

易方达易百智能量化策略灵活配置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 | 5 |
| 2.4 | 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 | 其他相关资料 | 6 |
| § 3 | 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 | 基金净值表现 | 7 |
| § 4 | 管理人报告 | 9 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 | 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 | 托管人报告 | 12 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 | 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 | 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 | 资产负债表 | 13 |
| 6.2 | 利润表 | 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 | 36 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况 | 36 |
| 7.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 37 |
| 7.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 37 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动 | 45 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 47 |
| 7.6 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 47 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 48 |
| 7.8 | 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 48 |
| 7.9 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 48 |
| 7.10 | 本基金投资股指期货的投资政策 | 48 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 48 |

| | | |
|------|------------------------------------|----|
| 7.12 | 投资组合报告附注..... | 48 |
| § 8 | 基金份额持有人信息..... | 49 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 49 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| § 9 | 开放式基金份额变动..... | 50 |
| § 10 | 重大事件揭示..... | 51 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 51 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变..... | 51 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 52 |
| 10.8 | 其他重大事件..... | 54 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息..... | 55 |
| 11.1 | 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..... | 55 |
| § 12 | 备查文件目录..... | 55 |
| 12.1 | 备查文件目录..... | 55 |
| 12.2 | 存放地点..... | 55 |
| 12.3 | 查阅方式..... | 56 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------------|-----------------|
| 基金名称 | 易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 易方达易百智能量化策略混合 | |
| 基金主代码 | 005437 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2018 年 1 月 24 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 | 69,982,272.28 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达易百智能量化策略混合 A | 易方达易百智能量化策略混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005437 | 005438 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 61,474,555.56 份 | 8,507,716.72 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金主要依托于百度提供的特色数据及其数据处理能力,通过大数据挖掘和分析技术,结合基金管理人自主研发的量化策略进行投资组合管理,追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金主要借助百度在人工智能技术和算法方面的优势,同时结合其特有的互联网大数据,对证券市场相关数据进行深度分析,在海外成熟的多因子量化选股框架下扩充因子维度,对股票超额收益进行预测,并据此筛选具有投资价值的股票构建投资组合。同时,本基金也可应用定向增发套利与大宗交易套利等多种量化套利策略,根据各策略的预期收益、风险及其所使用的市场环境,发现和捕捉因市场波动及无效定价带来的价差机会,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×65%+中债新综合指数(财富)收益率×35% |
| 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。 |

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 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|-------------|---------------------------------------|
| 注册登记机构 | 易方达基金管理有限公司 | 广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 40-43 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日） | |
|---------------|--------------------------------------|---------------------|
| | 易方达易百智能量化策 略混合 A | 易方达易百智能量化策略 混合 C |
| 本期已实现收益 | -8,461,600.73 | -1,321,022.84 |
| 本期利润 | -5,589,214.49 | -812,832.46 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0897 | -0.0810 |
| 本期加权平均净值利润率 | -7.60% | -6.95% |

| | | |
|---------------|------------------|-----------------|
| 本期基金份额净值增长率 | -7.36% | -7.49% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日) | |
| | 易方达易百智能量化策略混合 A | 易方达易百智能量化策略混合 C |
| 期末可供分配利润 | 7,865,443.86 | 933,501.42 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1279 | 0.1097 |
| 期末基金资产净值 | 69,339,999.42 | 9,441,218.14 |
| 期末基金份额净值 | 1.1279 | 1.1097 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) | |
| | 易方达易百智能量化策略混合 A | 易方达易百智能量化策略混合 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 12.79% | 10.97% |

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达易百智能量化策略混合 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 2.71% | 1.38% | 0.92% | 0.56% | 1.79% | 0.82% |
| 过去三个月 | -2.52% | 1.43% | -2.77% | 0.54% | 0.25% | 0.89% |
| 过去六个月 | -7.36% | 1.33% | 0.52% | 0.55% | -7.88% | 0.78% |
| 过去一年 | -19.13% | 1.65% | -8.02% | 0.64% | -11.11% | 1.01% |
| 过去三年 | 4.83% | 1.68% | -0.01% | 0.78% | 4.84% | 0.90% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.79% | 1.49% | 3.08% | 0.82% | 9.71% | 0.67% |

易方达易百智能量化策略混合 C

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 2.69% | 1.38% | 0.92% | 0.56% | 1.77% | 0.82% |
| 过去三个月 | -2.59% | 1.43% | -2.77% | 0.54% | 0.18% | 0.89% |
| 过去六个月 | -7.49% | 1.33% | 0.52% | 0.55% | -8.01% | 0.78% |
| 过去一年 | -19.37% | 1.65% | -8.02% | 0.64% | -11.35% | 1.01% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去三年 | 3.90% | 1.68% | -0.01% | 0.78% | 3.91% | 0.90% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.97% | 1.49% | 3.08% | 0.82% | 7.89% | 0.67% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达易百智能量化策略灵活配置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

(2018 年 1 月 24 日至 2023 年 6 月 30 日)

易方达易百智能量化策略混合 A



易方达易百智能量化策略混合 C



注：自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为12.79%，同期业绩比较基准收益率为3.08%；C类基金份额净值增长率为10.97%，同期业绩比较基准收益率为3.08%。

§ 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 | | |
| 殷明 | 本基金的基金经理，易方达中证1000量化增强的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员 | 2021-03-20 | - | 7年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，国盛证券有限责任公司研究所金融工程分析师，易方达基金管 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|-------------|
| | | | | | 理有限公司量化研究员。 |
|--|--|--|--|--|-------------|

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，市场出现了一些显著的变化。首先，随着疫情影响的消退，一季度国内经济获得较为明显的复苏，无论是工业企业生产还是居民消费情况都得到了明显改善。然而到了二季度，这种复苏开始呈现结构化。具体来说，线下服务型消费如出行、餐饮、黄金珠宝等继续强劲复苏，而地产、高端消费则略有乏力。这种不对称复苏也导致了上半年总量板块的表现总体波动但仍有亮点。另一方面，以人工智能为代表的新产业新经济也进一步出现重要变化，很多新技术的涌现加速了全球科技创新，使得很多人曾经畅想的未来实现路径逐渐清晰。在这样的大背景下，本报告期内，我们在继续坚持量化选股模型的基础上，加强了对产业趋势和经济复苏结构两条主线的跟踪，并结合宏观、中观等多维度信息做出投资决策。

本报告期内，我们继续通过对基本面量化模型和量价模型的结合共同进行投资决策。总体来说，年初以来市场结构确实和以往有较大不同，在因子层面则体现出成长类因子出现了近些年最大的回撤幅度和回撤时间。市场对过去几年大幅增长的板块充满了担心，尤其是在宏观经济可能失速的背景下，这一担心在上半年体现得尤为突出。另一方面，一些新的行业出现了重要变化，市场开始预期这些新的方向未来有可能成为经济增长的重要动力。从预期成长性角度，这些板块会逐步被模型捕捉和定价，而对于一些超跌的行业和板块，模型也会从估值维度评估它们的性价比。另一方面，量价模型在年初出现了一些回撤后，二季度已经逐步回归正常工作状态。

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 1.1279 元，本报告期份额净值增长率为-7.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%；C 类基金份额净值为 1.1097 元，本报告期份额净值增长率为-7.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们依然要从宏观和微观两重角度对经济运行进行跟踪与判断：宏观层面，关注稳增长相关政策的推进以及海内外货币环境的边际变化；微观层面，关注企业的投资意愿以及失业率数据。除此之外，以人工智能为代表的重要创新也在出现重大变化，这些变化如何在未来反映到企业盈利中值得关注。

我们在时刻保持对宏观经济基本面关注的同时，更重要的是不断迭代优化量化模型，让更多具有穿越能力的因子为投资组合贡献收益。因此，未来我们还是会继续从自上而下以及自下而上两个角度进行深入研究，通过量化模型紧密跟踪相关数据，快速准确地做出投资决策。同时，我们依然会坚持在大数据、机器学习、另类数据中的深入研究，充分利用更多的信息源对选股模型进行增强，争取为投资者创造持续稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达易百智能量化策略混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达易百智能量化策略混合 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达易百智能量化策略灵活配置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：易方达易百智能量化策略灵活配置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 | 3,979,521.27 | 6,009,563.11 |
| 结算备付金 | | 282,789.05 | 244,934.39 |
| 存出保证金 | | 8,719.63 | 17,904.04 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 74,676,541.78 | 85,723,521.31 |
| 其中：股票投资 | | 74,628,334.39 | 85,723,521.31 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 48,207.39 | - |
| 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 | | 357,280.09 | 111,695.39 |
| 应收股利 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 应收申购款 | | 3,520.78 | 6,757.35 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 79,308,372.60 | 92,114,375.59 |
| 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 | | 136,759.21 | 86.92 |
| 应付赎回款 | | 174,332.24 | 1,272,154.14 |
| 应付管理人报酬 | | 97,744.76 | 119,578.44 |
| 应付托管费 | | 16,290.79 | 19,929.76 |
| 应付销售服务费 | | 2,520.24 | 4,326.12 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 0.21 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 99,507.59 | 160,020.03 |
| 负债合计 | | 527,155.04 | 1,576,095.41 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 69,982,272.28 | 74,542,847.61 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 8,798,945.28 | 15,995,432.57 |
| 净资产合计 | | 78,781,217.56 | 90,538,280.18 |
| 负债和净资产总计 | | 79,308,372.60 | 92,114,375.59 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1279 元，C 类基金份额净值 1.1097 元；基金份额总额 69,982,272.28 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 61,474,555.56 份，C 类基金份额总额 8,507,716.72 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达易百智能量化策略灵活配置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 | | -5,564,223.63 | -15,025,756.47 |
| 1.利息收入 | | 9,695.45 | 16,460.91 |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------------|-----------------------|
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 9,695.45 | 16,460.91 |
| 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） | | -8,962,241.58 | -24,010,213.29 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -9,311,577.74 | -24,306,539.07 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 2,703.69 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | 346,632.47 | 296,325.78 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 3,380,576.62 | 8,942,652.04 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 7,745.88 | 25,343.87 |
| 减：二、营业总支出 | | 837,823.32 | 1,021,847.17 |
| 1. 管理人报酬 | | 634,703.10 | 760,709.00 |
| 2. 托管费 | | 105,783.86 | 126,784.85 |
| 3. 销售服务费 | | 17,457.94 | 33,167.16 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.17 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 0.04 | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.18 | 79,878.38 | 101,186.16 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -6,402,046.95 | -16,047,603.64 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -6,402,046.95 | -16,047,603.64 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -6,402,046.95 | -16,047,603.64 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达易百智能量化策略灵活配置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) | 74,542,847.61 | 15,995,432.57 | 90,538,280.18 |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 74,542,847.61 | 15,995,432.57 | 90,538,280.18 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -4,560,575.33 | -7,196,487.29 | -11,757,062.62 |
| (一)、综合收益总额 | - | -6,402,046.95 | -6,402,046.95 |
| (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) | -4,560,575.33 | -794,440.34 | -5,355,015.67 |
| 其中：1.基金申购款 | 4,543,242.37 | 858,345.85 | 5,401,588.22 |
| 2.基金赎回款 | -9,103,817.70 | -1,652,786.19 | -10,756,603.89 |
| (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) | 69,982,272.28 | 8,798,945.28 | 78,781,217.56 |
| 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) | 117,216,933.33 | 54,384,758.11 | 171,601,691.44 |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 117,216,933.33 | 54,384,758.11 | 171,601,691.44 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -46,747,555.55 | -26,729,324.78 | -73,476,880.33 |
| (一)、综合收益总额 | - | -16,047,603.64 | -16,047,603.64 |
| (二)、本期基金份额交易产生 | -46,747,555.55 | -10,681,721.14 | -57,429,276.69 |

| | | | |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 9,627,529.76 | 3,120,666.93 | 12,748,196.69 |
| 2.基金赎回款 | -56,375,085.31 | -13,802,388.07 | -70,177,473.38 |
| （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） | 70,469,377.78 | 27,655,433.33 | 98,124,811.11 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铨

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2163 号《关于准予易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 794,754,696.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 449,820.67 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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>》、中国证券投资基金业协会(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》《易方达易百智能量化策略灵活配置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[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]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)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从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。

(4) 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。

(5) 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 | 3,979,521.27 |
| 等于：本金 | 3,979,123.30 |
| 加：应计利息 | 397.97 |
| 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 | 3,979,521.27 |

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 | 73,571,627.85 | - | 74,628,334.39 | 1,056,706.54 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 37,999.83 | 11.99 | 48,207.39 | 10,195.57 |
| 交易所 | | | | |

| | | | | | |
|--------|-----------|---------------|-------|---------------|--------------|
| | 市场 | | | | |
| | 银行间 市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 37,999.83 | 11.99 | 48,207.39 | 10,195.57 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 73,609,627.68 | 11.99 | 74,676,541.78 | 1,066,902.11 |

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 | 0.22 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 99,507.37 |
| 合计 | 99,507.59 |

6.4.7.7 实收基金

易方达易百智能量化策略混合 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 62,506,247.60 | 62,506,247.60 |
| 本期申购 | 1,558,978.32 | 1,558,978.32 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,590,670.36 | -2,590,670.36 |
| 本期末 | 61,474,555.56 | 61,474,555.56 |

易方达易百智能量化策略混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 12,036,600.01 | 12,036,600.01 |
| 本期申购 | 2,984,264.05 | 2,984,264.05 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,513,147.34 | -6,513,147.34 |
| 本期末 | 8,507,716.72 | 8,507,716.72 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达易百智能量化策略混合 A

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 17,310,832.13 | -3,717,976.30 | 13,592,855.83 |
| 本期利润 | -8,461,600.73 | 2,872,386.24 | -5,589,214.49 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -189,020.44 | 50,822.96 | -138,197.48 |
| 其中：基金申购款 | 364,130.59 | -61,896.53 | 302,234.06 |
| 基金赎回款 | -553,151.03 | 112,719.49 | -440,431.54 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 8,660,210.96 | -794,767.10 | 7,865,443.86 |

易方达易百智能量化策略混合 C

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------|--------------|-------------|--------------|
| 上年度末 | 3,115,406.78 | -712,830.04 | 2,402,576.74 |

| | | | |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 本期利润 | -1,321,022.84 | 508,190.38 | -812,832.46 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -746,846.81 | 90,603.95 | -656,242.86 |
| 其中：基金申购款 | 689,667.51 | -133,555.72 | 556,111.79 |
| 基金赎回款 | -1,436,514.32 | 224,159.67 | -1,212,354.65 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,047,537.13 | -114,035.71 | 933,501.42 |

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 | 8,195.88 | |
| 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 | 1,395.36 | |
| 其他 | 104.21 | |
| 合计 | 9,695.45 | |

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 | -9,311,577.74 | |
| 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 | -9,311,577.74 | |

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 | 166,372,084.34 | |
| 减：卖出股票成本总额 | 175,491,527.25 | |
| 减：交易费用 | 192,134.83 | |
| 买卖股票差价收入 | -9,311,577.74 | |

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------------|----------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 15.15 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,688.54 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 2,703.69 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 14,692.92 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 11,999.84 |
| 减：应计利息总额 | 3.95 |
| 减：交易费用 | 0.59 |
| 买卖债券差价收入 | 2,688.54 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 346,632.47 |
| 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 | 346,632.47 |

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 1.交易性金融资产 | 3,380,576.62 |
| ——股票投资 | 3,370,381.05 |
| ——债券投资 | 10,195.57 |

| | |
|----------------------------|--------------|
| ——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 | 3,380,576.62 |

6.4.7.16 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 | 7,745.88 |
| 合计 | 7,745.88 |

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用 | 19,835.79 |
| 信息披露费 | 39,671.58 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00 |
| 银行汇划费 | 1,771.01 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 79,878.38 |

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 |
| 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 | 634,703.10 | 760,709.00 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 145,366.14 | 169,156.45 |

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售

活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 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 | 105,783.86 | 126,784.85 |

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|----------------------|-----------------|-----------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 易方达易百智能量化策略混合 A | 易方达易百智能量化策略混合 C | 合计 |
| 易方达基金管理有限公司 | - | 7,846.25 | 7,846.25 |
| 中国银行 | - | 1,633.43 | 1,633.43 |
| 广发证券 | - | 68.95 | 68.95 |
| 合计 | - | 9,548.63 | 9,548.63 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 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销售服务费 | | |
| | 易方达易百智能量化策略混合 A | 易方达易百智能量化策略混合 C | 合计 |
| 易方达基金管理有限公司 | - | 15,765.18 | 15,765.18 |
| 中国银行 | - | 1,233.50 | 1,233.50 |
| 广发证券 | - | 71.83 | 71.83 |
| 合计 | - | 17,070.51 | 17,070.51 |

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 0.30%，按

前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付。

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

份额单位：份

| 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 | |
|----------------------|----------------------------|-------------------|---------------------------------|-------------------|
| | 易方达易百智能 化策略混合A | 易方达易百智能 化策略混合C | 易方达易百智能 化策略混合A | 易方达易百智能 化策略混合C |
| 报告期初持有的基 金份额 | 23,782,305.37 | - | 23,782,305.37 | - |
| 报告期间申购/买入 总份额 | - | - | - | - |
| 报告期间因拆分变 动份额 | - | - | - | - |
| 减：报告期间赎回/ 卖出总份额 | - | - | - | - |
| 报告期末持有的基 金份额 | 23,782,305.37 | - | 23,782,305.37 | - |
| 报告期末持有的基 金份额占基金总份 | 38.6864% | - | 38.4332% | - |

| | | | | |
|-----|--|--|--|--|
| 额比例 | | | | |
|-----|--|--|--|--|

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达易百智能量化策略混合 A

无。

易方达易百智能量化策略混合 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 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 |
| 中国银行-活期存款 | 3,979,521.27 | 8,195.88 | 5,610,009.35 | 10,335.98 |

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 |
| - | - | - | - | - | - |
| 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 | 标榜股份 | 新股网下发行 | 1,135 | 45,683.75 |
| 中银国际证券股份有限公司 | 600938 | 中国海油 | 新股网下发行 | 120,005 | 1,296,054.00 |

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

易方达易百智能量化策略混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达易百智能量化策略混合 C

本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在

风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.06%(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 | 48,207.39 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 48,207.39 | 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。

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 | 3,979,521.27 | - | - | - | 3,979,521.27 |
| 结算备付金 | 282,789.05 | - | - | - | 282,789.05 |
| 存出保证金 | 8,719.63 | - | - | - | 8,719.63 |
| 交易性金融资产 | - | - | 48,207.39 | 74,628,334.39 | 74,676,541.78 |

| | | | | | |
|-------------------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | 357,280.09 | 357,280.09 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 3,520.78 | 3,520.78 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 4,271,029.95 | - | 48,207.39 | 74,989,135.26 | 79,308,372.60 |
| 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 | - | - | - | 136,759.21 | 136,759.21 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 174,332.24 | 174,332.24 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 97,744.76 | 97,744.76 |
| 应付托管费 | - | - | - | 16,290.79 | 16,290.79 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 2,520.24 | 2,520.24 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 0.21 | 0.21 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 99,507.59 | 99,507.59 |
| 负债总计 | - | - | - | 527,155.04 | 527,155.04 |
| 利率敏感度缺口 | 4,271,029.95 | - | 48,207.39 | 74,461,980.22 | 78,781,217.56 |
| 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 | 6,009,563.11 | - | - | - | 6,009,563.11 |
| 结算备付金 | 244,934.39 | - | - | - | 244,934.39 |
| 存出保证金 | 17,904.04 | - | - | - | 17,904.04 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 85,723,521.31 | 85,723,521.31 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | 111,695.39 | 111,695.39 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 应收申购款 | - | - | - | 6,757.35 | 6,757.35 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 6,272,401.54 | - | - | 85,841,974.05 | 92,114,375.59 |
| 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 | - | - | - | 86.92 | 86.92 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,272,154.14 | 1,272,154.14 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 119,578.44 | 119,578.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | 19,929.76 | 19,929.76 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 4,326.12 | 4,326.12 |
| 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 | - | - | - | 160,020.03 | 160,020.03 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,576,095.41 | 1,576,095.41 |
| 利率敏感度缺口 | 6,272,401.54 | - | - | 84,265,878.64 | 90,538,280.18 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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 | 74,628,334.39 | 94.73 | 85,723,521.31 | 94.68 |
| 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 | 74,628,334.39 | 94.73 | 85,723,521.31 | 94.68 |

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% | 4,516,593.00 | 5,779,507.29 |
| | 2.业绩比较基准下降 5% | -4,516,593.00 | -5,779,507.29 |

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 | 74,676,541.78 |
| 第二层次 | - |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 74,676,541.78 |

6.4.14.2 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 | 74,628,334.39 | 94.10 |
| | 其中：股票 | 74,628,334.39 | 94.10 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 48,207.39 | 0.06 |
| | 其中：债券 | 48,207.39 | 0.06 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返 | - | - |

| | | | |
|---|--------------|---------------|--------|
| | 售金融资产 | | |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,262,310.32 | 5.37 |
| 8 | 其他各项资产 | 369,520.50 | 0.47 |
| 9 | 合计 | 79,308,372.60 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 300,735.00 | 0.38 |
| C | 制造业 | 63,866,136.40 | 81.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 684,597.25 | 0.87 |
| F | 批发和零售业 | 389,220.00 | 0.49 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 7,961,249.75 | 10.11 |
| J | 金融业 | 102,039.00 | 0.13 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 279,307.10 | 0.35 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 305,469.89 | 0.39 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 739,580.00 | 0.94 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 74,628,334.39 | 94.73 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 002897 | 意华股份 | 19,700 | 911,716.00 | 1.16 |
| 2 | 605117 | 德业股份 | 5,872 | 878,157.60 | 1.11 |
| 3 | 688072 | 拓荆科技 | 2,052 | 874,090.44 | 1.11 |
| 4 | 002865 | 钧达股份 | 5,654 | 862,404.62 | 1.09 |
| 5 | 300499 | 高澜股份 | 47,300 | 833,426.00 | 1.06 |
| 6 | 600732 | 爱旭股份 | 27,100 | 833,325.00 | 1.06 |
| 7 | 688120 | 华海清科 | 3,281 | 826,976.05 | 1.05 |
| 8 | 688408 | 中信博 | 9,611 | 810,495.63 | 1.03 |
| 9 | 688037 | 芯源微 | 4,601 | 786,540.95 | 1.00 |
| 10 | 688160 | 步科股份 | 8,916 | 744,486.00 | 0.95 |
| 11 | 688032 | 禾迈股份 | 2,005 | 712,075.75 | 0.90 |
| 12 | 300274 | 阳光电源 | 6,000 | 699,780.00 | 0.89 |
| 13 | 300842 | 帝科股份 | 6,700 | 612,648.00 | 0.78 |
| 14 | 300389 | 艾比森 | 30,000 | 611,100.00 | 0.78 |
| 15 | 601689 | 拓普集团 | 7,300 | 589,110.00 | 0.75 |
| 16 | 301168 | 通灵股份 | 8,500 | 529,550.00 | 0.67 |
| 17 | 688348 | 昱能科技 | 2,639 | 495,683.37 | 0.63 |
| 18 | 002738 | 中矿资源 | 9,260 | 471,704.40 | 0.60 |
| 19 | 688390 | 固德威 | 2,793 | 466,039.98 | 0.59 |
| 20 | 002079 | 苏州固锟 | 31,100 | 454,060.00 | 0.58 |
| 21 | 688383 | 新益昌 | 3,207 | 446,478.54 | 0.57 |
| 22 | 300660 | 江苏雷利 | 11,640 | 444,648.00 | 0.56 |
| 23 | 605133 | 嵘泰股份 | 12,700 | 441,452.00 | 0.56 |
| 24 | 688516 | 奥特维 | 2,239 | 421,827.60 | 0.54 |
| 25 | 002913 | 奥士康 | 11,000 | 419,980.00 | 0.53 |
| 26 | 688082 | 盛美上海 | 3,759 | 414,993.60 | 0.53 |
| 27 | 688012 | 中微公司 | 2,596 | 406,144.20 | 0.52 |
| 28 | 002837 | 英维克 | 12,556 | 375,926.64 | 0.48 |
| 29 | 603063 | 禾望电气 | 12,000 | 369,000.00 | 0.47 |
| 30 | 300820 | 英杰电气 | 4,400 | 362,472.00 | 0.46 |
| 31 | 002463 | 沪电股份 | 17,200 | 360,168.00 | 0.46 |
| 32 | 688332 | 中科蓝讯 | 4,301 | 359,907.68 | 0.46 |
| 33 | 300982 | 苏文电能 | 5,900 | 357,304.00 | 0.45 |
| 34 | 688256 | 寒武纪 | 1,868 | 351,184.00 | 0.45 |
| 35 | 603050 | 科林电气 | 21,740 | 350,231.40 | 0.44 |
| 36 | 603662 | 柯力传感 | 9,500 | 349,600.00 | 0.44 |
| 37 | 688018 | 乐鑫科技 | 2,677 | 347,528.14 | 0.44 |
| 38 | 688255 | 凯尔达 | 10,198 | 345,304.28 | 0.44 |
| 39 | 688322 | 奥比中光 | 8,201 | 342,145.72 | 0.43 |
| 40 | 300580 | 贝斯特 | 14,000 | 340,060.00 | 0.43 |
| 41 | 301030 | 仕净科技 | 4,900 | 338,590.00 | 0.43 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 42 | 002459 | 晶澳科技 | 8,104 | 337,936.80 | 0.43 |
| 43 | 300713 | 英可瑞 | 14,900 | 337,634.00 | 0.43 |
| 44 | 300118 | 东方日升 | 12,800 | 328,064.00 | 0.42 |
| 45 | 688700 | 东威科技 | 3,278 | 326,914.94 | 0.41 |
| 46 | 688036 | 传音控股 | 2,208 | 324,576.00 | 0.41 |
| 47 | 688017 | 绿的谐波 | 1,987 | 322,688.80 | 0.41 |
| 48 | 000021 | 深科技 | 15,800 | 315,842.00 | 0.40 |
| 49 | 300459 | 汤姆猫 | 48,500 | 314,765.00 | 0.40 |
| 50 | 688766 | 普冉股份 | 2,906 | 310,418.92 | 0.39 |
| 51 | 300475 | 香农芯创 | 12,000 | 307,560.00 | 0.39 |
| 52 | 688153 | 唯捷创芯 | 4,195 | 306,906.20 | 0.39 |
| 53 | 002605 | 姚记科技 | 6,600 | 306,438.00 | 0.39 |
| 54 | 300870 | 欧陆通 | 5,100 | 305,643.00 | 0.39 |
| 55 | 301308 | 江波龙 | 3,000 | 305,280.00 | 0.39 |
| 56 | 300748 | 金力永磁 | 10,100 | 302,192.00 | 0.38 |
| 57 | 002192 | 融捷股份 | 4,500 | 300,735.00 | 0.38 |
| 58 | 688533 | 上声电子 | 6,402 | 299,165.46 | 0.38 |
| 59 | 688063 | 派能科技 | 1,504 | 298,168.00 | 0.38 |
| 60 | 301018 | 申菱环境 | 8,200 | 295,118.00 | 0.37 |
| 61 | 000970 | 中科三环 | 23,000 | 294,860.00 | 0.37 |
| 62 | 002997 | 瑞鹄模具 | 9,900 | 294,327.00 | 0.37 |
| 63 | 600933 | 爱柯迪 | 12,400 | 288,796.00 | 0.37 |
| 64 | 002222 | 福晶科技 | 10,400 | 288,496.00 | 0.37 |
| 65 | 002371 | 北方华创 | 900 | 285,885.00 | 0.36 |
| 66 | 688416 | 恒烁股份 | 3,551 | 278,753.50 | 0.35 |
| 67 | 688502 | 茂莱光学 | 1,449 | 278,208.00 | 0.35 |
| 68 | 688099 | 晶晨股份 | 3,296 | 277,918.72 | 0.35 |
| 69 | 300491 | 通合科技 | 9,600 | 275,520.00 | 0.35 |
| 70 | 002050 | 三花智控 | 9,100 | 275,366.00 | 0.35 |
| 71 | 603915 | 国茂股份 | 13,000 | 275,340.00 | 0.35 |
| 72 | 688517 | 金冠电气 | 12,534 | 275,246.64 | 0.35 |
| 73 | 000066 | 中国长城 | 19,900 | 275,217.00 | 0.35 |
| 74 | 688525 | 佰维存储 | 3,444 | 275,141.16 | 0.35 |
| 75 | 688698 | 伟创电气 | 6,873 | 274,782.54 | 0.35 |
| 76 | 603228 | 景旺电子 | 10,700 | 274,455.00 | 0.35 |
| 77 | 688041 | 海光信息 | 4,013 | 273,967.51 | 0.35 |
| 78 | 300223 | 北京君正 | 3,100 | 273,761.00 | 0.35 |
| 79 | 605277 | 新亚电子 | 16,873 | 272,667.68 | 0.35 |
| 80 | 688048 | 长光华芯 | 2,883 | 272,501.16 | 0.35 |
| 81 | 001309 | 德明利 | 2,900 | 269,700.00 | 0.34 |
| 82 | 301278 | 快可电子 | 4,140 | 269,100.00 | 0.34 |
| 83 | 002126 | 银轮股份 | 15,200 | 269,040.00 | 0.34 |
| 84 | 605168 | 三人行 | 3,115 | 267,703.10 | 0.34 |
| 85 | 688368 | 晶丰明源 | 2,095 | 266,504.95 | 0.34 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 86 | 300476 | 胜宏科技 | 11,000 | 265,210.00 | 0.34 |
| 87 | 300913 | 兆龙互连 | 5,700 | 265,050.00 | 0.34 |
| 88 | 300490 | 华自科技 | 15,400 | 264,264.00 | 0.34 |
| 89 | 603800 | 道森股份 | 9,700 | 263,840.00 | 0.33 |
| 90 | 688535 | 华海诚科 | 4,297 | 262,675.61 | 0.33 |
| 91 | 000977 | 浪潮信息 | 5,400 | 261,900.00 | 0.33 |
| 92 | 300613 | 富瀚微 | 4,600 | 261,004.00 | 0.33 |
| 93 | 300224 | 正海磁材 | 20,100 | 258,486.00 | 0.33 |
| 94 | 603728 | 鸣志电器 | 3,200 | 256,960.00 | 0.33 |
| 95 | 688110 | 东芯股份 | 7,118 | 256,959.80 | 0.33 |
| 96 | 688220 | 翱捷科技 | 3,378 | 254,667.42 | 0.32 |
| 97 | 002436 | 兴森科技 | 16,400 | 254,200.00 | 0.32 |
| 98 | 688008 | 澜起科技 | 4,424 | 254,026.08 | 0.32 |
| 99 | 300693 | 盛弘股份 | 6,875 | 253,825.00 | 0.32 |
| 100 | 688515 | 裕太微 | 1,467 | 251,825.22 | 0.32 |
| 101 | 300745 | 欣锐科技 | 5,700 | 251,769.00 | 0.32 |
| 102 | 688300 | 联瑞新材 | 5,371 | 251,094.25 | 0.32 |
| 103 | 688195 | 腾景科技 | 4,643 | 248,075.49 | 0.31 |
| 104 | 300926 | 博俊科技 | 10,860 | 248,042.40 | 0.31 |
| 105 | 300458 | 全志科技 | 9,100 | 247,975.00 | 0.31 |
| 106 | 688262 | 国芯科技 | 6,087 | 247,680.03 | 0.31 |
| 107 | 300567 | 精测电子 | 2,600 | 247,390.00 | 0.31 |
| 108 | 688378 | 奥来德 | 4,990 | 246,506.00 | 0.31 |
| 109 | 301268 | 铭利达 | 5,800 | 242,846.00 | 0.31 |
| 110 | 688362 | 甬矽电子 | 7,294 | 242,817.26 | 0.31 |
| 111 | 300788 | 中信出版 | 7,300 | 242,433.00 | 0.31 |
| 112 | 603163 | 圣晖集成 | 5,275 | 241,753.25 | 0.31 |
| 113 | 688047 | 龙芯中科 | 2,097 | 240,714.63 | 0.31 |
| 114 | 300607 | 拓斯达 | 16,000 | 240,480.00 | 0.31 |
| 115 | 002130 | 沃尔核材 | 29,600 | 240,352.00 | 0.31 |
| 116 | 300024 | 机器人 | 14,400 | 240,048.00 | 0.30 |
| 117 | 600111 | 北方稀土 | 10,000 | 239,800.00 | 0.30 |
| 118 | 688599 | 天合光能 | 5,574 | 237,508.14 | 0.30 |
| 119 | 300604 | 长川科技 | 5,000 | 237,450.00 | 0.30 |
| 120 | 688686 | 奥普特 | 1,431 | 235,370.88 | 0.30 |
| 121 | 300351 | 永贵电器 | 14,300 | 234,949.00 | 0.30 |
| 122 | 300624 | 万兴科技 | 2,000 | 234,300.00 | 0.30 |
| 123 | 002056 | 横店东磁 | 12,800 | 233,088.00 | 0.30 |
| 124 | 000988 | 华工科技 | 6,100 | 231,861.00 | 0.29 |
| 125 | 002756 | 永兴材料 | 3,700 | 231,657.00 | 0.29 |
| 126 | 688400 | 凌云光 | 7,574 | 230,855.52 | 0.29 |
| 127 | 688392 | 骄成超声 | 2,077 | 230,526.23 | 0.29 |
| 128 | 300706 | 阿石创 | 7,800 | 229,164.00 | 0.29 |
| 129 | 688372 | 伟测科技 | 1,493 | 228,652.95 | 0.29 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 130 | 301378 | 通达海 | 3,500 | 225,995.00 | 0.29 |
| 131 | 603305 | 旭升集团 | 8,080 | 225,189.60 | 0.29 |
| 132 | 300990 | 同飞股份 | 4,456 | 224,136.80 | 0.28 |
| 133 | 301013 | 利和兴 | 15,600 | 223,080.00 | 0.28 |
| 134 | 600584 | 长电科技 | 6,900 | 215,073.00 | 0.27 |
| 135 | 300141 | 和顺电气 | 20,000 | 214,200.00 | 0.27 |
| 136 | 688305 | 科德数控 | 2,134 | 213,954.84 | 0.27 |
| 137 | 300496 | 中科创达 | 2,200 | 211,970.00 | 0.27 |
| 138 | 002276 | 万马股份 | 17,500 | 211,925.00 | 0.27 |
| 139 | 300893 | 松原股份 | 8,200 | 210,986.00 | 0.27 |
| 140 | 300212 | 易华录 | 6,300 | 209,349.00 | 0.27 |
| 141 | 603019 | 中科曙光 | 4,100 | 208,690.00 | 0.26 |
| 142 | 600312 | 平高电气 | 16,800 | 208,152.00 | 0.26 |
| 143 | 300001 | 特锐德 | 10,000 | 207,800.00 | 0.26 |
| 144 | 300007 | 汉威科技 | 9,800 | 207,270.00 | 0.26 |
| 145 | 000938 | 紫光股份 | 6,500 | 207,025.00 | 0.26 |
| 146 | 688697 | 纽威数控 | 8,011 | 206,924.13 | 0.26 |
| 147 | 300232 | 洲明科技 | 22,600 | 206,564.00 | 0.26 |
| 148 | 688292 | 浩瀚深度 | 7,193 | 206,439.10 | 0.26 |
| 149 | 300188 | 美亚柏科 | 9,900 | 205,821.00 | 0.26 |
| 150 | 002777 | 久远银海 | 5,800 | 205,726.00 | 0.26 |
| 151 | 300946 | 恒而达 | 5,400 | 205,308.00 | 0.26 |
| 152 | 600633 | 浙数文化 | 12,600 | 204,246.00 | 0.26 |
| 153 | 300480 | 光力科技 | 8,900 | 203,454.00 | 0.26 |
| 154 | 688337 | 普源精电 | 3,367 | 202,895.42 | 0.26 |
| 155 | 000719 | 中原传媒 | 17,300 | 202,410.00 | 0.26 |
| 156 | 603986 | 兆易创新 | 1,900 | 201,875.00 | 0.26 |
| 157 | 688223 | 晶科能源 | 14,270 | 200,636.20 | 0.25 |
| 158 | 300360 | 炬华科技 | 11,200 | 200,256.00 | 0.25 |
| 159 | 603507 | 振江股份 | 5,500 | 199,430.00 | 0.25 |
| 160 | 603179 | 新泉股份 | 4,500 | 197,505.00 | 0.25 |
| 161 | 300548 | 博创科技 | 5,700 | 196,365.00 | 0.25 |
| 162 | 688439 | 振华风光 | 1,769 | 194,271.58 | 0.25 |
| 163 | 601137 | 博威合金 | 12,400 | 192,944.00 | 0.24 |
| 164 | 688676 | 金盘科技 | 6,312 | 191,190.48 | 0.24 |
| 165 | 300724 | 捷佳伟创 | 1,700 | 190,995.00 | 0.24 |
| 166 | 688066 | 航天宏图 | 3,128 | 190,495.20 | 0.24 |
| 167 | 603197 | 保隆科技 | 3,500 | 189,875.00 | 0.24 |
| 168 | 688111 | 金山办公 | 400 | 188,888.00 | 0.24 |
| 169 | 688205 | 德科立 | 2,578 | 188,503.36 | 0.24 |
| 170 | 688002 | 睿创微纳 | 4,191 | 187,756.80 | 0.24 |
| 171 | 002850 | 科达利 | 1,400 | 185,150.00 | 0.24 |
| 172 | 000158 | 常山北明 | 22,800 | 184,452.00 | 0.23 |
| 173 | 688297 | 中无人机 | 3,590 | 184,131.10 | 0.23 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 174 | 301191 | 菲菱科思 | 1,760 | 182,019.20 | 0.23 |
| 175 | 688609 | 九联科技 | 14,893 | 177,226.70 | 0.22 |
| 176 | 688279 | 峰岷科技 | 1,342 | 177,144.00 | 0.22 |
| 177 | 688659 | 元琛科技 | 10,461 | 177,104.73 | 0.22 |
| 178 | 002384 | 东山精密 | 6,800 | 176,120.00 | 0.22 |
| 179 | 688508 | 芯朋微 | 3,009 | 174,491.91 | 0.22 |
| 180 | 300129 | 泰胜风能 | 18,000 | 172,620.00 | 0.22 |
| 181 | 688361 | 中科飞测 | 2,078 | 172,494.78 | 0.22 |
| 182 | 300395 | 菲利华 | 3,500 | 172,200.00 | 0.22 |
| 183 | 002396 | 星网锐捷 | 7,600 | 171,684.00 | 0.22 |
| 184 | 300634 | 彩讯股份 | 6,500 | 171,600.00 | 0.22 |
| 185 | 002698 | 博实股份 | 9,800 | 171,402.00 | 0.22 |
| 186 | 300296 | 利亚德 | 26,200 | 171,086.00 | 0.22 |
| 187 | 300474 | 景嘉微 | 1,900 | 170,981.00 | 0.22 |
| 188 | 002747 | 埃斯顿 | 6,100 | 170,800.00 | 0.22 |
| 189 | 688601 | 力芯微 | 3,610 | 170,031.00 | 0.22 |
| 190 | 603893 | 瑞芯微 | 2,300 | 167,555.00 | 0.21 |
| 191 | 002334 | 英威腾 | 13,100 | 166,894.00 | 0.21 |
| 192 | 688381 | 帝奥微 | 5,150 | 166,242.00 | 0.21 |
| 193 | 688326 | 经纬恒润 | 1,136 | 164,027.04 | 0.21 |
| 194 | 688498 | 源杰科技 | 572 | 163,020.00 | 0.21 |
| 195 | 301031 | 中熔电气 | 1,200 | 162,852.00 | 0.21 |
| 196 | 688510 | 航亚科技 | 8,172 | 162,541.08 | 0.21 |
| 197 | 688053 | 思科瑞 | 2,596 | 161,315.44 | 0.20 |
| 198 | 688486 | 龙迅股份 | 1,451 | 159,682.55 | 0.20 |
| 199 | 688320 | 禾川科技 | 3,304 | 159,318.88 | 0.20 |
| 200 | 002156 | 通富微电 | 7,000 | 158,200.00 | 0.20 |
| 201 | 300811 | 铂科新材 | 2,660 | 158,110.40 | 0.20 |
| 202 | 003021 | 兆威机电 | 1,800 | 157,914.00 | 0.20 |
| 203 | 603000 | 人民网 | 5,400 | 157,680.00 | 0.20 |
| 204 | 603035 | 常熟汽饰 | 8,100 | 157,383.00 | 0.20 |
| 205 | 601928 | 凤凰传媒 | 13,800 | 157,320.00 | 0.20 |
| 206 | 688147 | 微导纳米 | 2,977 | 157,126.06 | 0.20 |
| 207 | 002896 | 中大力德 | 3,400 | 156,978.00 | 0.20 |
| 208 | 688401 | 路维光电 | 4,174 | 156,691.96 | 0.20 |
| 209 | 600986 | 浙文互联 | 24,300 | 155,520.00 | 0.20 |
| 210 | 301398 | 星源卓镁 | 4,100 | 153,750.00 | 0.20 |
| 211 | 603730 | 岱美股份 | 9,690 | 153,102.00 | 0.19 |
| 212 | 688630 | 芯碁微装 | 1,809 | 151,992.18 | 0.19 |
| 213 | 603596 | 伯特利 | 1,900 | 150,594.00 | 0.19 |
| 214 | 603628 | 清源股份 | 9,500 | 150,385.00 | 0.19 |
| 215 | 688006 | 杭可科技 | 4,900 | 149,303.00 | 0.19 |
| 216 | 000831 | 中国稀土 | 5,000 | 148,000.00 | 0.19 |
| 217 | 300827 | 上能电气 | 4,089 | 147,408.45 | 0.19 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 218 | 600760 | 中航沈飞 | 3,220 | 144,900.00 | 0.18 |
| 219 | 688248 | 南网科技 | 3,755 | 144,154.45 | 0.18 |
| 220 | 002599 | 盛通股份 | 15,900 | 143,895.00 | 0.18 |
| 221 | 688232 | 新点软件 | 2,667 | 143,511.27 | 0.18 |
| 222 | 688608 | 恒玄科技 | 1,180 | 142,815.40 | 0.18 |
| 223 | 002472 | 双环传动 | 3,900 | 141,570.00 | 0.18 |
| 224 | 301255 | 通力科技 | 3,100 | 140,895.00 | 0.18 |
| 225 | 688010 | 福光股份 | 5,715 | 139,446.00 | 0.18 |
| 226 | 688283 | 坤恒顺维 | 2,092 | 139,159.84 | 0.18 |
| 227 | 688376 | 美埃科技 | 3,512 | 138,688.88 | 0.18 |
| 228 | 000837 | 秦川机床 | 8,500 | 138,380.00 | 0.18 |
| 229 | 600237 | 铜峰电子 | 16,800 | 138,264.00 | 0.18 |
| 230 | 301339 | 通行宝 | 5,500 | 138,215.00 | 0.18 |
| 231 | 688579 | 山大地纬 | 8,384 | 138,168.32 | 0.18 |
| 232 | 688333 | 铂力特 | 1,304 | 137,884.96 | 0.18 |
| 233 | 688088 | 虹软科技 | 3,223 | 137,783.25 | 0.17 |
| 234 | 688270 | 臻镭科技 | 2,118 | 137,521.74 | 0.17 |
| 235 | 601900 | 南方传媒 | 6,700 | 137,417.00 | 0.17 |
| 236 | 688141 | 杰华特 | 3,514 | 137,397.40 | 0.17 |
| 237 | 002281 | 光迅科技 | 3,700 | 137,233.00 | 0.17 |
| 238 | 300549 | 优德精密 | 4,900 | 137,200.00 | 0.17 |
| 239 | 002553 | 南方精工 | 6,900 | 137,172.00 | 0.17 |
| 240 | 600366 | 宁波韵升 | 15,400 | 136,598.00 | 0.17 |
| 241 | 688475 | 萤石网络 | 3,187 | 136,594.82 | 0.17 |
| 242 | 002236 | 大华股份 | 6,900 | 136,275.00 | 0.17 |
| 243 | 002908 | 德生科技 | 8,800 | 136,136.00 | 0.17 |
| 244 | 002518 | 科士达 | 3,400 | 136,034.00 | 0.17 |
| 245 | 000534 | 万泽股份 | 8,100 | 135,837.00 | 0.17 |
| 246 | 603533 | 掌阅科技 | 4,900 | 135,828.00 | 0.17 |
| 247 | 002407 | 多氟多 | 6,800 | 135,048.00 | 0.17 |
| 248 | 300598 | 诚迈科技 | 2,900 | 133,893.00 | 0.17 |
| 249 | 300161 | 华中数控 | 2,500 | 133,800.00 | 0.17 |
| 250 | 300880 | 迦南智能 | 5,200 | 132,704.00 | 0.17 |
| 251 | 603758 | 秦安股份 | 12,400 | 131,936.00 | 0.17 |
| 252 | 688112 | 鼎阳科技 | 2,493 | 131,580.54 | 0.17 |
| 253 | 601138 | 工业富联 | 5,200 | 131,040.00 | 0.17 |
| 254 | 688186 | 广大特材 | 4,009 | 130,412.77 | 0.17 |
| 255 | 688503 | 聚和材料 | 1,321 | 128,797.50 | 0.16 |
| 256 | 601989 | 中国重工 | 26,500 | 127,730.00 | 0.16 |
| 257 | 002709 | 天赐材料 | 3,100 | 127,689.00 | 0.16 |
| 258 | 300996 | 普联软件 | 4,100 | 125,870.00 | 0.16 |
| 259 | 002335 | 科华数据 | 3,500 | 125,825.00 | 0.16 |
| 260 | 603396 | 金辰股份 | 1,900 | 124,640.00 | 0.16 |
| 261 | 002149 | 西部材料 | 7,400 | 124,246.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 262 | 601799 | 星宇股份 | 1,000 | 123,600.00 | 0.16 |
| 263 | 301221 | 光庭信息 | 2,200 | 122,826.00 | 0.16 |
| 264 | 300502 | 新易盛 | 1,800 | 122,346.00 | 0.16 |
| 265 | 300124 | 汇川技术 | 1,900 | 121,999.00 | 0.15 |
| 266 | 600150 | 中国船舶 | 3,700 | 121,767.00 | 0.15 |
| 267 | 002025 | 航天电器 | 1,900 | 121,220.00 | 0.15 |
| 268 | 300286 | 安科瑞 | 3,200 | 121,152.00 | 0.15 |
| 269 | 300403 | 汉宇集团 | 10,900 | 119,791.00 | 0.15 |
| 270 | 301155 | 海力风电 | 1,553 | 119,705.24 | 0.15 |
| 271 | 603606 | 东方电缆 | 2,400 | 117,672.00 | 0.15 |
| 272 | 301165 | 锐捷网络 | 1,900 | 117,268.00 | 0.15 |
| 273 | 300418 | 昆仑万维 | 2,900 | 116,812.00 | 0.15 |
| 274 | 688409 | 富创精密 | 1,071 | 116,739.00 | 0.15 |
| 275 | 688058 | 宝兰德 | 2,042 | 116,373.58 | 0.15 |
| 276 | 002045 | 国光电器 | 7,200 | 115,632.00 | 0.15 |
| 277 | 002270 | 华明装备 | 10,500 | 114,975.00 | 0.15 |
| 278 | 300882 | 万胜智能 | 4,000 | 113,520.00 | 0.14 |
| 279 | 688313 | 仕佳光子 | 6,441 | 113,039.55 | 0.14 |
| 280 | 001311 | 多利科技 | 1,930 | 110,839.90 | 0.14 |
| 281 | 300620 | 光库科技 | 1,800 | 110,304.00 | 0.14 |
| 282 | 300527 | 中船应急 | 11,600 | 110,200.00 | 0.14 |
| 283 | 605128 | 上海沿浦 | 2,700 | 109,377.00 | 0.14 |
| 284 | 002185 | 华天科技 | 11,800 | 108,560.00 | 0.14 |
| 285 | 300672 | 国科微 | 1,300 | 108,355.00 | 0.14 |
| 286 | 600685 | 中船防务 | 3,600 | 107,820.00 | 0.14 |
| 287 | 688045 | 必易微 | 1,877 | 106,989.00 | 0.14 |
| 288 | 301179 | 泽宇智能 | 3,160 | 106,492.00 | 0.14 |
| 289 | 600481 | 双良节能 | 7,500 | 104,850.00 | 0.13 |
| 290 | 300559 | 佳发教育 | 6,300 | 103,950.00 | 0.13 |
| 291 | 301369 | 联动科技 | 1,300 | 103,610.00 | 0.13 |
| 292 | 603005 | 晶方科技 | 5,100 | 103,020.00 | 0.13 |
| 293 | 300443 | 金雷股份 | 2,900 | 102,805.00 | 0.13 |
| 294 | 300319 | 麦捷科技 | 12,000 | 102,720.00 | 0.13 |
| 295 | 600487 | 亨通光电 | 6,980 | 102,326.80 | 0.13 |
| 296 | 688035 | 德邦科技 | 1,717 | 102,127.16 | 0.13 |
| 297 | 300803 | 指南针 | 2,100 | 102,039.00 | 0.13 |
| 298 | 600522 | 中天科技 | 6,400 | 101,824.00 | 0.13 |
| 299 | 603786 | 科博达 | 1,500 | 98,550.00 | 0.13 |
| 300 | 605123 | 派克新材 | 900 | 97,785.00 | 0.12 |
| 301 | 603191 | 望变电气 | 5,000 | 97,250.00 | 0.12 |
| 302 | 300394 | 天孚通信 | 900 | 96,147.00 | 0.12 |
| 303 | 002389 | 航天彩虹 | 4,300 | 95,503.00 | 0.12 |
| 304 | 300217 | 东方电热 | 16,000 | 93,760.00 | 0.12 |
| 305 | 002351 | 漫步者 | 4,500 | 93,060.00 | 0.12 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 306 | 002536 | 飞龙股份 | 6,200 | 93,000.00 | 0.12 |
| 307 | 002517 | 恺英网络 | 5,900 | 92,866.00 | 0.12 |
| 308 | 300775 | 三角防务 | 2,700 | 91,206.00 | 0.12 |
| 309 | 301153 | 中科江南 | 1,200 | 89,952.00 | 0.11 |
| 310 | 600100 | 同方股份 | 11,000 | 89,320.00 | 0.11 |
| 311 | 603556 | 海兴电力 | 3,400 | 85,816.00 | 0.11 |
| 312 | 000032 | 深桑达 A | 2,600 | 85,540.00 | 0.11 |
| 313 | 688207 | 格灵深瞳 | 3,421 | 85,182.90 | 0.11 |
| 314 | 300592 | 华凯易佰 | 3,000 | 81,660.00 | 0.10 |
| 315 | 001270 | 铖昌科技 | 880 | 76,824.00 | 0.10 |
| 316 | 603258 | 电魂网络 | 1,800 | 76,518.00 | 0.10 |
| 317 | 300299 | 富春股份 | 9,700 | 76,048.00 | 0.10 |
| 318 | 002558 | 巨人网络 | 4,100 | 73,513.00 | 0.09 |
| 319 | 600764 | 中国海防 | 2,700 | 73,494.00 | 0.09 |
| 320 | 688682 | 霍莱沃 | 837 | 70,090.38 | 0.09 |
| 321 | 002735 | 王子新材 | 4,920 | 68,634.00 | 0.09 |
| 322 | 002531 | 天顺风能 | 4,500 | 68,535.00 | 0.09 |
| 323 | 002487 | 大金重工 | 2,200 | 67,848.00 | 0.09 |
| 324 | 300570 | 太辰光 | 1,200 | 65,652.00 | 0.08 |
| 325 | 688728 | 格科微 | 4,042 | 63,944.44 | 0.08 |
| 326 | 000682 | 东方电子 | 6,400 | 62,208.00 | 0.08 |
| 327 | 300855 | 图南股份 | 1,360 | 48,035.20 | 0.06 |
| 328 | 002870 | 香山股份 | 1,400 | 46,438.00 | 0.06 |
| 329 | 603888 | 新华网 | 1,200 | 39,384.00 | 0.05 |
| 330 | 300337 | 银邦股份 | 5,900 | 39,353.00 | 0.05 |
| 331 | 688596 | 正帆科技 | 891 | 38,580.30 | 0.05 |
| 332 | 601890 | 亚星锚链 | 3,000 | 34,740.00 | 0.04 |
| 333 | 603206 | 嘉环科技 | 2,000 | 34,500.00 | 0.04 |
| 334 | 301307 | 美利信 | 800 | 27,048.00 | 0.03 |
| 335 | 603083 | 剑桥科技 | 400 | 25,156.00 | 0.03 |
| 336 | 300002 | 神州泰岳 | 1,500 | 21,000.00 | 0.03 |
| 337 | 000887 | 中鼎股份 | 1,100 | 14,399.00 | 0.02 |
| 338 | 600105 | 永鼎股份 | 1,600 | 11,920.00 | 0.02 |
| 339 | 300058 | 蓝色光标 | 1,200 | 11,604.00 | 0.01 |
| 340 | 688472 | 阿特斯 | 500 | 9,180.00 | 0.01 |
| 341 | 000063 | 中兴通讯 | 200 | 9,108.00 | 0.01 |
| 342 | 002902 | 铭普光磁 | 200 | 6,262.00 | 0.01 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 002897 | 意华股份 | 2,080,420.00 | 2.30 |
| 2 | 688032 | 禾迈股份 | 1,477,127.81 | 1.63 |
| 3 | 002738 | 中矿资源 | 1,452,118.00 | 1.60 |
| 4 | 002056 | 横店东磁 | 1,301,403.00 | 1.44 |
| 5 | 002756 | 永兴材料 | 1,244,007.00 | 1.37 |
| 6 | 688348 | 昱能科技 | 1,146,603.57 | 1.27 |
| 7 | 002192 | 融捷股份 | 1,143,705.00 | 1.26 |
| 8 | 600563 | 法拉电子 | 1,090,733.00 | 1.20 |
| 9 | 002484 | 江海股份 | 988,272.00 | 1.09 |
| 10 | 688006 | 杭可科技 | 950,764.52 | 1.05 |
| 11 | 605117 | 德业股份 | 889,766.00 | 0.98 |
| 12 | 688082 | 盛美上海 | 863,619.05 | 0.95 |
| 13 | 003022 | 联泓新科 | 848,227.00 | 0.94 |
| 14 | 301268 | 铭利达 | 832,047.00 | 0.92 |
| 15 | 688099 | 晶晨股份 | 789,043.11 | 0.87 |
| 16 | 300118 | 东方日升 | 782,634.00 | 0.86 |
| 17 | 002436 | 兴森科技 | 768,964.71 | 0.85 |
| 18 | 300613 | 富瀚微 | 765,244.00 | 0.85 |
| 19 | 002885 | 京泉华 | 748,685.00 | 0.83 |
| 20 | 300458 | 全志科技 | 736,971.00 | 0.81 |

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 002897 | 意华股份 | 1,707,876.00 | 1.89 |
| 2 | 605117 | 德业股份 | 1,510,055.00 | 1.67 |
| 3 | 002324 | 普利特 | 1,483,642.00 | 1.64 |
| 4 | 600487 | 亨通光电 | 1,367,422.00 | 1.51 |
| 5 | 301268 | 铭利达 | 1,360,533.53 | 1.50 |
| 6 | 688032 | 禾迈股份 | 1,106,851.82 | 1.22 |
| 7 | 600563 | 法拉电子 | 1,029,726.00 | 1.14 |
| 8 | 600732 | 爱旭股份 | 951,550.00 | 1.05 |
| 9 | 002484 | 江海股份 | 941,434.00 | 1.04 |
| 10 | 002756 | 永兴材料 | 926,544.00 | 1.02 |
| 11 | 002459 | 晶澳科技 | 926,209.00 | 1.02 |
| 12 | 002056 | 横店东磁 | 904,484.00 | 1.00 |
| 13 | 300499 | 高澜股份 | 892,995.74 | 0.99 |
| 14 | 002518 | 科士达 | 887,630.00 | 0.98 |
| 15 | 300693 | 盛弘股份 | 871,265.55 | 0.96 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 16 | 002738 | 中矿资源 | 863,954.00 | 0.95 |
| 17 | 300382 | 斯莱克 | 841,869.00 | 0.93 |
| 18 | 600522 | 中天科技 | 841,099.00 | 0.93 |
| 19 | 688112 | 鼎阳科技 | 827,645.30 | 0.91 |
| 20 | 688682 | 霍莱沃 | 804,907.55 | 0.89 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 161,025,959.28 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 166,372,084.34 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 48,207.39 | 0.06 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 48,207.39 | 0.06 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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 | 118034 | 晶能转债 | 380 | 48,207.39 | 0.06 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,沈阳芯源微电子设备股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到沈阳市城乡建设局的处罚。

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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 8,719.63 |
| 2 | 应收清算款 | 357,280.09 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,520.78 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 369,520.50 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

| 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 |
| 易方达易百智能量化策略混合 A | 1,015 | 60,566.06 | 23,782,305.37 | 38.69% | 37,692,250.19 | 61.31% |
| 易方达易百智能 | 631 | 13,482.91 | 0.00 | 0.00% | 8,507,716.72 | 100.00% |

| | | | | | | |
|----------|-------|-----------|---------------|--------|---------------|--------|
| 量化策略混合 C | | | | | | % |
| 合计 | 1,646 | 42,516.57 | 23,782,305.37 | 33.98% | 46,199,966.91 | 66.02% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 易方达易百智能量化策略混合 A | 1,664,510.79 | 2.7076% |
| | 易方达易百智能量化策略混合 C | 1.00 | 0.0000% |
| | 合计 | 1,664,511.79 | 2.3785% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-----------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 易方达易百智能量化策略混合 A | 0 |
| | 易方达易百智能量化策略混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 易方达易百智能量化策略混合 A | >100 |
| | 易方达易百智能量化策略混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 易方达易百智能量化策略混合 A | 易方达易百智能量化策略混合 C |
|--------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日（2018 年 1 月 24 日）基金份额总额 | 785,605,733.86 | 9,148,962.61 |
| 本报告期初基金份额总额 | 62,506,247.60 | 12,036,600.01 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,558,978.32 | 2,984,264.05 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,590,670.36 | 6,513,147.34 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 61,474,555.56 | 8,507,716.72 |

§ 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 | |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 5 | - | - | - | - | - |
| 高盛高华 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国新证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 2 | 327,077,065.09 | 100.00% | - | - | - |
| 华福证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中金财富 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高盛高华 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|-----------|---------|---|---|---|---|
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国新证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 14,692.92 | 100.00% | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|-------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 1 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证券报 | 2023-01-20 |
| 2 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告 | 中国证券报 | 2023-03-30 |
| 3 | 易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-31 |
| 4 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证券报 | 2023-04-21 |
| 5 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金 | 2023-04-22 |

| | | |
|--|--------|--|
| | 电子披露网站 | |
|--|--------|--|

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 | 2023年01月01日~2023年06月30日 | 23,782,305.37 | 0.00 | 0.00 | 23,782,305.37 | 33.98% |
| 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部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，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出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；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> | | | | | | | |

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日