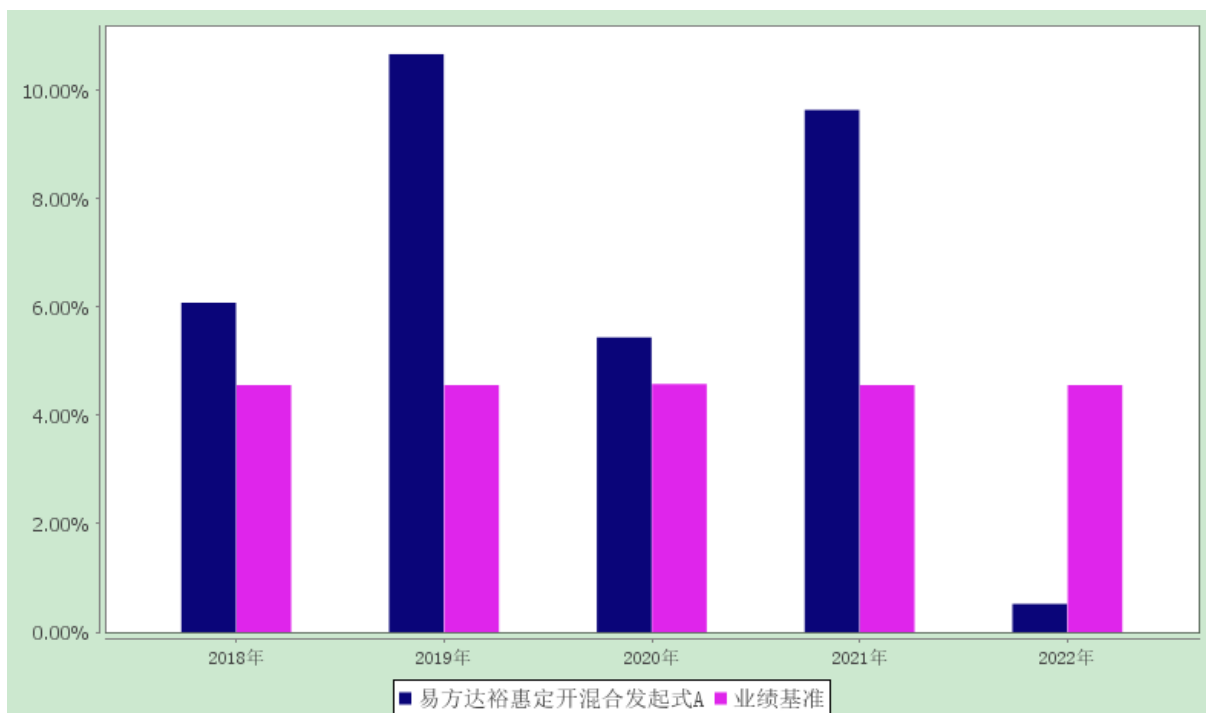
注：1.自 2022 年 8 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 8 月 26 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金转型至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 119.80%，同期业绩比较基准收益率为 39.39%；C 类基金份额净值增长率为-1.67%，同期业绩比较基准收益率为 1.60%。

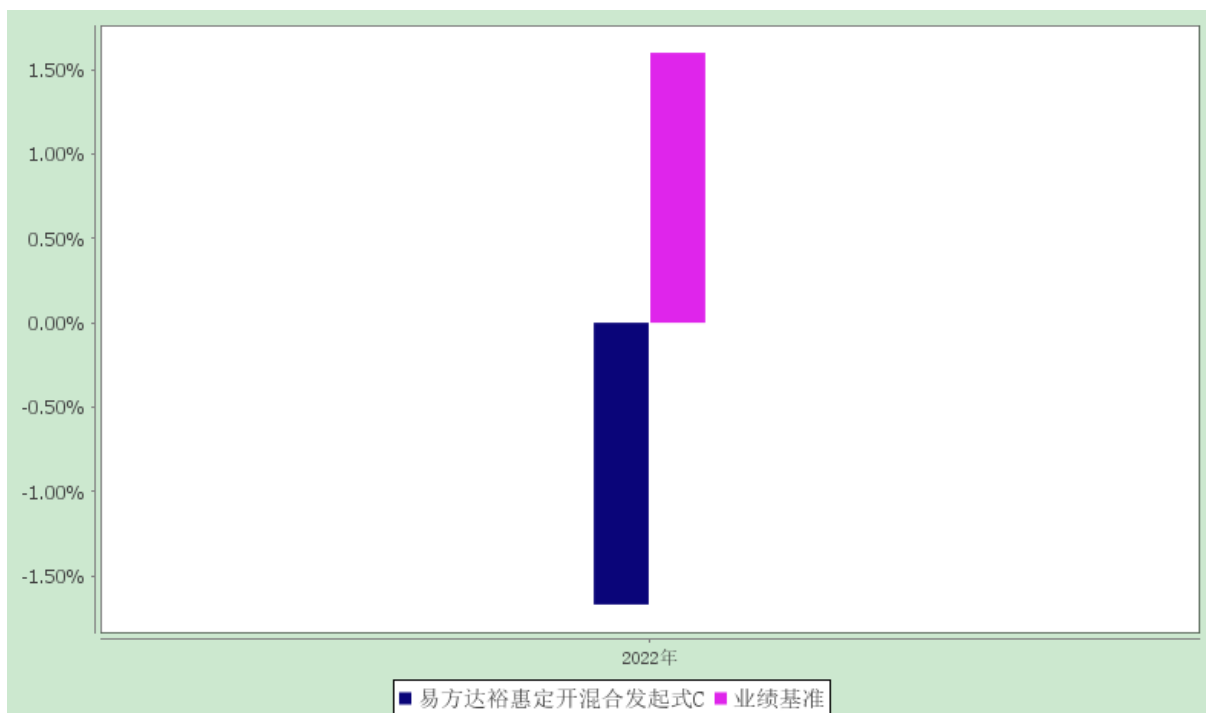
### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金  
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达裕惠定开混合发起式 A



易方达裕惠定开混合发起式 C



注：自 2022 年 8 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 8 月 26 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

易方达裕惠定开混合发起式 A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022年	1.410	242,419,190.77	10,137,554.46	252,556,745.23	-
2021年	-	-	-	-	-
2020年	0.670	121,544,993.91	1,068,987.20	122,613,981.11	-
合计	2.080	363,964,184.68	11,206,541.66	375,170,726.34	-

## § 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		
胡剑	本基金的基金经理，易方达稳健收益债券、易方达信用债债券、易方达岁丰添利债券（LOF）、易方达恒利3个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒盛3个月定开混合发起式、易方达富惠纯债债券（自2019年11月02日至2022年06月08日）、易方达中债3-5年期国债指数（自2020年03月10日至2022年05月16日）、易方达中债7-10年期国开行债券指数（自2020年03月10日至2022年06月17日）、易方达恒惠定开债券发起式（自2020年07月09日至2022年09月07日）、易方达恒信定开债券发起式、易方达高等级信	2014-08-18	-	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债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、固定收益投资业务总部总经理，易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达纯债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达纯债1年定期开放债券、易方达裕惠回报债券、易方达瑞财混合、易方达裕景添利6个月定期开放债券、易方达高等级信用债债券、易方达丰惠混合、易方达瑞富混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合、易方达3年封闭战略

	用债债券的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员、基础设施资产管理委员会委员				配售混合（LOF）、易方达科润混合（LOF）的基金经理。
李一硕	本基金的基金经理助理，易方达永旭定期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕如混合、易方达安源中短债债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒春纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒实纯债一年定开债券发起式、易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达富惠纯债债券、易方达恒安定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式的基金经理，易方达信用债债券、易方达稳健收益债券、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式、易方达富惠纯债债券（自 2019 年 11 月 22 日至 2022 年 06 月 08 日）、易方达恒惠定开债券发起式（自 2020 年 07 月 27 日至 2022 年 09 月 07 日）、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒安定开债券发起式（自 2021 年 01 月 15 日至 2022 年 09 月 07 日）、易方达恒信定开债券发起式、易方达稳丰 90 天滚动短债的基金经理助理，固定收益特定策略投资部总经理	2015-02-17	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任瑞银证券有限公司研究员，中国国际金融有限公司研究员，易方达基金管理有限公司固定收益研究员、固定收益投资部总经理助理、固定收益特定策略投资部负责人，易方达瑞景混合、易方达富惠纯债债券、易方达新利混合、易方达新享混合、易方达恒信定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式、易方达聚盈分级债券发起式、易方达恒益定开债券发起式的基金经理。
胡文伯	本基金的基金经理助理，易方达双债增强债券的基金经理，易方达高等级信用债债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 05 月 19 日）、易方达稳健收益债券、易方达增强回报债券、易方达永旭定期开放债券、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达信用债债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕如混合、易方达裕祥回报债券、易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达恒益定开债券发	2018-07-31	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员。

起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达安源中短债债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式、易方达富惠纯债债券的基金经理助理				
--	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.自2023年1月1日起，胡文伯不再担任本基金的基金经理助理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

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

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用

公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 42 次，其中 27 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，15 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

若干年后我们回首往事，2022 年注定是难以忘怀的一年。年初冬奥会刚刚结束就爆发了引致全球动荡的俄乌战争。此后国内疫情又生变化，几乎全年经济都饱受疫情困扰。与此同时美联储进入快速加息通道，而七月份中国房地产断贷现象导致房地产销售大幅下挫。临近年末，随着疫情政策的调整，市场收益率上行又引发了银行理财赎回和债市动荡。可以说 2022 年对于投资而言是黑天鹅不断的一年。

经济基本面受疫情和地产行业影响，震荡走低，全年较为疲软。社会消费品零售总额二季度以后持续低迷，房地产市场也在二季度后大幅下挫。为对冲经济下行，财政和开发性金融积极发力，全年制造业投资和基建投资表现出较好的韧性，对经济形成一定的支撑。出口则受到海外经济走势

的影响，前高后低。下半年地产政策和疫情政策调整，经济增长预期有较大幅度改善，但是实际经济基本面由于感染人数大幅攀升，再度出现下行，直到 12 月份才有所好转。

2022 年在积极应对经济下行压力的同时，宏观经济政策总体保持定力。货币政策保持了短端资金面的平稳宽裕。银行信贷利率成本下降，积极有效地降低了实体企业的融资成本。财政方面，专项债、开发性金融积极发力，在管控住地方政府债务风险的同时有效对冲了经济的底部下行风险。但是三年疫情的影响，叠加 2022 年土地销售收入下降，使得地方政府财政压力陡增。

市场方面，2022 年债券收益率先下后上，总体偏熊。截至年底，10 年国债收益率上行 6BP，3 年国开债收益率下行 3BP，3 年 AAA 信用债收益率上行 26BP，4 年二级资本债收益率上行 38BP。权益市场震荡下跌，沪深 300 指数全年下跌 21.63%，创业板指数下跌 29.37%。行业方面，仅煤炭和综合行业取得 10.95%和 10.57%的正收益，电子、建筑材料、传媒、计算机、电力设备、国防军工等下跌较多，普遍下跌 25%以上的水平。中证转债指数也出现 10.02%的下跌。

操作上，组合主要配置债券类资产，久期处于中性水平，以获取持有期收益为主要投资策略。权益方面，组合积极调整股票和可转债仓位，把握市场下跌机会建仓，并在回调后卖出，调仓节奏把握较好。11 月份防疫政策调整后，组合显著提升了股票和转债的比例，在后续市场的反弹行情中获取了较好的收益。

#### 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 1.654 元，本报告期份额净值增长率为 0.52%，同期业绩比较基准收益率为 4.56%；C 类基金份额净值为 1.652 元，本报告期份额净值增长率为-1.67%，同期业绩比较基准收益率为 1.60%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，中国经济进入后疫情时代，经济基本面企稳回升的方向是确定的。疫情防控政策放开后的消费恢复有望成为对今年经济走势影响最重要的因素，对经济基本面形成向上的推力。从海外经验看，消费反弹前三个月最为强劲，后续或跟随疫情反复有一定波动，但消费增长以及服务业的复苏带动整体经济向上的大趋势毋庸置疑。

然而中国疫后的经济复苏又不能照搬海外经验。其中一方面是供给侧情况反差较大，海外疫情结束后一般都面临供给不足并拉动商品价格上涨的压力，而中国则不一样，由于疫情期间三年来供应链并未受损，且制造业投资较为积极，较低的产能利用率以及多余的工业产成品库存使得市场供大于求的状态在疫后可能会持续一段时间。

另一方面疫情期间的中国经济，遭受了疫情带来的前所未有的影响，还经历了地产行业收缩和平台经济整改等一连串收缩性事件，但随着政策调整的不断完善，如果能成功逆转这些因素带来的



影响，则经济将会在未来疫情修复过程中迎来多重利好的共振。

需要重视的是，今年是二十大会议后的首年，二十大历史性地将实施扩大内需战略视作应对外部冲击、稳定经济运行的有效途径。这使得我们可以对支持经济增长的政策抱有更高的预期，使经济增速向上的弹性也更值得期待。

此外值得关注的是海外经济走弱带来的出口下滑是今年经济增长的主要拖累项，但是我们认为在当前海外经济体资产负债结构尚属相对健康的情况下，出现大幅衰退的风险较小。

对于债券市场而言，在经济基本面大概率回升的背景下，收益率出现向上波动的风险相比震荡或向下的可能性相对更大，而市值化理财首次面临经济周期的拐点，其负债端依然面临净值波动带来的负面影响。这使得债券收益率，尤其是中短端信用债券收益率，面临出现更大波动的风险。

权益方面，在经历了 2022 年持续性的下跌之后，股票市场整体估值偏低，存在较好的投资价值。从经济基本面角度看，2023 年经济增速向上带动企业盈利回升的可能性较大，在此环境下叠加风险偏好修复可能给股票市场带来较好的投资机会。可转债方面跟随股票市场的走好，也存在一定的投资机会。

虽然我们认为经济已处于上升趋势之中，但复苏之路不会一帆风顺。实际投资中，2023 年本基金将继续坚持稳健的投资风格，积极调整资产配置，把握市场的投资机会，也密切关注各项风险。权益方面，组合将继续深耕个股，精选主体，积极挖掘有安全边际且有增长潜力的品种长期持有。债券方面，组合会积极管理久期波动风险和市场流动性风险，寻找合适时点进行债券配置，综合提升组合的中长期收益水平。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

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

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

规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

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

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融

估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达裕惠定开混合发起式 A:本报告期内实施的利润分配金额为 252,556,745.23 元。

易方达裕惠定开混合发起式 C: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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

安永华明（2023）审字第 60468000\_G06 号

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 6.1 审计意见

我们审计了易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

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

## 6.3 其他信息

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

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

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

执行以下工作：

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

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

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

昌华 马婧

北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

2023年3月27日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,493,237.02	1,337,199.39
结算备付金		56,290,848.44	55,376,661.51
存出保证金		233,945.08	51,844.94
交易性金融资产	7.4.7.2	6,365,753,754.86	4,516,182,045.66
其中：股票投资		651,151,106.81	368,636,993.20
基金投资		-	-
债券投资		5,204,703,227.04	3,894,122,552.46
资产支持证券投资		509,899,421.01	253,422,500.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	7,944,973.48
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	66,404,291.56
<b>资产总计</b>		<b>6,423,771,785.40</b>	<b>4,647,297,016.54</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,213,897,017.08	1,447,450,852.42
应付清算款		302,963.83	1,346,554.79
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,433,432.24	1,080,653.73

应付托管费		358,358.05	270,163.41
应付销售服务费		270.44	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		402,389.37	342,964.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	464,943.05	858,181.05
<b>负债合计</b>		<b>2,216,859,374.06</b>	<b>1,451,349,370.37</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	2,543,332,142.13	1,789,783,380.60
未分配利润	7.4.7.8	1,663,580,269.21	1,406,164,265.57
<b>净资产合计</b>		<b>4,206,912,411.34</b>	<b>3,195,947,646.17</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>6,423,771,785.40</b>	<b>4,647,297,016.54</b>

注：1.报告截止日 2022 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.654 元，C 类基金份额净值 1.652 元；基金份额总额 2,543,332,142.13 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 2,542,851,722.15 份，C 类基金份额总额 480,419.98 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>70,627,505.92</b>	<b>300,019,745.22</b>
1.利息收入		1,194,426.21	152,748,997.74

其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,111,282.59	952,345.26
债券利息收入		-	146,545,185.25
资产支持证券利息收入		-	5,187,298.35
买入返售金融资产收入		83,143.62	64,168.88
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		193,231,637.93	99,868,424.45
其中：股票投资收益	7.4.7.10	33,557,350.91	73,739,821.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	139,019,273.60	20,450,105.59
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	10,417,724.91	101,202.64
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	10,237,288.51	5,577,294.59
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-125,018,354.77	47,345,451.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,219,796.55	56,872.02
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>50,846,632.54</b>	<b>45,454,161.02</b>
1. 管理人报酬		15,132,760.81	11,369,520.98
2. 托管费		3,783,190.12	2,842,380.27
3. 销售服务费		998.64	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		31,106,151.18	29,953,126.58
其中：卖出回购金融资产支出		31,106,151.18	29,953,126.58
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		515,695.85	486,967.03
8. 其他费用	7.4.7.18	307,835.94	802,166.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>19,780,873.38</b>	<b>254,565,584.20</b>



减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>19,780,873.38</b>	<b>254,565,584.20</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>19,780,873.38</b>	<b>254,565,584.20</b>

注：1.上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年度利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

2.上表中以下本期数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：本年度报告利润表中“投资收益”项目对应品种的投资收益已扣减对应投资品种产生的交易费用。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,789,783,380.60	1,406,164,265.57	3,195,947,646.17
二、本期期初净资产（基金净值）	1,789,783,380.60	1,406,164,265.57	3,195,947,646.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	753,548,761.53	257,416,003.64	1,010,964,765.17
（一）、综合收益总额	-	19,780,873.38	19,780,873.38
（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）	753,548,761.53	490,191,875.49	1,243,740,637.02
其中：1.基金申购款	2,505,914,500.71	1,651,985,296.79	4,157,899,797.50
2.基金赎回款	-1,752,365,739.18	-1,161,793,421.30	-2,914,159,160.48
（三）、本期向基	-	-252,556,745.23	-252,556,745.23

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）	2,543,332,142.13	1,663,580,269.21	4,206,912,411.34
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,830,720,107.03	1,151,134,261.52	2,981,854,368.55
二、本期期初净资产（基金净值）	1,830,720,107.03	1,151,134,261.52	2,981,854,368.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-40,936,726.43	255,030,004.05	214,093,277.62
（一）、综合收益总额	-	254,565,584.20	254,565,584.20
（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）	-40,936,726.43	464,419.85	-40,472,306.58
其中：1.基金申购款	487,743,810.32	364,972,745.24	852,716,555.56
2.基金赎回款	-528,680,536.75	-364,508,325.39	-893,188,862.14
（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）	1,789,783,380.60	1,406,164,265.57	3,195,947,646.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铨

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金由易方达裕惠回报债券型证券投资基金转换运作方式、变更基金类别及修改其他相关事项而来。《关于易方达裕惠回报债券型证券投资基金

转换运作方式、变更基金类别及修改其他相关事项的议案》经 2014 年 8 月 18 日易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过。自 2014 年 8 月 18 日起，由《易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金合同》生效。易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。原易方达裕惠回报债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1375 号《关于核准易方达裕惠回报债券型证券投资基金募集的批复》注册，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,000,083,493.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 40,006.81 份基金份额。根据《易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金合同》的约定，原易方达裕惠回报债券型证券投资基金为契约型开放式基金，存续期限不定。原易方达裕惠回报债券型证券投资基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。自 2022 年 8 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 8 月 26 日。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

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

##### （2）金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

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

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

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

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

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

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

或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

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

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线

法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

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

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

(4)本基金各基金份额类别在费用收取上不同,其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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

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

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

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



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

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

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,337,199.39 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 514.41 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,337,713.80 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 55,376,661.51 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 24,919.50 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 55,401,581.01 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 51,844.94 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 23.30 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 51,868.24 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 66,404,291.56 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 514.41 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 24,919.50 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 23.30 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 66,378,834.35 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,516,182,045.66 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 66,378,834.35 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,582,560,880.01 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

1,447,450,852.42 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 579,812.33 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,448,030,664.75 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 579,812.33 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 579,812.33 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等

增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,493,237.02	1,337,199.39
等于：本金	1,493,072.45	1,337,199.39
加：应计利息	164.57	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	1,493,237.02	1,337,199.39

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	647,971,081.07	-	651,151,106.81	3,180,025.74	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市 场	1,621,754,044.4 1	17,757,469.49	1,625,998,595.12	-13,512,918.78
	银行间市 场	3,544,635,777.9 5	55,484,031.92	3,578,704,631.92	-21,415,177.95
	合计	5,166,389,822.3 6	73,241,501.41	5,204,703,227.04	-34,928,096.73
资产支持证券	510,656,502.75	3,813,421.01	509,899,421.01	-4,570,502.75	

基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,325,017,406.18	77,054,922.42	6,365,753,754.86	-36,318,573.74
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		309,999,782.40	-	368,636,993.20	58,637,210.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,013,297,165.07	-	1,028,196,152.46	14,898,987.39
	银行间市场	2,852,261,022.85	-	2,865,926,400.00	13,665,377.15
	合计	3,865,558,187.92	-	3,894,122,552.46	28,564,364.54
资产支持证券		251,924,294.31	-	253,422,500.00	1,498,205.69
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,427,482,264.63	-	4,516,182,045.66	88,699,781.03

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	66,404,291.56
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	66,404,291.56

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	360,443.05	63,368.72
其中：交易所市场	288,705.74	15,429.28
银行间市场	71,737.31	47,939.44
应付利息	-	579,812.33
预提费用	104,500.00	215,000.00
合计	464,943.05	858,181.05

#### 7.4.7.7 实收基金

易方达裕惠定开混合发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,789,783,380.60	1,789,783,380.60
本期申购	2,505,420,845.03	2,505,420,845.03
本期赎回（以“-”号填列）	-1,752,352,503.48	-1,752,352,503.48
本期末	2,542,851,722.15	2,542,851,722.15

易方达裕惠定开混合发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	493,655.68	493,655.68
本期赎回（以“-”号填列）	-13,235.70	-13,235.70
本期末	480,419.98	480,419.98

注：1.自 2022 年 8 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 8 月 26 日。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

易方达裕惠定开混合发起式 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	1,302,490,731.38	103,673,534.19	1,406,164,265.57
本期利润	144,797,265.49	-125,003,623.91	19,793,641.58
本期基金份额交易产生的变动数	467,362,791.42	22,503,155.59	489,865,947.01
其中：基金申购款	1,572,970,811.75	78,679,610.72	1,651,650,422.47
基金赎回款	-1,105,608,020.33	-56,176,455.13	-1,161,784,475.46
本期已分配利润	-252,556,745.23	-	-252,556,745.23
本期末	1,662,094,043.06	1,173,065.87	1,663,267,108.93

易方达裕惠定开混合发起式 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	-	-	-
本期利润	1,962.66	-14,730.86	-12,768.20
本期基金份额交易产生的变动数	310,962.45	14,966.03	325,928.48
其中：基金申购款	319,567.65	15,306.67	334,874.32
基金赎回款	-8,605.20	-340.64	-8,945.84

本期已分配利润	-	-	-
本期末	312,925.11	235.17	313,160.28

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	50,818.57	35,659.61
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	1,058,383.65	915,583.33
其他	2,080.37	1,102.32
合计	1,111,282.59	952,345.26

## 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	33,557,350.91	73,739,821.63
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	33,557,350.91	73,739,821.63

## 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	476,168,351.19	159,108,689.28
减：卖出股票成本总额	441,174,138.64	85,368,867.65
减：交易费用	1,436,861.64	-
买卖股票差价收入	33,557,350.91	73,739,821.63

## 7.4.7.11 债券投资收益



## 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	157,683,630.57	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-18,664,356.97	20,450,105.59
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	139,019,273.60	20,450,105.59

## 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,060,083,412.45	5,931,655,952.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,993,013,096.84	5,780,749,721.04
减：应计利息总额	85,630,245.11	130,456,126.14
减：交易费用	104,427.47	-
买卖债券差价收入	-18,664,356.97	20,450,105.59

## 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	10,122,882.23	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	294,842.68	101,202.64
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——	-	-

—申购差价收入		
合计	10,417,724.91	101,202.64

## 7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	236,556,057.72	84,398,119.52
减：卖出资产支持证券成本总额	232,034,108.55	83,103,049.70
减：应计利息总额	4,225,985.12	1,193,867.18
减：交易费用	1,121.37	-
资产支持证券投资收益	294,842.68	101,202.64

## 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

## 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	10,237,288.51	5,577,294.59
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	10,237,288.51	5,577,294.59

## 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-125,018,354.77	47,345,451.01
——股票投资	-55,457,185.06	10,751,952.35
——债券投资	-63,492,461.27	35,235,792.97
——资产支持证券投资	-6,068,708.44	1,357,705.69

——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	-125,018,354.77	47,345,451.01

## 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	1,219,603.44	56,774.80
其他	193.11	97.22
合计	1,219,796.55	56,872.02

## 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

## 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	104,500.00	95,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	34,800.00	32,050.00
银行汇划费	47,335.94	34,579.55
其他	1,200.00	3,458.33
交易费用	-	517,078.28
合计	307,835.94	802,166.16

## 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2资产负债表日后事项

易方达裕惠定开混合发起式 A：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2023 年 2 月 14 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.670 元。

易方达裕惠定开混合发起式 C：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2023 年 2 月 14 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.660 元。

#### 7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	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
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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

2. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

**7.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

**7.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,132,760.81	11,369,520.98
其中：支付销售机构的客户维护费	1,649,288.37	126,099.36

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	3,783,190.12	2,842,380.27
----------------	--------------	--------------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 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 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式C	合计
易方达基金管理有限公司	-	63.67	63.67
合计	-	63.67	63.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式C	合计
合计	-	-	-

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 0.40%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

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，由基金管理人向基金托管人发送划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达裕惠定开混合发起式 A

无。

易方达裕惠定开混合发起式 C

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行-活期存款	1,493,237.02	50,818.57	1,337,199.39	35,659.61

注：本基金的上述银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2022年1月1日至2022年12月31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	标榜股份	新股网下发行	2,564	103,201.00
广发证券股份有限公司	301220	亚香股份	新股网下发行	2,849	102,507.02
广发证券股份有限公司	603057	紫燕食品	新股网下发行	549	8,317.35
广发证券股份有限公司	603255	鼎际得	新股网下发行	488	10,677.44
广发证券股份有限公司	688496	清越科技	新股网下发行	12,000	109,920.00
上年度可比期间					
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	301038	深水规院	新股网下发行	2,660	17,768.80
广发证券股份有限公司	605033	美邦股份	新股网下发行	423	5,367.87
广发证券股份有限公司	605090	九丰能源	新股网下发行	1,090	37,681.30

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

易方达裕惠定开混合发起式 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022-01-10	-	2022-01-10	0.730	125,673,066.85	4,981,134.47	130,654,201.32	-
2	2022-02-09	-	2022-	0.680	116,746,123.92	5,156,419.99	121,902,543.91	-



			02-09						
合计				1.410	242,419,190.77	10,137,554.46	252,556,745.23	-	

注：根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2023 年 2 月 14 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.670 元。

易方达裕惠定开混合发起式 C

本报告期内未发生利润分配。根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2023 年 2 月 14 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.660 元。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：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
301132	满坤科技	2022-08-03	6 个月	新股流通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6 个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6 个月	新股流通受限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301171	易点天下	2022-08-10	6 个月	新股流通受限	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科环保	2022-06-30	6 个月	新股流通受限	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6 个月	新股流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301197	工大科雅	2022-07-29	6 个月	新股流通受限	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6 个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-

301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	新股 流通 受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6 个月	新股 流通 受限	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022-12-08	6 个月	新股 流通 受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6 个月	新股 流通 受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月	新股 流通 受限	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6 个月	新股 流通 受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新股 流通 受限	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301277	新天地	2022-11-09	6 个月	新股 流通 受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6 个月	新股 流通 受限	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6 个月	新股 流通 受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301285	鸿日达	2022-09-21	6 个月	新股 流通 受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022-11-23	6 个月	新股 流通 受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6 个月	新股 流通 受限	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301297	富乐德	2022-12-23	6 个月	新股 流通 受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301300	远翔新材	2022-08-09	6 个月	新股 流通	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-

				受限						
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股 流通 受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新股 流通 受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301311	昆船智能	2022-11-23	6 个月	新股 流通 受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新股 流通 受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6 个月	新股 流通 受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6 个月	新股 流通 受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6 个月	新股 流通 受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6 个月	新股 流通 受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6 个月	新股 流通 受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301339	通行宝	2022-09-02	6 个月	新股 流通 受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月	新股 流通 受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301359	东南电子	2022-11-02	6 个月	新股 流通 受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301361	众智科技	2022-11-08	6 个月	新股 流通 受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301363	美好医疗	2022-09-28	6 个月	新股 流通 受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301367	怡和	2022-10-21	6 个月	新股	119.88	175.7	223	26,733.24	39,198.94	-

	嘉业			流通受限		8				
301368	丰立智能	2022-12-07	6 个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6 个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6 个月	新股流通受限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6 个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
688247	宣泰医药	2022-08-18	6 个月	新股流通受限	9.37	15.06	7,155	67,042.35	107,754.30	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：资产支持证券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
112424	星惠5A	2022-11-24	1-6 个月（含）	新发流通受限	100.00	100.26	100,000	10,000,000.00	10,025,869.59	-
112440	G 鄱阳1A2	2022-12-12	1-6 个月（含）	新发流通受限	100.00	100.18	100,000	10,000,000.00	10,017,534.25	-
112450	22 沪杭优	2022-11-24	1-6 个月（含）	新发流通受限	100.00	100.29	100,000	10,000,000.00	10,029,032.33	-

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。

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300850	新强联	2022-12-30	重大事项停牌	53.28	2023-01-10	56.88	61,710	4,918,640.63	3,287,908.80	-

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,533,809,419.64 元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量(张)	期末估值总额
092280105	22 南京银行 永续债 01	2023-01-03	95.33	800,000	76,265,674.52
101801234	18 新盛建设 MTN004	2023-01-03	102.41	100,000	10,240,869.59
101801549	18 吉林高速 MTN004	2023-01-03	100.92	100,000	10,091,978.08
101900356	19 泰州城建 MTN001	2023-01-03	105.27	200,000	21,053,671.23
101901099	19 陕煤化 MTN003	2023-01-03	102.23	500,000	51,112,991.78
101901600	19 陕煤化 MTN006	2023-01-03	101.43	307,000	31,139,526.44
102000744	20 津能源 MTN002	2023-01-03	99.42	21,000	2,087,915.74
102000886	20 蓝星 MTN003	2023-01-03	101.95	100,000	10,195,437.81
102001018	20 吉林高速 MTN003	2023-01-03	101.29	200,000	20,258,273.97
102001406	20 普洛斯 MTN001	2023-01-03	100.02	300,000	30,007,430.14
102001712	20 建发地产 MTN004	2023-01-03	102.33	100,000	10,233,093.15
102001810	20 吉林高速 MTN005	2023-01-03	100.53	100,000	10,053,379.18
102002266	20 冀交投 MTN004	2023-01-03	101.56	200,000	20,312,361.64
102002269	20 金融街 MTN003	2023-01-03	100.92	300,000	30,276,429.04
102100073	21 锡交通 MTN001	2023-01-03	104.18	1,000,000	104,181,852.05
102100570	21 川高速 MTN004(权益 出资)	2023-01-03	103.57	400,000	41,426,299.18
102100669	21 新兴际华 MTN001	2023-01-03	103.88	300,000	31,164,491.51

102100702	21 杭州交投 MTN001	2023-01-03	104.14	100,000	10,413,547.95
102100821	21 晋焦煤 MTN001	2023-01-03	103.82	300,000	31,144,742.47
102100871	21 东南国资 MTN001	2023-01-03	102.92	200,000	20,583,364.38
102101073	21 淮南矿 MTN005(可持 续挂钩)	2023-01-03	102.59	200,000	20,518,967.67
102101526	21 中节能 MTN002	2023-01-03	101.29	200,000	20,258,876.71
102101527	21 首钢 MTN002A	2023-01-03	100.99	200,000	20,197,821.37
102101624	21 吴江城投 MTN002	2023-01-03	101.08	100,000	10,108,176.44
102101733	21 甘公投 MTN004	2023-01-03	98.38	100,000	9,838,266.30
102101984	21 威海城投 MTN003	2023-01-03	100.59	100,000	10,058,706.85
102102231	21 天津港 MTN003	2023-01-03	101.54	100,000	10,154,019.18
102103326	21 泰州城建 MTN003	2023-01-03	99.71	100,000	9,971,136.99
102180032	21 韵达股份 MTN003	2023-01-03	99.78	100,000	9,978,453.70
102200108	22 中交房产 MTN001	2023-01-03	101.19	300,000	30,357,619.73
102200193	22 粤珠江 MTN005	2023-01-03	98.25	200,000	19,650,712.33
102280640	22 吉利 MTN001	2023-01-03	101.00	500,000	50,498,986.30
102280679	22 鲁能源 MTN003A(可 持续挂钩)	2023-01-03	102.53	100,000	10,252,850.41
102280690	22 长春轨交 MTN001	2023-01-03	103.67	100,000	10,367,428.49
102280956	22 中建投资 MTN002	2023-01-03	101.26	100,000	10,125,637.81
102281070	22 京城建 MTN001	2023-01-03	100.82	100,000	10,082,316.16
102281494	22 冀建投 MTN002	2023-01-03	100.52	200,000	20,104,043.84
102281880	22 吉林高速 MTN002	2023-01-03	97.11	100,000	9,711,266.30

132280048	22 融和融资 GN002(碳中和债)	2023-01-03	100.69	100,000	10,068,915.07
220202	22 国开 02	2023-01-03	102.29	500,000	51,143,904.11
220203	22 国开 03	2023-01-03	101.87	37,000	3,769,113.97
220322	22 进出 22	2023-01-03	100.51	1,000,000	100,509,232.88
101801425	18 冀港集 MTN003	2023-01-05	101.59	300,000	30,476,582.47
101900343	19 供销 MTN001	2023-01-05	105.04	500,000	52,518,547.95
101900795	19 闽投 MTN003	2023-01-05	104.39	700,000	73,069,881.64
101901571	19 陕煤化 MTN005	2023-01-05	101.59	25,000	2,539,754.52
102000020	20 豫交投 MTN001	2023-01-05	104.77	100,000	10,477,466.85
102000628	20 京能洁能 MTN001	2023-01-05	102.65	100,000	10,265,342.47
102002038	20 湘高速 MTN006	2023-01-05	101.26	500,000	50,632,356.16
102100972	21 贵州高速 MTN003	2023-01-05	101.87	400,000	40,749,753.42
102100975	21 冀建投 MTN001	2023-01-05	102.97	200,000	20,593,972.60
102101506	21 中航租赁 MTN006	2023-01-05	101.29	200,000	20,258,618.08
102280066	22 闽投 MTN001	2023-01-05	102.77	300,000	30,832,402.19
102280454	22 国盛 MTN001	2023-01-05	102.41	400,000	40,962,702.47
102282569	22 南电 MTN007	2023-01-05	99.77	200,000	19,953,307.40
101801461	18 陕煤化 MTN006	2023-01-06	101.41	100,000	10,140,602.19
101900710	19 五矿 MTN001	2023-01-06	104.13	100,000	10,412,975.34
101901607	19 甘公投 MTN004	2023-01-06	97.46	400,000	38,984,569.86
102101535	21 甘公投 MTN003	2023-01-06	98.58	100,000	9,857,598.90
102280403	22 格力 MTN002	2023-01-06	102.20	100,000	10,220,265.75
102281646	22 中航租赁 MTN006	2023-01-06	100.03	100,000	10,002,886.58

132280020	22 湖南钢铁 GN001	2023-01-06	100.48	600,000	60,286,425.21
101801424	18 吴江城投 MTN002	2023-01-09	101.66	170,000	17,282,074.24
101901077	19 中铝集 MTN005	2023-01-09	102.49	200,000	20,498,414.25
102100194	21 中航租赁 MTN001	2023-01-09	104.79	200,000	20,958,808.77
102282588	22 中电投 MTN036	2023-01-09	99.67	297,000	29,602,769.53
102282703	22 中核 MTN002	2023-01-09	101.49	100,000	10,148,569.86
合计				16,557,000	1,681,696,431.16

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 680,087,597.44 元，于 2023 年 1 月 3 日、2023 年 1 月 4 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。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。



**7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 131.75%(2021 年 12 月 31 日：127.58%)。

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	81,102,803.83	10,249,641.10
合计	81,102,803.83	10,249,641.10

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
--------	--------------------	---------------------

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

## 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	3,370,224,505.64	2,857,278,989.44
AAA 以下	976,988,862.20	714,778,446.51
未评级	776,387,055.37	279,047,024.66
合计	5,123,600,423.21	3,851,104,460.61

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	489,951,214.98	238,857,237.43
AAA 以下	19,948,206.03	15,363,431.51
未评级	0.00	0.00
合计	509,899,421.01	254,220,668.94

## 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	98,349,116.16
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	98,349,116.16
----	------	---------------

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2022 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

## 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,493,237.02	-	-	-	1,493,237.02
结算备付金	56,290,848.44	-	-	-	56,290,848.44
存出保证金	233,945.08	-	-	-	233,945.08
交易性金融资产	1,314,531,413.51	3,491,711,097.67	908,360,136.87	651,151,106.81	6,365,753,754.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,372,549,444.05	3,491,711,097.67	908,360,136.87	651,151,106.81	6,423,771,785.40
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	2,213,897,017.08	-	-	-	2,213,897,017.08
应付清算款	-	-	-	302,963.83	302,963.83
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,433,432.24	1,433,432.24
应付托管费	-	-	-	358,358.05	358,358.05
应付销售服务费	-	-	-	270.44	270.44
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	402,389.37	402,389.37
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	464,943.05	464,943.05
负债总计	2,213,897,017.08	-	-	2,962,356.98	2,216,859,374.06
利率敏感度缺口	-841,347,573.03	3,491,711,097.67	908,360,136.87	648,188,749.83	4,206,912,411.34
<b>上年度末</b>					
<b>2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	1,337,199.39	-	-	-	1,337,199.39
结算备付金	55,376,661.51	-	-	-	55,376,661.51
存出保证金	51,844.94	-	-	-	51,844.94
交易性金融资产	673,557,585.70	3,006,940,287.30	467,047,179.46	368,636,993.20	4,516,182,045.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	7,944,973.48	7,944,973.48
应收利息	-	-	-	66,404,291.56	66,404,291.56
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	730,323,291.54	3,006,940,287.30	467,047,179.46	442,986,258.24	4,647,297,016.54
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	1,447,450,852.42	-	-	-	1,447,450,852.42
应付证券清算款	-	-	-	1,346,554.79	1,346,554.79
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,080,653.73	1,080,653.73
应付托管费	-	-	-	270,163.41	270,163.41

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	63,368.72	63,368.72
应交税费	-	-	-	342,964.97	342,964.97
应付利息	-	-	-	579,812.33	579,812.33
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	215,000.00	215,000.00
负债总计	1,447,450,852.42	-	-	3,898,517.95	1,451,349,370.37
利率敏感度缺口	-717,127,560.88	3,006,940,287.30	467,047,179.46	439,087,740.29	3,195,947,646.17

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	18,460,316.39	19,216,063.94
2.市场利率上升 25 个基点	-18,335,426.72	-19,043,055.95	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022 年 12 月 31 日		2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	651,151,106.81	15.48	368,636,993.20	11.53
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	651,151,106.81	15.48	368,636,993.20	11.53

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	58,098,075.94	20,976,082.22
	2.业绩比较基准下降 5%	-58,098,075.94	-20,976,082.22

注：股票投资业绩基准取上证 A 指。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,293,984,945.87	420,035,169.48

第二层次	5,070,929,086.16	4,096,146,876.18
第三层次	839,722.83	-
合计	6,365,753,754.86	4,516,182,045.66

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	14,042,522.37	14,042,522.37
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	13,792,112.28	13,792,112.28
当期利得或损失总额	-	589,312.74	589,312.74
其中：计入损益的利得或损失	-	589,312.74	589,312.74
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	839,722.83	839,722.83
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	123,779.93	123,779.93
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-



其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	839,722.83	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2063—2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	651,151,106.81	10.14
	其中：股票	651,151,106.81	10.14
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	5,714,602,648.05	88.96
	其中：债券	5,204,703,227.04	81.02
	资产支持证券	509,899,421.01	7.94
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	57,784,085.46	0.90
8	其他各项资产	233,945.08	0.00
9	合计	6,423,771,785.40	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,625,125.00	0.16
B	采矿业	1,151,400.00	0.03
C	制造业	394,189,670.57	9.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,487,988.00	0.15
E	建筑业	22,115,917.98	0.53
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	36,510,405.60	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,480,968.52	2.13
J	金融业	56,024,719.89	1.33
K	房地产业	15,452,337.25	0.37
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	18,291,136.17	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	75,777.70	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	4,745,660.13	0.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	651,151,106.81	15.48

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600941	中国移动	770,563	52,143,998.21	1.24
2	601728	中国电信	8,843,700	37,055,103.00	0.88
3	300059	东方财富	1,510,100	29,295,940.00	0.70
4	600519	贵州茅台	16,700	28,840,900.00	0.69
5	601799	星宇股份	188,618	24,024,274.66	0.57
6	688007	光峰科技	839,301	20,865,022.86	0.50
7	601111	中国国航	1,910,528	20,251,596.80	0.48
8	600346	恒力石化	1,248,600	19,390,758.00	0.46
9	600690	海尔智家	755,752	18,485,693.92	0.44
10	300760	迈瑞医疗	57,500	18,168,275.00	0.43
11	300347	泰格医药	173,100	18,140,880.00	0.43
12	600873	梅花生物	1,741,512	17,728,592.16	0.42
13	600660	福耀玻璃	501,300	17,580,591.00	0.42
14	002415	海康威视	481,200	16,688,016.00	0.40
15	600585	海螺水泥	514,810	14,095,497.80	0.34
16	002223	鱼跃医疗	420,500	13,397,130.00	0.32
17	000786	北新建材	494,300	12,792,484.00	0.30
18	000858	五粮液	66,500	12,015,885.00	0.29
19	600104	上汽集团	801,700	11,552,497.00	0.27
20	000402	金融街	2,001,409	10,507,397.25	0.25
21	603885	吉祥航空	601,400	9,730,652.00	0.23
22	002493	荣盛石化	778,000	9,569,400.00	0.23
23	601238	广汽集团	778,900	8,591,267.00	0.20
24	600150	中国船舶	375,300	8,361,684.00	0.20
25	603606	东方电缆	121,700	8,254,911.00	0.20
26	601611	中国核建	1,033,300	7,853,080.00	0.19
27	600030	中信证券	393,355	7,831,698.05	0.19
28	000401	冀东水泥	918,215	7,556,909.45	0.18
29	601318	中国平安	159,490	7,496,030.00	0.18
30	000001	平安银行	562,938	7,408,264.08	0.18
31	002375	亚厦股份	1,546,427	6,804,278.80	0.16

32	000333	美的集团	131,000	6,785,800.00	0.16
33	688660	电气风电	1,106,733	6,651,465.33	0.16
34	002714	牧原股份	135,900	6,625,125.00	0.16
35	600029	南方航空	858,968	6,528,156.80	0.16
36	601633	长城汽车	219,500	6,501,590.00	0.15
37	600685	中船防务	300,000	6,228,000.00	0.15
38	600438	通威股份	157,100	6,060,918.00	0.14
39	002532	天山铝业	783,100	6,045,532.00	0.14
40	601669	中国电建	784,600	5,554,968.00	0.13
41	000933	神火股份	369,300	5,524,728.00	0.13
42	002402	和而泰	375,700	5,477,706.00	0.13
43	002202	金风科技	478,395	5,262,345.00	0.13
44	000002	万科 A	271,700	4,944,940.00	0.12
45	688169	石头科技	18,898	4,681,979.50	0.11
46	300015	爱尔眼科	148,399	4,610,756.93	0.11
47	002821	凯莱英	31,000	4,588,000.00	0.11
48	603596	伯特利	57,400	4,580,520.00	0.11
49	603486	科沃斯	58,411	4,260,498.34	0.10
50	600703	三安光电	246,400	4,228,224.00	0.10
51	000977	浪潮信息	196,300	4,224,376.00	0.10
52	600426	华鲁恒升	124,390	4,123,528.50	0.10
53	601601	中国太保	162,838	3,992,787.76	0.09
54	002180	纳思达	72,900	3,782,781.00	0.09
55	600027	华电国际	579,500	3,407,460.00	0.08
56	300850	新强联	61,710	3,287,908.80	0.08
57	600011	华能国际	404,800	3,080,528.00	0.07
58	601989	中国重工	879,800	3,070,502.00	0.07
59	601012	隆基绿能	60,828	2,570,591.28	0.06
60	601877	正泰电器	89,577	2,481,282.90	0.06
61	002250	联化科技	146,500	2,270,750.00	0.05
62	601117	中国化学	239,747	1,903,591.18	0.05
63	000778	新兴铸管	517,884	1,890,276.60	0.04
64	600583	海油工程	190,000	1,151,400.00	0.03
65	002179	中航光电	9,304	537,399.04	0.01
66	688247	宣泰医药	11,170	175,005.55	0.00
67	301269	华大九天	1,868	165,762.92	0.00
68	301297	富乐德	10,147	150,256.17	0.00
69	301238	瑞泰新材	5,597	125,876.53	0.00
70	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.00
71	301266	宇邦新材	917	69,325.20	0.00
72	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
73	301239	普瑞眼科	975	68,306.00	0.00
74	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
75	301175	中科环保	9,470	57,100.70	0.00

76	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
77	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
78	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
79	301286	侨源股份	1,284	31,727.64	0.00
80	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
81	301248	杰创智能	872	26,578.56	0.00
82	301171	易点天下	1,385	24,938.20	0.00
83	301338	凯格精机	457	22,782.43	0.00
84	301187	欧圣电气	1,276	21,589.92	0.00
85	301282	金禄电子	834	21,466.50	0.00
86	301160	翔楼新材	592	21,087.04	0.00
87	301132	满坤科技	768	19,082.64	0.00
88	301259	艾布鲁	983	18,677.00	0.00
89	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
90	301112	信邦智能	599	18,622.91	0.00
91	301296	新巨丰	1,142	17,070.80	0.00
92	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
93	301339	通行宝	1,013	15,890.67	0.00
94	301298	东利机械	1,034	15,665.10	0.00
95	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
96	301288	清研环境	852	14,185.80	0.00
97	301220	亚香股份	385	14,179.55	0.00
98	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
99	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
100	301163	宏德股份	477	12,540.33	0.00
101	301300	远翔新材	411	12,263.07	0.00
102	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
103	301270	汉仪股份	410	11,997.70	0.00
104	301197	工大科雅	580	11,728.40	0.00
105	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
106	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
107	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
108	301125	腾亚精工	427	10,286.43	0.00
109	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
110	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
111	301233	盛帮股份	258	8,870.40	0.00
112	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
113	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
114	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
115	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
116	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
117	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
118	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
119	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00

120	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
121	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
122	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
123	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600941	中国移动	50,698,997.62	1.59
2	601799	星宇股份	36,371,420.46	1.14
3	601728	中国电信	34,179,376.00	1.07
4	688007	光峰科技	32,504,803.93	1.02
5	300347	泰格医药	29,596,044.00	0.93
6	600660	福耀玻璃	28,317,497.44	0.89
7	600346	恒力石化	27,674,828.17	0.87
8	600519	贵州茅台	25,434,137.00	0.80
9	300059	东方财富	24,755,287.44	0.77
10	600873	梅花生物	21,879,818.03	0.68
11	300760	迈瑞医疗	18,697,592.61	0.59
12	600438	通威股份	18,164,698.61	0.57
13	600104	上汽集团	18,129,380.82	0.57
14	601238	广汽集团	17,810,363.88	0.56
15	688169	石头科技	17,580,233.23	0.55
16	002493	荣盛石化	16,229,817.00	0.51
17	002415	海康威视	15,471,355.00	0.48
18	600690	海尔智家	14,565,147.00	0.46
19	000333	美的集团	14,096,636.79	0.44
20	688660	电气风电	13,994,836.36	0.44

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

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002714	牧原股份	43,169,689.06	1.35
2	601117	中国化学	23,085,681.29	0.72

3	002142	宁波银行	21,776,880.38	0.68
4	600036	招商银行	20,403,118.00	0.64
5	300347	泰格医药	19,481,812.00	0.61
6	600438	通威股份	14,333,234.54	0.45
7	000401	冀东水泥	13,221,817.20	0.41
8	688007	光峰科技	12,335,805.19	0.39
9	600029	南方航空	12,115,728.00	0.38
10	601799	星宇股份	11,571,305.00	0.36
11	688169	石头科技	11,420,900.46	0.36
12	002415	海康威视	10,387,534.00	0.33
13	600690	海尔智家	10,289,402.00	0.32
14	601238	广汽集团	9,407,657.00	0.29
15	601872	招商轮船	8,915,881.06	0.28
16	600660	福耀玻璃	8,731,241.00	0.27
17	601611	中国核建	8,203,165.00	0.26
18	601669	中国电建	8,129,883.00	0.25
19	603806	福斯特	7,931,313.72	0.25
20	603486	科沃斯	7,560,887.55	0.24

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	779,145,437.31
卖出股票收入（成交）总额	476,168,351.19

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,171,890,706.43	27.86
	其中：政策性金融债	172,026,726.03	4.09
4	企业债券	910,297,851.19	21.64
5	企业短期融资券	70,982,123.28	1.69

6	中期票据	2,381,317,922.77	56.60
7	可转债（可交换债）	670,214,623.37	15.93
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,204,703,227.04	123.72

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1828015	18 招商银行二级 01	2,200,000	224,418,142.47	5.33
2	102100073	21 锡交通 MTN001	1,000,000	104,181,852.05	2.48
3	220322	22 进出 22	1,000,000	100,509,232.88	2.39
4	2128008	21 中国银行二级 01	800,000	84,255,693.15	2.00
5	1928004	19 农业银行二级 02	800,000	83,921,341.37	1.99

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180335	工鑫 12A	800,000	79,966,592.88	1.90
2	112060	二发 A	400,000	39,716,602.74	0.94
3	180926	铁托 7 优	400,000	39,340,918.36	0.94
4	189304	铁建 023A	300,000	30,263,408.22	0.72
5	179863	21 工鑫 4A	200,000	20,710,767.12	0.49
6	189329	21 工鑫 5A	200,000	20,446,400.00	0.49
7	180047	25 欲晓 A3	200,000	20,193,063.01	0.48
8	193933	和皖 A	200,000	20,016,485.19	0.48
9	183916	22 保置优	200,000	19,998,519.36	0.48
10	180588	大板 A	200,000	19,937,682.19	0.47
11	180991	工鑫 15A	200,000	19,851,424.66	0.47
12	135572	荟臻 021A	200,000	19,680,437.26	0.47
13	135251	曦月 3A	100,000	10,111,126.03	0.24
14	135401	润嘉 011A	100,000	10,065,395.07	0.24
15	2289003	22 融腾	100,000	10,050,602.74	0.24



		1B_bc			
16	2189533	21 招银和信 2 优先 B	100,000	10,045,659.18	0.24
17	112450	22 沪杭优	100,000	10,029,032.33	0.24
18	112424	星惠 5A	100,000	10,025,869.59	0.24
19	112440	G 鄱阳 1A2	100,000	10,017,534.25	0.24
20	183930	京诚陆 4A	100,000	10,001,895.89	0.24
21	135290	荟享 087A	100,000	9,983,684.93	0.24
22	135348	荟享 091A	100,000	9,972,341.37	0.24
23	112280	22 中公 1A	100,000	9,956,742.47	0.24
24	135541	荟臻 023A	100,000	9,926,249.32	0.24
25	180802	铁建 37A1	100,000	9,909,347.40	0.24
26	2289219	22 融腾 4B_bc	100,000	9,897,603.29	0.24
27	2289311	22 汇聚达 2B_bc	100,000	9,896,550.68	0.24
28	180961	耘睿 023A	100,000	9,887,485.48	0.24

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，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、中国银行保险监督管理委员会上海监管局、中国人民银行的处罚。中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	233,945.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	233,945.08

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113011	光大转债	51,578,568.37	1.23
2	127045	牧原转债	33,381,185.47	0.79
3	113057	中银转债	33,285,223.57	0.79
4	110053	苏银转债	29,402,591.99	0.70
5	113050	南银转债	28,277,431.89	0.67
6	127032	苏行转债	26,971,528.04	0.64
7	127058	科伦转债	25,605,621.12	0.61
8	113037	紫银转债	21,998,069.13	0.52
9	113056	重银转债	20,211,745.33	0.48
10	132020	19 蓝星 EB	19,914,954.62	0.47
11	113044	大秦转债	17,065,486.94	0.41
12	128081	海亮转债	14,109,687.37	0.34

13	113647	禾丰转债	13,663,257.55	0.32
14	110045	海澜转债	13,518,992.35	0.32
15	123077	汉得转债	12,936,953.42	0.31
16	113049	长汽转债	12,594,829.73	0.30
17	113622	杭叉转债	12,018,934.36	0.29
18	128140	润建转债	11,634,105.21	0.28
19	111000	起帆转债	11,399,170.64	0.27
20	110073	国投转债	11,330,850.99	0.27
21	127061	美锦转债	11,163,384.48	0.27
22	110085	通 22 转债	11,058,107.58	0.26
23	110059	浦发转债	10,668,149.54	0.25
24	127018	本钢转债	10,585,839.34	0.25
25	127047	帝欧转债	9,973,045.60	0.24
26	110047	山鹰转债	9,143,959.16	0.22
27	113055	成银转债	8,716,563.09	0.21
28	128037	岩土转债	8,188,629.23	0.19
29	113053	隆 22 转债	7,380,883.48	0.18
30	128109	楚江转债	6,694,212.38	0.16
31	127005	长证转债	6,530,030.14	0.16
32	110086	精工转债	5,629,862.64	0.13
33	110057	现代转债	5,170,688.88	0.12
34	127012	招路转债	4,766,708.34	0.11
35	113051	节能转债	4,685,628.08	0.11
36	120002	18 中原 EB	3,220,883.73	0.08
37	110079	杭银转债	3,200,250.61	0.08
38	110062	烽火转债	3,124,158.90	0.07
39	113629	泉峰转债	2,059,633.49	0.05
40	110081	闻泰转债	1,726,732.72	0.04
41	123107	温氏转债	1,324,635.48	0.03
42	113042	上银转债	320,243.65	0.01
43	123035	利德转债	91,397.94	0.00
44	127022	恒逸转债	71,925.86	0.00
45	127025	冀东转债	419.20	0.00

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
易方达裕惠定开混合发起式 A	74,692	34,044.50	1,839,335,303.42	72.33%	703,516,418.73	27.67%
易方达裕惠定开混合发起式 C	95	5,057.05	0.00	0.00%	480,419.98	100.00%
合计	74,787	34,007.68	1,839,335,303.42	72.32%	703,996,838.71	27.68%

### 9.2 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	易方达裕惠定开混合发起式 A	391,201.91	0.0154%
	易方达裕惠定开混合发起式 C	6,553.57	1.3641%
	合计	397,755.48	0.0156%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	易方达裕惠定开混合发起式 A	0
	易方达裕惠定开混合发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达裕惠定开混合发起式 A	0
	易方达裕惠定开混合发起式 C	0
	合计	0

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总	发起份额总数	发起份额占基金总	发起份额承诺持有期限

		份额比例		份额比例	
基金管理人固有资金	-	-	9,149,130.83	0.3597%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	9,149,130.83	0.3597%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
基金合同生效日（2014 年 8 月 18 日）基金份额总额	1,962,682,023.03	-
本报告期期初基金份额总额	1,789,783,380.60	-
本报告期基金总申购份额	2,505,420,845.03	493,655.68
减：本报告期基金总赎回份额	1,752,352,503.48	13,235.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,542,851,722.15	480,419.98

注：本基金 A 类基金份额由原基金份额变更而来，并于 2022 年 8 月 25 日起增设 C 类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022

年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自转型以来连续 9 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 104,500.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
德邦证券	1	30,240,809.29	2.49%	18,144.75	2.38%	-
华泰证券	1	781,600,399.92	64.39%	468,960.32	61.53%	-
申万宏源	3	169,203,421.32	13.94%	135,345.73	17.76%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	232,805,782.64	19.18%	139,684.03	18.33%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增交易单元的证券公司为德邦证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析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。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
德邦证券	59,589,438.53	3.70%	3,819,312,000.00	2.49%	-	-
华泰证券	1,119,031,025.14	69.47%	104,765,500,000.00	68.38%	-	-
申万宏源	280,695,826.53	17.43%	15,889,900,000.00	10.37%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	151,545,539.45	9.41%	28,725,886,000.00	18.75%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
3	易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-15

	获配冀东水泥（000401）非公开发行 A 股的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
5	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-21
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-01-21
7	易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-02-08
8	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购江阴标榜汽车部件股份有限公司首次公开发行股票的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-02-12
9	易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金第十六个运作期开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-02-18
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报	2022-03-30
11	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
12	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
13	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-04-22
14	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-28
15	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
16	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-14
17	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购昆山亚香香料股份有限公司首次公开发行股票的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-16
18	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-07-07
19	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-07-20
20	易方达基金管理有限公司关于易方达裕惠回	上海证券报、基金管理	2022-08-10



	报定期开放式混合型发起式证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同、托管协议的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
21	易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金第十七个运作期 A 类份额、C 类份额开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-08-10
22	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	上海证券报	2022-08-30
23	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	2022-09-21
24	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报	2022-10-26
25	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	2022-12-23
26	关于旗下部分定期开放基金、持有期基金、封闭运作基金 2023 年度赎回业务开放首日的提示性公告	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	2022-12-28

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022 年 01 月 01 日 ~2022 年 03 月 03 日	404,168,000 .00	0.00	404,168,000 .00	0.00	0.00%
	2	2022 年 01 月 01 日 ~2022 年 08 月 25 日	885,957,000 .00	0.00	885,957,000 .00	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定全额赎回延缓支付、延期办理赎回申请或终止基金合同，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金在任一开放运作期结束时，基金净资产低于5000万，经与基金托管人协商一致，基金管理人直接终止本基金合同进行清算；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达裕惠回报债券型证券投资基金募集的文件；
- 2.易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告；
- 3.《易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日