

易方达安盈回报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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产（基金净值）变动表	18
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	45
7.1	期末基金资产组合情况	45
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	52
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	52
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	52
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52

7.12	投资组合报告附注.....	52
§ 8	基金份额持有人信息.....	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
§ 9	开放式基金份额变动.....	55
§ 10	重大事件揭示.....	56
10.1	基金份额持有人大会决议.....	56
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4	基金投资策略的改变.....	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8	其他重大事件.....	59
§ 11	备查文件目录.....	60
11.1	备查文件目录.....	60
11.2	存放地点.....	60
11.3	查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达安盈回报混合型证券投资基金	
基金简称	易方达安盈回报混合	
基金主代码	001603	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 2 月 16 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,084,993,760.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C
下属分级基金的交易代码	001603	017414
报告期末下属分级基金的份额总额	1,083,097,554.55 份	1,896,206.01 份

注：自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、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。2、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。3、本基金将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。4、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×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
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	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	王玉	秦一楠
	联系电话	020-85102688	010-66060069
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95599
传真		020-38798812	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市东城区建国门内大街69 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28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		510620	100031
法定代表人		刘晓艳	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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）	
	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C
本期已实现收益	-70,944,192.64	-54,958.26
本期利润	-64,091,625.87	-197,131.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0567	-0.1478
本期加权平均净值利润率	-2.59%	-6.91%

本期基金份额净值增长率	-2.82%	-5.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C
期末可供分配利润	473,144,481.95	823,534.63
期末可供分配基金份额利润	0.4368	0.4343
期末基金资产净值	2,279,331,537.95	3,985,795.44
期末基金份额净值	2.104	2.102
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C
基金份额累计净值增长率	127.60%	-5.44%

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 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 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

易方达安盈回报混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.81%	0.49%	0.60%	0.21%	0.21%	0.28%
过去三个月	-4.01%	0.58%	-0.12%	0.20%	-3.89%	0.38%
过去六个月	-2.82%	0.56%	1.73%	0.21%	-4.55%	0.35%
过去一年	-9.19%	0.58%	-0.79%	0.24%	-8.40%	0.34%
过去三年	33.49%	0.95%	7.30%	0.30%	26.19%	0.65%
自基金合同生效起至今	127.60%	0.98%	27.23%	0.29%	100.37%	0.69%

易方达安盈回报混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.82%	0.49%	0.60%	0.21%	0.22%	0.28%
过去三个月	-4.06%	0.58%	-0.12%	0.20%	-3.94%	0.38%
过去六个月	-	-	-	-	-	-

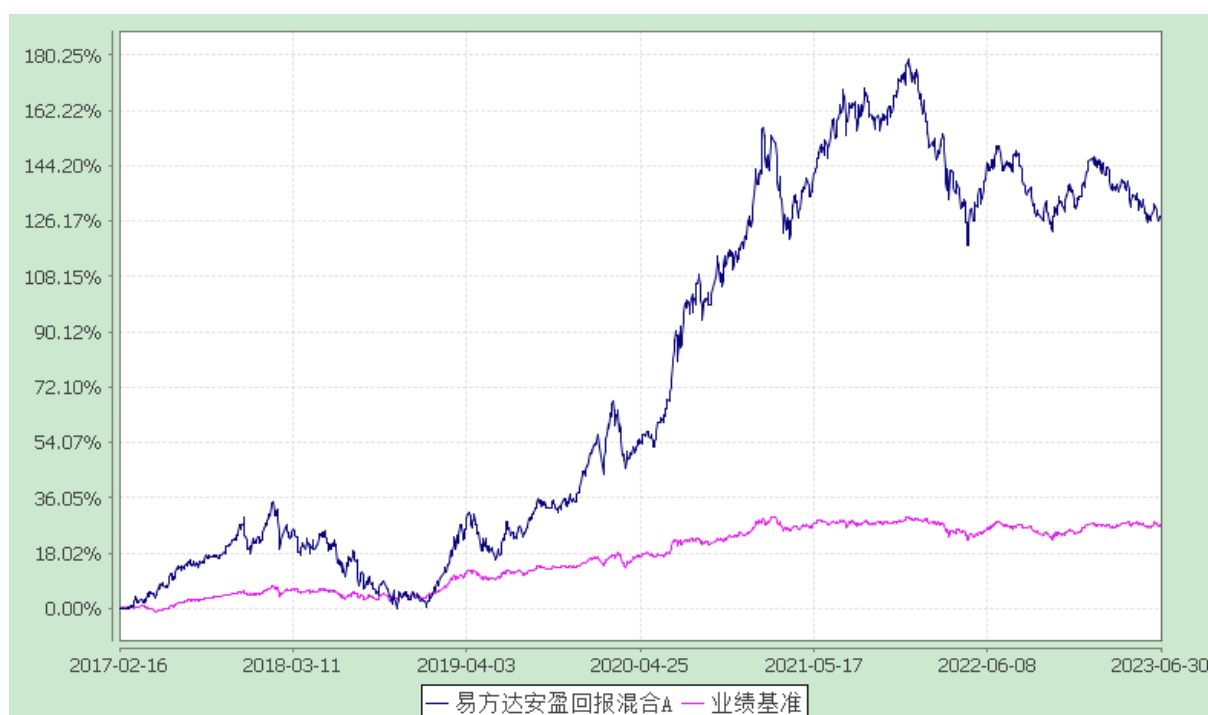
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-5.44%	0.55%	0.19%	0.20%	-5.63%	0.35%

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

易方达安盈回报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

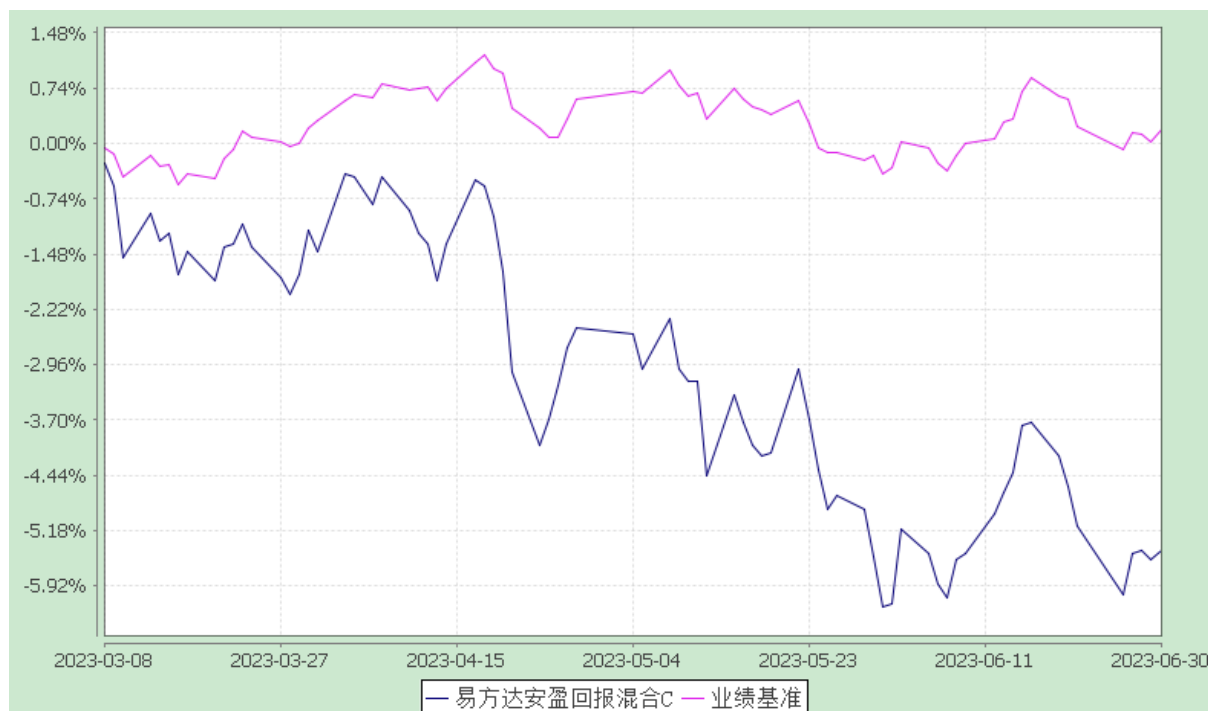
易方达安盈回报混合 A

(2017 年 2 月 16 日至 2023 年 6 月 30 日)



易方达安盈回报混合 C

(2023 年 3 月 8 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：1.自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 127.60%，同期业绩比较基准收益率为 27.23%；C 类基金份额净值增长率为-5.44%，同期业绩比较基准收益率为 0.19%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张	本基金的基金经理，易方达安心回	2017-	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾

清华	报债券、易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达新收益混合、易方达悦兴一年持有混合的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员	02-16			任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经理、固定收益基金投资部总经理、混合资产投资部总经理、多资产投资业务总部总经理，易方达裕如混合、易方达新收益混合、易方达安心回馈混合、易方达瑞选混合、易方达裕祥回报债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达裕鑫债券、易方达瑞通混合、易方达瑞程混合、易方达瑞弘混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达鑫转添利混合、易方达鑫转增利混合、易方达鑫转招利混合、易方达丰华债券、易方达磐固六个月持有混合的基金经理。
杨康	本基金的基金经理助理，易方达鑫转增利混合、易方达鑫转招利混合（自 2020 年 03 月 07 日至 2023 年 06 月 27 日）、易方达瑞安混合发起式（自 2021 年 01 月 08 日至 2023 年 06 月 27 日）、易方达瑞康混合（自 2021 年 02 月 02 日至 2023 年 06 月 27 日）、易方达裕富债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新益混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞信混合、易方达瑞选混合、易方达瑞和混合、易方达瑞富混合、易方达瑞祺混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达丰惠混合、易方达裕鑫债券、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达鑫转添利混合、易方达瑞川混合发起式、易方达瑞锦混合发起式的基金经理，易方达丰华债券（自 2019 年 06 月 19 日至 2023 年 03 月 02 日）、易方达安心回报债券、易方达裕丰回报债券（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 02 月 23 日）、易方达丰和债券（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 02 月 23 日）、易方达磐恒九个月持有混合（自 2022 年 07 月 09 日至 2023 年 06 月 19 日）、易方达招	2019-06-10	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部研究员、投资经理助理，易方达基金管理有限公司投资经理，易方达瑞川混合发起式、易方达瑞锦混合发起式的基金经理。

	易一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达悦安一年持有债券（自 2022 年 07 月 09 日至 2023 年 06 月 19 日）、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合、易方达悦浦一年持有混合的基金经理助理				
周琼	本基金的基金经理助理，易方达鑫转添利混合、易方达鑫转招利混合、易方达裕丰回报债券、易方达丰华债券、易方达新收益混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达丰和债券、易方达裕鑫债券、易方达鑫转增利混合、易方达安心回报债券、易方达纯债债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新益混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞选混合、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、易方达裕富债券、易方达瑞川混合发起式、易方达丰惠混合、易方达招易一年持有混合、易方达瑞锦混合发起式、易方达磐恒九个月持有混合、易方达磐泰一年持有混合、易方达磐固六个月持有混合、易方达悦享一年持有混合、易方达悦兴一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达瑞富混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦浦一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦稳一年持有混合、易方达安心回馈混合、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理助理	2019-10-11	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任凯仁投资咨询（上海）有限公司客户经理，易方达基金管理有限公司投资支持专员、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

2023 年上半年中国经济增长整体呈现冲高回落的走势，一季度冲高、二季度回落。年初在疫后服务业重启、中长期信贷资金对投资拉动、出口补偿性修复这三大力量的驱动下，经济呈现一轮快速修复。一季度经济形势超预期的表现，使得二季度政策开始退坡，财政政策退坡带来基建投资在

4 月明显下滑；进入二季度，出口份额回补也基本结束、外需再次承压；5 月服务业价格的回落显示疫后服务业修复带来的劳动力需求回升过程已经基本结束、居民内生消费意愿疲弱。前期对经济正向拉动的因素开始发生逆转，预期的转弱也带来了企业的去库存行为，这也加剧了生产的回落。CPI（消费者物价指数）和 PPI（生产者价格指数）等价格数据的持续回落反应需求的不足，表明实际的经济增速可能处于潜在增速的下方，在此背景下，6 月开始，货币、地产等稳增长政策陆续出台。海外方面，即使加息环境诱发了中小银行风险事件等问题，但美国经济增长的韧性却显著超出预期，美联储和市场似乎正在逐步接受通胀问题的长期化，美国经济逐步走向高通胀与经济复苏共存的宏观情景。

权益市场方面，市场整体跟随宏观经济节奏波动，1 月在经济动能强劲的背景下快速冲高而后盘整、4 月底在经济数据全面下滑后震荡走弱。6 月以来，市场交易围绕政策预期展开，整体呈现低位徘徊。上半年市场呈现存量资金博弈的特征，市场结构分化，AIGC（生成式人工智能）催化下的 TMT（数字新媒体，下同）行业与“中特估”是上半年相对亮眼的两个板块。

转债市场年初经历估值快速提升后维持在高位震荡，并延续至半年末。一季度正股的较好表现推升了转债估值，二季度则更多受到债市上涨和流动性环境宽松的提振。结构方面，一季度小盘股相对活跃，二季度银行、非银、公用事业等权重转债受益于中特估行情催化，阶段性表现较好，支撑转债指数表现强于同期权益指数。

回顾上半年组合操作，宏观环境的复杂多变对资产配置的对调整提出了较高的要求，组合上半年表现不佳，对于疫后经济修复的乐观预期使得组合年初高配了股票和转债，二季度经济指标下滑的幅度和速度都超出了我们的预判，市场快速下行后，担忧预期也得到了充分的释放，股票市场整体估值较低，很多优质公司也具备了较好的长期配置价值，因此组合选择了优化持仓结构的方式来应对，保留了较高的权益仓位，适当减仓了阶段性反弹的 TMT 等成长行业，加仓估值合理的银行、基础化工与机械设备等行业，面对新的市场环境，优化与平衡组合资产配置，提高组合的灵活性。转债投资上，一季度组合保持较高仓位，二季度有所降低，结构上提升了平衡型转债的占比，减仓超大盘转债，加仓小盘转债，增加了绝对价格在 130 元附近、溢价率较低转债的配置，同时积极换仓，用估值偏低的新券替换组合中性性价比偏低的老券，维持组合的整体弹性。

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 2.104 元，本报告期份额净值增长率为-2.82%，同期业绩比较基准收益率为 1.73%；C 类基金份额净值为 2.102 元，本报告期份额净值增长率为-5.44%，同期业绩比较基准收益率为 0.19%。

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，预计经济将呈现弱复苏的态势。目前决策层已经关注到经济内生需求不足的问题，政策的基调也开始转向稳增长，努力修复市场的信心。二季度大概率是全年经济增长环比的低点，经济继续下滑的风险较低，但考虑到目前的库存水平与产能状况，需求不足的问题依旧没有得到实质性解决，需求侧的现状很难支持经济的持续复苏。目前政策主要还停留在沟通与预期管理阶段，未来需要密切关注政策的实质性落地，政策落地的力度决定了下半年经济恢复的高度。

经济增长快速回落的阶段已经过去，叠加政策的转向，使得股票市场继续大幅下跌的风险较小，市场可能阶段性处于强预期与弱现实之间的徘徊震荡，预期的扰动会加大市场的波动，政策窗口期内也可能出现短期交易行情，但市场的整体好转需要看到基本面更明确的信号。考虑到目前市场的估值水平，股票投资上组合将维持目前较高的权益仓位，适当加大与总量经济相关性低的资产配置，优选商业模式清晰、资产负债表健康的公司跨越周期，在需求很难再大幅扩张的环境下，优选供给清晰的行业。转债投资上，在结构分化的市场环境下，转债期权价值的优势凸显，组合可积极把握一些高赔率结构性机会，如在平衡型转债中用量化精准定价寻找低估值个券、偏股型转债策略中关注正股弹性与条款博弈的机会等。组合将仍以股票和转债投资为主。

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

易方达安盈回报混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达安盈回报混合 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—易方达基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何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

本托管人认为,易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为，易方达基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：易方达安盈回报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	2,934,777.20	4,886,034.42
结算备付金		6,158,837.11	15,715,844.20
存出保证金		200,996.53	179,022.10
交易性金融资产	6.4.7.2	2,375,969,210.39	2,538,616,386.91
其中：股票投资		968,319,084.93	1,089,131,699.69
基金投资		-	-
债券投资		1,407,650,125.46	1,449,484,687.22
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		14,547,276.20	145,019.34
应收股利		-	-
应收申购款		827,737.48	2,348,183.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,400,638,834.91	2,561,890,490.80
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		96,971,384.55	-1,184.66
应付清算款		14,313,247.05	3,927,940.34
应付赎回款		3,060,113.85	9,376,631.56
应付管理人报酬		1,705,581.57	1,962,820.29
应付托管费		473,772.66	545,227.87
应付销售服务费		1,289.64	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		8,585.51	11,800.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	787,526.69	760,587.05
负债合计		117,321,501.52	16,583,822.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,084,993,760.56	1,175,731,739.54
未分配利润	6.4.7.8	1,198,323,572.83	1,369,574,928.70
净资产合计		2,283,317,333.39	2,545,306,668.24
负债和净资产总计		2,400,638,834.91	2,561,890,490.80

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.104 元，C 类基金份额净值 2.102 元；基金份额总额 1,084,993,760.56 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,083,097,554.55 份，C 类基金份额总额 1,896,206.01 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达安盈回报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		-49,567,852.22	-341,135,187.90
1.利息收入		187,750.38	415,285.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	55,679.16	116,901.58
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		132,071.22	298,384.20
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-56,748,811.67	-70,524,557.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-70,837,995.43	-141,014,774.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,182,153.76	61,278,206.45
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	11,907,030.00	9,212,010.65
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.15	6,710,393.32	-272,452,344.95

填列)			
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	282,815.75	1,426,428.68
减：二、营业总支出		14,720,905.36	18,722,118.92
1. 管理人报酬		11,065,684.56	13,900,596.05
2. 托管费		3,073,801.24	3,861,276.61
3. 销售服务费		3,674.08	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		422,729.32	793,059.64
其中：卖出回购金融资产支出		422,729.32	793,059.64
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		7,454.78	12,911.11
8. 其他费用	6.4.7.18	147,561.38	154,275.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-64,288,757.58	-359,857,306.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-64,288,757.58	-359,857,306.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-64,288,757.58	-359,857,306.82

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达安盈回报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）	1,175,731,739.54	1,369,574,928.70	2,545,306,668.24
二、本期期初净资产（基金净值）	1,175,731,739.54	1,369,574,928.70	2,545,306,668.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-90,737,978.98	-171,251,355.87	-261,989,334.85
（一）、综合收益总额	-	-64,288,757.58	-64,288,757.58
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	-90,737,978.98	-106,962,598.29	-197,700,577.27

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	78,738,109.27	95,178,049.04	173,916,158.31
2.基金赎回款	-169,476,088.25	-202,140,647.33	-371,616,735.58
(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)	1,084,993,760.56	1,198,323,572.83	2,283,317,333.39
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)	1,443,320,482.38	2,233,309,086.57	3,676,629,568.95
二、本期期初净资产(基金净值)	1,443,320,482.38	2,233,309,086.57	3,676,629,568.95
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-150,558,733.91	-530,357,890.75	-680,916,624.66
(一)、综合收益总额	-	-359,857,306.82	-359,857,306.82
(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)	-150,558,733.91	-170,500,583.93	-321,059,317.84
其中：1.基金申购款	322,704,968.28	420,732,889.42	743,437,857.70
2.基金赎回款	-473,263,702.19	-591,233,473.35	-1,064,497,175.54
(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)	1,292,761,748.47	1,702,951,195.82	2,995,712,944.29

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

易方达安盈回报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[2015]1333号《关于准予易方达安盈回报混合型证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2016]2955号《关于易方达安盈回报混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《易方达安盈回报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,《易方达安盈回报混合型证券投资基金基金合同》于2017年2月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为604,172,113.67份基金份额,其中认购资金利息折合184,238.52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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

自2023年3月7日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2023年3月8日。

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》《易方达安盈回报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。

6.4.4.1 基金的收益分配政策

(1)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；

(2)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。

(3)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；

(4)在遵守法律法规及监管部门规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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	2,934,777.20
等于: 本金	2,933,981.81
加: 应计利息	795.39
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	2,934,777.20

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	1,062,597,896.06	-	968,319,084.93	-94,278,811.13
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所		8,270,843.51		
	市场	1,269,481,020.09		1,285,182,728.20	7,430,864.60
	银行间		1,627,397.26		
	市场	120,854,473.85		122,467,397.26	-14,473.85
	合计	1,390,335,493.94	9,898,240.77	1,407,650,125.46	7,416,390.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,452,933,390.00	9,898,240.77	2,375,969,210.39	-86,862,420.38

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	1,822.70
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	336,608.05
其中：交易所市场	335,043.55
银行间市场	1,564.50
应付利息	-
预提费用	449,095.94
合计	787,526.69

6.4.7.7 实收基金

易方达安盈回报混合 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	1,175,731,739.54	1,175,731,739.54
本期申购	76,796,871.62	76,796,871.62
本期赎回（以“-”号填列）	-169,431,056.61	-169,431,056.61
本期末	1,083,097,554.55	1,083,097,554.55

易方达安盈回报混合 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
本期申购	1,941,237.65	1,941,237.65
本期赎回（以“-”号填列）	-45,031.64	-45,031.64
本期末	1,896,206.01	1,896,206.01

注：1.自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日。

2.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

易方达安盈回报混合 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	587,135,712.96	782,439,215.74	1,369,574,928.70
本期利润	-70,944,192.64	6,852,566.77	-64,091,625.87
本期基金份额交易产生的变动数	-43,047,038.37	-66,202,281.06	-109,249,319.43
其中：基金申购款	36,367,304.88	56,474,534.39	92,841,839.27
基金赎回款	-79,414,343.25	-122,676,815.45	-202,091,158.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	473,144,481.95	723,089,501.45	1,196,233,983.40

易方达安盈回报混合 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	-	-	-
本期利润	-54,958.26	-142,173.45	-197,131.71
本期基金份额交易产生的变动数	878,492.89	1,408,228.25	2,286,721.14
其中：基金申购款	897,969.57	1,438,240.20	2,336,209.77
基金赎回款	-19,476.68	-30,011.95	-49,488.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	823,534.63	1,266,054.80	2,089,589.43

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	13,129.67
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	41,057.23
其他	1,492.26
合计	55,679.16

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	-70,837,995.43
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	-70,837,995.43

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	370,860,546.21
减：卖出股票成本总额	440,746,777.96
减：交易费用	951,763.68
买卖股票差价收入	-70,837,995.43

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	8,492,958.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,310,804.56
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	2,182,153.76

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	791,557,615.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	790,863,120.08
减：应计利息总额	6,972,964.51
减：交易费用	32,335.79
买卖债券差价收入	-6,310,804.56

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	11,907,030.00
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	11,907,030.00

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	6,710,393.32
——股票投资	-19,408,924.62

——债券投资	26,119,317.94
——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	6,710,393.32

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	282,815.75
合计	282,815.75

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
银行汇划费	19,865.44
其他	600.00
合计	147,561.38

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
中国农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、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	11,065,684.56	13,900,596.05
其中：支付销售机构的客户维护费	2,738,618.27	3,163,352.03

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 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	3,073,801.24	3,861,276.61

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，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	3,400.08	3,400.08
合计	-	3,400.08	3,400.08
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		
	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 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，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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	
	易方达安盈回报混 合A	易方达安盈回报混 合C	易方达安盈回报混 合A	易方达安盈回报混 合C
报告期初持有的基金份额	97,617,727.45	-	97,617,727.45	-
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	97,617,727.45	-	97,617,727.45	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.0128%	-	7.5511%	-

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

易方达安盈回报混合 A

无。

易方达安盈回报混合 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
中国农业银行-活期存款	2,934,777.20	13,129.67	1,711,293.79	25,051.28

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国农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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

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

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

易方达安盈回报混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达安盈回报混合 C

本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月以内	新股流通	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-

				受限						
30120 2	朗威 股份	2023-0 6-28	6 个月	新股 流通 受限	25.82	25.82	306	7,900. 92	7,900. 92	-
30122 5	恒勃 股份	2023-0 6-08	6 个月	新股 流通 受限	35.66	33.26	333	11,874 .78	11,075 .58	-
30123 2	飞沃 科技	2023-0 6-08	6 个月	新股 流通 受限	72.50	58.42	165	11,962 .50	9,639. 30	-
30126 1	恒工 精密	2023-0 6-29	1 个月 以内	新股 流通 受限	36.90	36.90	1,775	65,497 .50	65,497 .50	-
30126 1	恒工 精密	2023-0 6-29	6 个月	新股 流通 受限	36.90	36.90	198	7,306. 20	7,306. 20	-
30126 2	海看 股份	2023-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	30.22	25.50	692	20,912 .24	17,646 .00	-
30128 1	科源 制药	2023-0 3-28	6 个月	新股 流通 受限	44.18	25.10	338	10,647 .38	8,483. 80	-
30129 1	明阳 电气	2023-0 6-21	6 个月	新股 流通 受限	38.13	31.03	1,206	45,984 .78	37,422 .18	-
30129 2	海科 新源	2023-0 6-29	1 个月 以内	新股 流通 受限	19.99	19.99	5,241	104,76 7.59	104,76 7.59	-
30129 2	海科 新源	2023-0 6-29	6 个月	新股 流通 受限	19.99	19.99	583	11,654 .17	11,654 .17	-
30129 3	三博 脑科	2023-0 4-25	6 个月	新股 流通 受限	29.60	71.42	333	9,856. 80	23,782 .86	-
30129 5	美硕 科技	2023-0 6-19	6 个月	新股 流通 受限	37.40	36.07	215	8,041. 00	7,755. 05	-
30130 1	川宁 生物	2022-1 2-20	6 个月	新股 流通 受限	5.00	8.96	3,574	17,870 .00	32,023 .04	-
30130 5	朗坤 环境	2023-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	25.25	19.69	753	19,013 .25	14,826 .57	-
30130	美利	2023-0	6 个月	新股	32.34	31.86	687	22,217	21,887	-

7	信	4-14		流通受限				.58	.82	
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	新股流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-

30139 9	英特 科技	2023-0 5-16	6 个月	新股 流通 受限	43.99	51.57	293	12,889 .07	15,110 .01	-
30140 8	华人 健康	2023-0 2-22	6 个月	新股 流通 受限	16.24	16.95	879	14,274 .96	14,899 .05	-
30141 9	阿莱 德	2023-0 2-02	6 个月	新股 流通 受限	24.80	43.85	330	8,184. 00	14,470 .50	-
30142 8	世纪 恒通	2023-0 5-10	6 个月	新股 流通 受限	26.35	30.60	229	6,034. 15	7,007. 40	-
30143 9	泓淋 电力	2023-0 3-10	6 个月	新股 流通 受限	19.99	16.90	949	18,970 .51	16,038 .10	-
30148 6	致尚 科技	2023-0 6-30	1 个月 以内	新股 流通 受限	57.66	57.66	4,338	250,12 9.08	250,12 9.08	-
30148 6	致尚 科技	2023-0 6-30	6 个月	新股 流通 受限	57.66	57.66	482	27,792 .12	27,792 .12	-
30148 8	豪恩 汽电	2023-0 6-26	1 个月 以内	新股 流通 受限	39.78	39.78	2,356	93,721 .68	93,721 .68	-
30148 8	豪恩 汽电	2023-0 6-26	6 个月	新股 流通 受限	39.78	39.78	262	10,422 .36	10,422 .36	-
60106 1	中信 金属	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	6.58	7.58	4,016	26,425 .28	30,441 .28	-
60106 5	江盐 集团	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	10.36	11.84	875	9,065. 00	10,360 .00	-
60113 3	柏诚 股份	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	11.66	12.26	664	7,742. 24	8,140. 64	-
60312 5	常青 科技	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	25.98	24.53	160	4,156. 80	3,924. 80	-
60313 5	中重 科技	2023-0 3-29	6 个月	新股 流通 受限	17.80	17.89	628	11,178 .40	11,234 .92	-
60313 7	恒尚 节能	2023-0 4-10	6 个月	新股 流通	15.90	17.09	139	2,210. 10	2,375. 51	-

				受限						
60317 2	万丰 股份	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	14.58	16.13	122	1,778. 76	1,967. 86	-
68814 6	中船 特气	2023-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	36.15	38.13	1,011	36,547 .65	38,549 .43	-
68824 9	晶合 集成	2023-0 4-24	6 个月	新股 流通 受限	19.86	18.06	7,405	147,06 3.30	133,73 4.30	-
68833 4	西高 院	2023-0 6-09	6 个月	新股 流通 受限	14.16	16.21	888	12,574 .08	14,394 .48	-
68835 2	颀中 科技	2023-0 4-11	6 个月	新股 流通 受限	12.10	12.07	2,361	28,568 .10	28,497 .27	-
68836 1	中科 飞测	2023-0 5-12	6 个月	新股 流通 受限	23.60	64.67	831	19,611 .60	53,740 .77	-
68842 9	时创 能源	2023-0 6-20	6 个月	新股 流通 受限	19.20	25.53	346	6,643. 20	8,833. 38	-
68843 3	华曙 高科	2023-0 4-07	6 个月	新股 流通 受限	26.66	31.50	418	11,143 .88	13,167 .00	-
68844 3	智翔 金泰	2023-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	37.88	29.49	3,033	114,89 0.04	89,443 .17	-
68846 9	中芯 集成	2023-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	5.69	5.41	13,800	78,522 .00	74,658 .00	-
68847 2	阿特 斯	2023-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	11.10	17.04	6,261	69,497 .10	106,68 7.44	-
68847 8	晶升 股份	2023-0 4-13	6 个月	新股 流通 受限	32.52	42.37	402	13,073 .04	17,032 .74	-
68847 9	友车 科技	2023-0 5-04	6 个月	新股 流通 受限	33.99	29.49	332	11,284 .68	9,790. 68	-
68848 4	南芯 科技	2023-0 3-28	6 个月	新股 流通 受限	39.99	36.71	1,008	40,309 .92	37,003 .68	-
68850	索辰	2023-0	6 个月	新股	245.56	122.11	222	36,834	27,108	-

7	科技	4-10		流通受限				.00	.42	
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688620	安凯微	2023-06-15	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 96,971,384.55 元，于 2023 年 7 月 3 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。

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 56.15%(2022 年 12 月 31 日：51.80%)。

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	125,500,878.91	130,937,926.03
合计	125,500,878.91	130,937,926.03

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	881,616,500.27	1,029,391,396.33

AAA 以下	400,532,746.28	289,155,364.86
未评级	0.00	0.00
合计	1,282,149,246.55	1,318,546,761.19

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	2,934,777.20	-	-	-	2,934,777.20
结算备付金	6,158,837.11	-	-	-	6,158,837.11
存出保证金	200,996.53	-	-	-	200,996.53
交易性金融资产	202,358,212.31	1,126,805,305.14	78,486,608.01	968,319,084.93	2,375,969,210.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资	-	-	-	-	-

产					
应收清算款	-	-	-	14,547,276.20	14,547,276.20
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	827,737.48	827,737.48
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	211,652,823.15	1,126,805,305.14	78,486,608.01	983,694,098.61	2,400,638,834.91
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	96,971,384.55	-	-	-	96,971,384.55
应付清算款	-	-	-	14,313,247.05	14,313,247.05
应付赎回款	-	-	-	3,060,113.85	3,060,113.85
应付管理人报酬	-	-	-	1,705,581.57	1,705,581.57
应付托管费	-	-	-	473,772.66	473,772.66
应付销售服务费	-	-	-	1,289.64	1,289.64
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	8,585.51	8,585.51
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	787,526.69	787,526.69
负债总计	96,971,384.55	-	-	20,350,116.97	117,321,501.52
利率敏感度缺口	114,681,438.60	1,126,805,305.14	78,486,608.01	963,343,981.64	2,283,317,333.39
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	4,886,034.42	-	-	-	4,886,034.42
结算备付金	15,715,844.20	-	-	-	15,715,844.20
存出保证金	179,022.10	-	-	-	179,022.10
交易性金融资产	394,186,436.71	959,802,555.43	95,495,695.08	1,089,131,699.69	2,538,616,386.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	145,019.34	145,019.34
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,348,183.83	2,348,183.83
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	414,967,337.43	959,802,555.43	95,495,695.08	1,091,624,902.86	2,561,890,490.80
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	-1,184.66	-	-	-	-1,184.66
应付清算款	-	-	-	3,927,940.34	3,927,940.34
应付赎回款	-	-	-	9,376,631.56	9,376,631.56
应付管理人报酬	-	-	-	1,962,820.29	1,962,820.29
应付托管费	-	-	-	545,227.87	545,227.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	11,800.11	11,800.11
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	760,587.05	760,587.05
负债总计	-1,184.66	-	-	16,585,007.22	16,583,822.56
利率敏感度缺口	414,968,522.09	959,802,555.43	95,495,695.08	1,075,039,895.64	2,545,306,668.24

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

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	1,369,207.64	982,622.51
2.市场利率上升25个基点	-1,364,737.99	-978,830.16	

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	968,319,084.93	42.41	1,089,131,699.69	42.79
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	968,319,084.93	42.41	1,089,131,699.69	42.79

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%	315,202,481.30	371,804,668.51
2.业绩比较基准下降 5%	-315,202,481.30	-371,804,668.51	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日
第一层次	1,867,566,054.39
第二层次	506,831,268.47
第三层次	1,571,887.53
合计	2,375,969,210.39

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	------------------

1	权益投资	968,319,084.93	40.34
	其中：股票	968,319,084.93	40.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,407,650,125.46	58.64
	其中：债券	1,407,650,125.46	58.64
	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	9,093,614.31	0.38
8	其他各项资产	15,576,010.21	0.65
9	合计	2,400,638,834.91	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	-	-
C	制造业	598,269,172.48	26.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	41,275,427.95	1.81
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	100,426,307.95	4.40
J	金融业	228,249,209.02	10.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	968,319,084.93	42.41

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	600486	扬农化工	1,271,466	111,151,557.72	4.87
2	688188	柏楚电子	530,523	100,035,416.88	4.38
3	601658	邮储银行	19,416,702	94,947,672.78	4.16
4	002304	洋河股份	693,200	91,051,820.00	3.99
5	600309	万华化学	950,600	83,500,704.00	3.66
6	600036	招商银行	2,165,419	70,939,126.44	3.11
7	000568	泸州老窖	328,400	68,822,788.00	3.01
8	000858	五粮液	382,300	62,532,811.00	2.74
9	300059	东方财富	4,391,719	62,362,409.80	2.73
10	300408	三环集团	1,583,196	46,466,802.60	2.04
11	600976	健民集团	534,330	41,191,499.70	1.80
12	603915	国茂股份	1,622,900	34,373,022.00	1.51
13	000425	徐工机械	4,515,200	30,567,904.00	1.34
14	000423	东阿阿胶	473,600	25,313,920.00	1.11
15	600079	人福医药	864,100	23,278,854.00	1.02
16	300628	亿联网络	460,740	16,158,151.80	0.71
17	301358	湖南裕能	20,226	887,880.50	0.04
18	688515	裕太微	4,183	718,053.78	0.03
19	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.02
20	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
21	301029	怡合达	6,648	297,032.64	0.01
22	688502	茂莱光学	1,509	289,728.00	0.01
23	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
24	300850	新强联	6,434	240,502.92	0.01
25	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.01
26	688623	二元科技	1,776	162,256.88	0.01
27	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
28	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01

29	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
30	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
31	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
32	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
33	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
34	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
35	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
36	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
37	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
38	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
39	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
40	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
41	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
42	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
43	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
44	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
45	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
46	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
47	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
48	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
49	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
50	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
51	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
52	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
53	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
54	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
55	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
56	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
57	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
58	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
59	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
60	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
61	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
62	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
63	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
64	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
65	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
66	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
67	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
68	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
69	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
70	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
71	001207	联科科技	682	11,403.04	0.00
72	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00

73	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
74	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
75	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
76	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
77	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
78	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
79	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
80	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
81	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
82	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
83	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
84	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
85	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
86	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
87	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
88	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
89	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
90	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
91	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
92	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
93	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
94	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
95	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
96	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
97	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
98	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
99	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
100	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
101	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601658	邮储银行	49,894,494.00	1.96
2	600036	招商银行	49,834,350.87	1.96
3	600976	健民集团	36,580,434.28	1.44
4	000425	徐工机械	26,163,553.00	1.03
5	300014	亿纬锂能	26,086,256.97	1.02
6	301039	中集车辆	25,853,512.53	1.02

7	000568	泸州老窖	25,048,266.00	0.98
8	603806	福斯特	24,310,130.40	0.96
9	600079	人福医药	23,171,065.00	0.91
10	000423	东阿阿胶	23,020,923.00	0.90
11	002304	洋河股份	13,037,021.78	0.51
12	688249	晶合集成	1,470,454.26	0.06
13	688443	智翔金泰	1,148,862.52	0.05
14	688469	中芯集成	785,185.86	0.03
15	688472	阿特斯	694,882.20	0.03
16	688531	日联科技	527,234.80	0.02
17	301358	湖南裕能	480,772.02	0.02
18	301291	明阳电气	459,619.02	0.02
19	688484	南芯科技	402,739.29	0.02
20	688515	裕太微	384,836.00	0.02

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	002415	海康威视	126,002,879.77	4.95
2	688200	华峰测控	49,135,173.22	1.93
3	002756	永兴材料	41,014,203.66	1.61
4	603806	福斯特	32,766,031.95	1.29
5	301039	中集车辆	27,775,615.06	1.09
6	600309	万华化学	25,946,656.00	1.02
7	300014	亿纬锂能	19,829,655.21	0.78
8	300919	中伟股份	19,590,568.38	0.77
9	601012	隆基绿能	12,058,255.18	0.47
10	688249	晶合集成	1,324,057.34	0.05
11	688472	阿特斯	977,056.62	0.04
12	688443	智翔金泰	971,506.41	0.04
13	688469	中芯集成	744,501.25	0.03
14	688531	日联科技	598,165.61	0.02
15	688361	中科飞测	529,807.05	0.02
16	688484	南芯科技	511,365.84	0.02
17	688146	中船特气	433,724.94	0.02
18	001287	中电港	413,510.60	0.02
19	601061	中信金属	411,576.66	0.02
20	001286	陕西能源	391,586.00	0.02

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	339,343,087.82
卖出股票收入（成交）总额	370,860,546.21

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	3,033,481.65	0.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	438,393,238.38	19.20
	其中：政策性金融债	122,467,397.26	5.36
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）	966,223,405.43	42.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,407,650,125.46	61.65

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	190203	19 国开 03	1,200,000	122,467,397.26	5.36
2	188736	21 国君 12	900,000	92,340,744.66	4.04
3	113044	大秦转债	760,310	87,828,094.94	3.85
4	137814	22 华泰 G5	700,000	70,801,164.39	3.10
5	132018	G 三峡 EB1	384,000	54,474,608.22	2.39

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,大秦铁路股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到西安铁路监督管理局、古交市水务局的处罚。国泰君安证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行上海分行的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 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	200,996.53
2	应收清算款	14,547,276.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	827,737.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,576,010.21

7.12.4 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	113044	大秦转债	87,828,094.94	3.85
2	132018	G 三峡 EB1	54,474,608.22	2.39
3	110053	苏银转债	51,551,170.37	2.26
4	110059	浦发转债	43,236,909.59	1.89
5	127049	希望转 2	36,961,237.81	1.62
6	113057	中银转债	34,794,520.27	1.52
7	113050	南银转债	33,515,294.08	1.47
8	113052	兴业转债	32,759,745.10	1.43
9	110073	国投转债	32,175,904.06	1.41
10	127040	国泰转债	28,442,442.79	1.25
11	110083	苏租转债	28,257,794.96	1.24
12	110045	海澜转债	27,744,265.50	1.22
13	113037	紫银转债	26,502,762.40	1.16
14	123107	温氏转债	25,895,891.31	1.13
15	128081	海亮转债	23,840,727.54	1.04
16	110061	川投转债	22,926,251.12	1.00
17	110079	杭银转债	22,599,262.36	0.99
18	127050	麒麟转债	22,049,172.48	0.97
19	127035	濮耐转债	20,677,892.80	0.91
20	113647	禾丰转债	17,258,772.70	0.76
21	128130	景兴转债	17,019,021.21	0.75

22	127033	中装转 2	16,508,397.48	0.72
23	123085	万顺转 2	13,751,069.10	0.60
24	128141	旺能转债	13,197,778.99	0.58
25	113048	晶科转债	11,822,018.16	0.52
26	113025	明泰转债	11,520,097.50	0.50
27	123129	锦鸡转债	10,822,616.56	0.47
28	127027	能化转债	10,325,120.60	0.45
29	132026	G 三峡 EB2	10,279,640.32	0.45
30	127032	苏行转债	10,071,051.81	0.44
31	118028	会通转债	9,114,036.65	0.40
32	128119	龙大转债	8,511,516.14	0.37
33	111005	富春转债	8,279,023.32	0.36
34	127045	牧原转债	7,824,103.22	0.34
35	113043	财通转债	7,647,389.52	0.33
36	110090	爱迪转债	7,003,028.06	0.31
37	127058	科伦转债	6,855,906.15	0.30
38	127005	长证转债	6,719,128.98	0.29
39	128129	青农转债	6,267,032.66	0.27
40	123133	佩蒂转债	6,190,826.36	0.27
41	110085	通 22 转债	6,037,870.63	0.26
42	110043	无锡转债	5,556,946.88	0.24
43	110091	合力转债	5,553,873.10	0.24
44	127073	天赐转债	5,428,582.97	0.24
45	113056	重银转债	5,261,238.90	0.23
46	127012	招路转债	4,140,642.69	0.18
47	123158	宙邦转债	2,569,100.86	0.11
48	128140	润建转债	2,120,868.31	0.09
49	113618	美诺转债	860,208.23	0.04
50	128090	汽模转 2	616,463.56	0.03
51	111009	盛泰转债	558,802.84	0.02
52	127077	华宏转债	517,473.78	0.02
53	113659	莱克转债	511,603.36	0.02
54	110086	精工转债	335,003.33	0.01
55	128097	奥佳转债	267,969.81	0.01
56	118020	芳源转债	79,191.94	0.00
57	118029	富淼转债	41,624.38	0.00
58	113054	绿动转债	6,543.63	0.00

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
易方达安盈回报混合 A	127,526	8,493.15	302,219,443.61	27.90%	780,878,110.94	72.10%
易方达安盈回报混合 C	65	29,172.40	0.00	0.00%	1,896,206.01	100.00%
合计	127,591	8,503.69	302,219,443.61	27.85%	782,774,316.95	72.15%

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	易方达安盈回报混合 A	2,055,524.74	0.1898%
	易方达安盈回报混合 C	4,498.43	0.2372%
	合计	2,060,023.17	0.1899%

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	易方达安盈回报混合 A	>100
	易方达安盈回报混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达安盈回报混合 A	50~100
	易方达安盈回报混合 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C
基金合同生效日（2017 年 2 月 16 日）基金份额总额	604,172,113.67	-
本报告期期初基金份额总额	1,175,731,739.54	-
本报告期基金总申购份额	76,796,871.62	1,941,237.65
减：本报告期基金总赎回份额	169,431,056.61	45,031.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,083,097,554.55	1,896,206.01

注：本基金 A 类基金份额由原基金份额变更而来，并于 2023 年 3 月 7 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。

§ 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	
安信证券	1	503,488.05	0.07%	302.09	0.06%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	98,288,052.56	14.17%	78,630.45	15.07%	-
方正证券	2	26,527,486.12	3.82%	21,221.47	4.07%	-
国泰君安	1	26,174,035.92	3.77%	20,939.19	4.01%	-
国信证券	1	767,793.02	0.11%	614.23	0.12%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	126,029,331.21	18.16%	75,618.03	14.50%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	23,595,455.10	3.40%	18,876.94	3.62%	-
申万宏源	2	22,560.55	0.00%	18.03	0.00%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	2	82,896.90	0.01%	66.31	0.01%	-
招商证券	2	174,547,453.75	25.16%	139,637.96	26.77%	-
中信建投	1	150,989,179.29	21.76%	120,791.78	23.16%	-
中信证券	2	66,332,821.57	9.56%	44,901.95	8.61%	-

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。

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
安信证券	26,917,924.36	2.54%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方财富	412,476,316.45	38.96%	2,647,000,000.00	45.51%	-	-
方正证券	31,813,030.06	3.00%	452,000,000.00	7.77%	-	-
国泰君安	13,011,503.5	1.23%	124,000,0	2.13%	-	-

	2		00.00			
国信证券	47,393,125.40	4.48%	235,000,000.00	4.04%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	135,543,345.56	12.80%	413,000,000.00	7.10%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	20,563,569.96	1.94%	40,000,000.00	0.69%	-	-
申万宏源	5,475,040.96	0.52%	20,000,000.00	0.34%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	131,427,523.65	12.41%	260,600,000.00	4.48%	-	-
招商证券	20,470,873.21	1.93%	182,000,000.00	3.13%	-	-
中信建投	31,674,307.15	2.99%	160,000,000.00	2.75%	-	-
中信证券	182,013,453.23	17.19%	1,282,400,000.00	22.05%	-	-

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	证券时报	2023-01-20
2	易方达安盈回报混合型证券投资基金恢复大额申购及大额转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-21
3	易方达安盈回报混合型证券投资基金之 C 类份额开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
4	易方达基金管理有限公司关于易方达安盈回报混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同、托管协议的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	证券时报	2023-03-30
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2023-04-21

8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
9	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日