

易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	17
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	17
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产（基金净值）变动表	19
6.4	报表附注	21
§ 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	46
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	51
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	51
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	51
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51

7.12	投资组合报告附注.....	51
§ 8	基金份额持有人信息.....	53
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	54
§ 9	开放式基金份额变动.....	54
§ 10	重大事件揭示.....	54
10.1	基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4	基金投资策略的改变.....	55
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8	其他重大事件.....	57
§ 11	备查文件目录.....	58
11.1	备查文件目录.....	58
11.2	存放地点.....	58
11.3	查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	易方达悦享一年持有混合	
基金主代码	009902	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 9 月 18 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	743,270,781.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达悦享一年持有混合 A	易方达悦享一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	009902	009903
报告期末下属分级基金的份额总额	693,380,854.69 份	49,889,926.60 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
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、可交换债券进行投资；本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。3、本基金将在行业分析、公司基本面分析及估值水平分析的基础上，进行股票组合的构建。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。4、本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货、股票期权合约进行交易,以对冲投资组合的风险等。
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
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	上海浦东发展银行股份有限公司

			司
信息披露 负责人	姓名	王玉	朱萍
	联系电话	020-85102688	021-31888888
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95528
传真		020-38798812	021-63602540
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	上海市中山东一路12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	上海市博成路1388号浦银中心 A栋
邮政编码		510620	200126
法定代表人		刘晓艳	郑杨

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）	
	易方达悦享一年持有混 合 A	易方达悦享一年持有混合 C
本期已实现收益	-8,481,923.95	-700,987.20
本期利润	13,128,532.72	789,095.24
加权平均基金份额本期利润	0.0165	0.0137

本期加权平均净值利润率	1.55%	1.30%
本期基金份额净值增长率	1.48%	1.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	易方达悦享一年持有混合 A	易方达悦享一年持有混合 C
期末可供分配利润	48,293,007.60	2,878,120.72
期末可供分配基金份额利润	0.0696	0.0577
期末基金资产净值	741,673,862.29	52,768,047.32
期末基金份额净值	1.0696	1.0577
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
	易方达悦享一年持有混合 A	易方达悦享一年持有混合 C
基金份额累计净值增长率	6.96%	5.77%

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

易方达悦享一年持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.10%	0.19%	0.50%	0.08%	0.60%	0.11%
过去三个月	0.41%	0.16%	0.99%	0.08%	-0.58%	0.08%
过去六个月	1.48%	0.14%	2.33%	0.08%	-0.85%	0.06%
过去一年	-1.42%	0.14%	2.22%	0.10%	-3.64%	0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.96%	0.20%	9.89%	0.12%	-2.93%	0.08%

易方达悦享一年持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.07%	0.19%	0.50%	0.08%	0.57%	0.11%
过去三个月	0.32%	0.16%	0.99%	0.08%	-0.67%	0.08%
过去六个月	1.28%	0.14%	2.33%	0.08%	-1.05%	0.06%

过去一年	-1.81%	0.14%	2.22%	0.10%	-4.03%	0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	5.77%	0.20%	9.89%	0.12%	-4.12%	0.08%

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

易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 9 月 18 日至 2023 年 6 月 30 日)

易方达悦享一年持有混合 A



易方达悦享一年持有混合 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 6.96%，同期业绩比较基准收益率为 9.89%；C 类基金份额净值增长率为 5.77%，同期业绩比较基准收益率为 9.89%。

§ 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		
王成	本基金的基金经理，易方达丰华债券、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达悦夏一年	2020-09-18	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任安信证券股份有限公司交易员、投资经理，易方达基金管理有限公司年金投资部总经理助理。

	持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理，易方达安心回馈混合、易方达磐固六个月持有混合（自 2022 年 07 月 09 日至 2023 年 06 月 19 日）、易方达悦稳一年持有混合的基金经理助理，多资产养老金投资部副总经理				
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、易方达安盈回报混合、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、易方达睿智混合、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	2020-09-24	-	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。
李	本基金的基金经理助理，易方达磐	2022-	2023-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾

中 阳	固六个月持有混合（自 2021 年 05 月 19 日至 2023 年 06 月 20 日）、易方达丰华债券、易方达悦稳一年持有混合、易方达安心回馈混合的基金经理，易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理助理，多资产研究部总经理助理	07-09	06-20		任中信证券股份有限公司研究部研究员，易方达基金管理有限公司研究员。
胡 文 伯	本基金的基金经理助理，易方达双债增强债券（自 2020 年 10 月 16 日至 2023 年 04 月 13 日）、易方达裕鑫债券、易方达鑫转招利混合、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达磐固六个月持有混合的基金经理，易方达裕惠定开混合发起式（自 2018 年 07 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达裕如混合（自 2018 年 07 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达瑞财混合（自 2018 年 07 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达稳健收益债券（自 2018 年 07 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达信用债债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达纯债 1 年定期开放债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达裕祥回报债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达富惠纯债债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达恒益定开债券发起式（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达恒信定开债券发起式（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达恒惠定开债券发起式（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达恒利 3 个月定开债券发起式	2023-06-16	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员。

<p>（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达安源中短债债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达永旭定期开放债券（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达中债新综指发起式（LOF）（自 2019 年 09 月 12 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式（自 2019 年 11 月 08 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达增强回报债券（自 2020 年 08 月 28 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式（自 2021 年 03 月 02 日至 2022 年 12 月 31 日）、易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达磐恒九个月持有混合、易方达悦安一年持有债券的基金经理助理</p>				
---	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年中国经济摆脱了疫情约束，开启复苏进程，但这一过程并非一帆风顺，上半年经济增长整体呈现一季度冲高、二季度回落的走势。年初在服务业重启、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。但进入二季度，前期对经济正向拉动的因素开始发生逆转，生活场景恢复带来的消费修复完成后，居民内生消费意愿不足；房地产销售走弱、投资下滑，带动地产链重回弱势；地方债发行节奏放缓，基建投资低于预期；受海外经济增速放缓影响，出口从高位回落。内、外需共振下，企业由一季度的加库存变成去库存，拖累了经济走势。在此背景下，考虑到全年 5% 的经济增长目标，货币、地产政策陆续出台，但实际经济增速似乎仍处于潜在增速下方，以 CPI（消费者物价指数）和 PPI（生产者价格指数）为代表的价格数据保持低位，经济面临价格下行压力。海外方面，美国经济增长的韧性显著超出预期，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。

股票市场方面，经济相关度更强的周期和消费板块在一季度修复后，跟随二季度的弱现实快速下跌，沪深 300 指数和十年国债收益率表征的股债收益差回到了历史底部区间，市场对政策托底的预期开始变得更高，支撑了市场在较低的位置持续震荡。上半年市场的风格轮动也有所加快，权益市场更多处在存量博弈的局面中，人工智能的终端应用爆发从 1 月份进入大众视野，整体发展迅速，市场从开始认知到普遍认可，导致 TMT（数字新媒体产业）成为上半年涨幅最好的板块，而其他成长板块则相对表现较差。另一条主要的上涨逻辑来自于深度价值板块的估值修复，中特估的提法以及股息率在下跌市场中的防御属性是主要原因。

债券市场方面，收益率先上后下，弱复苏逐渐成为市场共识，构成了债市运行的主基调。春节前随着经济修复预期的改善，市场风险偏好回升，债券收益率上行；春节后市场定价的核心逐步转向经济增长的可持续性，短端利率在资金偏紧的带动下继续上行、长端利率窄幅震荡。3 月以后，央行超预期降准、资金面担忧缓和、配置力量推动收益率平稳下行，直至 4 月末经济增长快速边际转弱至低于潜在增速水平，银行间资金利率持续走低，收益率快速下行到 2.7% 后转入震荡。6 月份降息预期发酵，收益率继续下行，在降息后 10 年国债收益率最低下行到 2.62%，后在止盈盘的抛压下小幅回调。上半年收益率曲线平坦化下行，1 年和 10 年国开债收益率分别下行 14bp 和 22bp；信用债在经历了 2022 年底的赎回负反馈影响后，一季度迎来了相对明显的估值修复，二季度信用利差在市场配置压力的推动下维持在较低水平，6 月底 3 年期 AAA 信用债和银行二级资本债较同期限国开债利差分别压缩 22bp 和 29bp。

转债市场由于整体始终处在高估值状态，过去分析框架中估值影响因素的作用正逐渐变得钝化，供需可能更为直观，一季度由于有大量新券上市，估值的波动相对更大一些，而二季度由于年报和分红的因素，转债供给明显偏低，叠加债市上涨带来的需求资金支撑，转债估值在二季度较长时间维持在高位。

报告期内，本基金加仓了权益资产，减仓了转债资产。策略层面，权益以侧重安全边际的价值投资为主，坚持以相对便宜的出价买长期维度上竞争力强的优质公司，因此随着沪深 300 指数的下跌，组合逐渐增加了经济相关度更强的板块配置，人工智能始终是我们关注和跟踪看好的方向，但仍处于多看少动的状态。转债始终以短期的博弈视角参与，换手更加频繁。债券方面，今年以来基于对票息策略、骑乘策略、杠杆策略收益确定性较高的判断，组合始终保持了较高杠杆水平，以信用债持仓为主，获取套息收益。2-3 月随着银行二级资本债利差修复，组合适当卖出止盈，替换为 2-3 年的票息相对较高的信用债，提高静态收益，组合底仓久期略有降低。3 月份海外银行危机发酵，组合加仓利率债以应对不确定性，危机平息后卖出利率债。6 月份降息后，组合适当降低了杠杆水平，待收益率调整后再度回补。同时，组合对内部持仓做了替换，卖出收益偏低的产业债，替换为利差较高的金融债品种。上半年的不足之处在于，对经济预期差不够重视，忽略了趋势的力量，组合在久期操作上较为保守，错失了长久期利率债的机会。

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 1.0696 元，本报告期份额净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%；C 类基金份额净值为 1.0577 元，本报告期份额净值增长率为 1.28%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%。

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，预计经济呈现逐季改善态势。二季度在多重因素影响下，经济增速快速回落，从 6 月的关键数据来看，相较 5 月有所改善，其中生产端好于需求端，主要受益于库存周期企稳带来的短暂改善；但是从地产销售、出口和价格数据等多个维度来看，需求依然没有触底，经济持续面临较大的价格下行压力。为实现全年增长目标，央行陆续出台了降准降息等货币政策，并将去年地产 16 条政策中部分保主体的融资支持政策进行延期。下半年考虑到地产金融政策加码，同时海外经济好转带动外需改善，预计经济增长有望较二季度出现改善。但考虑到库存和产能都处于高位，目前需求侧现状很难支撑经济持续复苏，实体部门信心和预期偏弱，在保持当前相对较为克制的政策力度的情况下，预计下半年整体仍以弱需求环境为主。

对于股票市场，回顾年初的判断，我们在当前环境下更多保持一份乐观，消费一直没有形成持续回归趋势线的走势，居民超额存款始终徘徊在历史高位，如果新一轮的政策刺激能够在一定程度上修复信心，预计后续盈利修复的弹性仍然较好。当前时点，与经济周期相关度更高的行业，安全边际和修复空间都相对更好，比如消费的家电、汽车、3C（计算机、通信和消费类电子产品）行业，以及周期的基础化工、工程机械和消费建材行业。我们仍然看好人工智能应用的持续涌现，对硬件端在弱现实和强预期之间寻找具有安全边际的配置价值，对软件应用端保持持续的关注和跟踪。

对于转债市场，连续两年多的反复高估值状态，让视角偏长的投资变得非常困难，我们更多以短期博弈的视角参与市场，维持转债胜率较高但赔率较低的判断。年初观察到的赎回概率、信用风险、供需格局、转债自身热炒、以及小票风格，除了最后一条，其他四条都在一定程度上向着不利于转债市场的方向发展，不过它们目前都不是市场定价的主要矛盾。高估值的环境下，转债的结构可能比仓位更重要，目前转债溢价率分化明显，低价券的溢价率很高，而在接近赎回价格的区间，有时会出现快速压缩溢价率的过程，在这个区间内进行个券配置可能更为合适。

债券层面，在政策刺激相对克制、经济处于弱需求和价格低位的环境下，下半年货币政策仍有进一步宽松的空间，预计收益率仍将维持震荡格局，组合将以高等级信用债为底仓，保持中性偏高杠杆，获取套息收益和骑乘收益；同时组合将提高资产流动性，根据对基本面和货币政策的判断，结合对机构行为的分析，适当逆势操作利率债和中长期信用债，灵活调节组合久期，力争以长期稳健的业绩回报基金持有人。

基于以上判断，本基金将继续维持高仓位在权益资产上，低仓位在转债资产上。策略层面，组合坚持以相对便宜的安全边际出价买长期维度上竞争力强的优质公司，并加仓与经济周期相关度更高的行业。同时组合的成长投资将偏好博弈政策修复和引导的长期方向。本基金的个股投资将以公

司确定性和估值出价为核心参考因素，以期获取更优秀的风险收益比。

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

易方达悦享一年持有混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达悦享一年持有混合 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,899,649.28	1,227,569.03
结算备付金		18,546,294.65	24,034,806.93
存出保证金		49,722.91	22,358.52
交易性金融资产	6.4.7.2	1,033,374,081.58	1,357,678,046.85
其中：股票投资		140,652,266.98	108,766,691.46
基金投资		-	-
债券投资		784,190,920.53	1,119,096,177.76
资产支持证券投资		108,530,894.07	129,815,177.63
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		49,982,527.99	8,114,687.82

应收股利		-	-
应收申购款		159.21	2,738.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,103,852,435.62	1,391,080,207.72
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		265,898,444.34	366,930,747.05
应付清算款		39,279,890.38	7,742,560.00
应付赎回款		3,513,628.97	2,469,236.27
应付管理人报酬		333,801.09	438,543.10
应付托管费		100,140.33	131,562.96
应付销售服务费		17,692.49	23,198.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		73,573.76	77,415.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	193,354.65	239,738.88
负债合计		309,410,526.01	378,053,002.57
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	743,270,781.29	961,709,252.16
未分配利润	6.4.7.8	51,171,128.32	51,317,952.99
净资产合计		794,441,909.61	1,013,027,205.15
负债和净资产总计		1,103,852,435.62	1,391,080,207.72

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0696 元，C 类基金份额净值 1.0577 元；基金份额总额 743,270,781.29 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 693,380,854.69 份，C 类基金份额总额 49,889,926.60 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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		20,855,918.40	-23,341,141.48

1.利息收入		210,548.70	335,944.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	207,098.88	311,205.78
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		3,449.82	24,739.19
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,455,169.41	10,221,787.98
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-17,594,324.95	-32,305,163.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	11,133,534.10	39,388,805.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	2,167,549.75	1,576,971.33
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	1,838,071.69	1,561,175.04
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	23,100,539.11	-33,898,874.43
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	-	-
减：二、营业总支出		6,938,290.44	9,967,462.32
1. 管理人报酬		2,251,659.59	4,344,042.93
2. 托管费		675,497.90	1,303,212.86
3. 销售服务费		120,360.44	237,552.06
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,703,234.04	3,856,447.67
其中：卖出回购金融资产支出		3,703,234.04	3,856,447.67
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		44,775.10	78,811.51
8. 其他费用	6.4.7.18	142,763.37	147,395.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,917,627.96	-33,308,603.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,917,627.96	-33,308,603.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,917,627.96	-33,308,603.80

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	961,709,252.16	51,317,952.99	1,013,027,205.15
二、本期期初净资产(基金净值)	961,709,252.16	51,317,952.99	1,013,027,205.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-218,438,470.87	-146,824.67	-218,585,295.54
(一)、综合收益总额	-	13,917,627.96	13,917,627.96
(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)	-218,438,470.87	-14,064,452.63	-232,502,923.50
其中：1.基金申购款	1,527,755.68	98,192.90	1,625,948.58
2.基金赎回款	-219,966,226.55	-14,162,645.53	-234,128,872.08
(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)	743,270,781.29	51,171,128.32	794,441,909.61
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,972,648,665.87	193,184,617.35	2,165,833,283.22
二、本期期初净资产(基金净值)	1,972,648,665.87	193,184,617.35	2,165,833,283.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-601,680,097.88	-77,399,079.14	-679,079,177.02
(一)、综合收益总额	-	-33,308,603.80	-33,308,603.80
(二)、本期基金份额交易产生	-601,680,097.88	-44,090,475.34	-645,770,573.22

的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	19,627,044.82	1,655,481.73	21,282,526.55
2.基金赎回款	-621,307,142.70	-45,745,957.07	-667,053,099.77
（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）	1,370,968,567.99	115,785,538.21	1,486,754,106.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1401号《关于准予易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2020年9月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为9,016,148,187.10份基金份额，其中认购资金利息折合536,975.14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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

制及披露》《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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	1,899,649.28
等于：本金	1,899,496.62
加：应计利息	152.66
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,899,649.28

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	152,199,614.88	-	140,652,266.98	-11,547,347.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	2,495,497.87		
	市场	310,136,389.67	312,790,584.83	158,697.29
	银行间		6,852,335.70	
	市场	461,799,938.57	471,400,335.70	2,748,061.43
合计	771,936,328.24	9,347,833.57	784,190,920.53	2,906,758.72
资产支持证券	107,699,000.00	431,894.07	108,530,894.07	400,000.00
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,031,834,943.12	9,779,727.64	1,033,374,081.58	-8,240,589.18

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	86,738.41
其中：交易所市场	71,286.93
银行间市场	15,451.48
应付利息	-
预提费用	106,616.24
合计	193,354.65

6.4.7.7 实收基金

易方达悦享一年持有混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	897,907,480.10	897,907,480.10
本期申购	1,277,713.87	1,277,713.87
本期赎回（以“-”号填列）	-205,804,339.28	-205,804,339.28
本期末	693,380,854.69	693,380,854.69

易方达悦享一年持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	63,801,772.06	63,801,772.06
本期申购	250,041.81	250,041.81
本期赎回（以“-”号填列）	-14,161,887.27	-14,161,887.27
本期末	49,889,926.60	49,889,926.60

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

易方达悦享一年持有混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79,635,458.02	-31,143,384.08	48,492,073.94
本期利润	-8,481,923.95	21,610,456.67	13,128,532.72
本期基金份额交易产生的变动数	-15,869,230.03	2,541,630.97	-13,327,599.06
其中：基金申购款	96,854.44	-12,424.73	84,429.71
基金赎回款	-15,966,084.47	2,554,055.70	-13,412,028.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,284,304.04	-6,991,296.44	48,293,007.60

易方达悦享一年持有混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,016,633.66	-2,190,754.61	2,825,879.05
本期利润	-700,987.20	1,490,082.44	789,095.24
本期基金份额交易产生的变动数	-940,199.92	203,346.35	-736,853.57
其中：基金申购款	16,287.89	-2,524.70	13,763.19
基金赎回款	-956,487.81	205,871.05	-750,616.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,375,446.54	-497,325.82	2,878,120.72

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	5,653.55
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	201,219.00
其他	226.33
合计	207,098.88

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	-17,594,324.95
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	-17,594,324.95

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	92,307,173.59
减：卖出股票成本总额	109,636,536.37
减：交易费用	264,962.17
买卖股票差价收入	-17,594,324.95

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	13,830,891.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,697,357.63
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	11,133,534.10

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	821,413,338.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	813,989,666.39
减：应计利息总额	10,108,655.01

减：交易费用	12,374.56
买卖债券差价收入	-2,697,357.63

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	2,096,474.42
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	71,075.33
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,167,549.75

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	22,925,580.39
减：卖出资产支持证券成本总额	21,649,000.00
减：应计利息总额	1,205,505.06
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	71,075.33

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	1,838,071.69
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	1,838,071.69

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	23,100,539.11
——股票投资	10,843,812.07
——债券投资	11,552,727.04
——资产支持证券投资	704,000.00
——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	23,100,539.11

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	47,108.87
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
银行汇划费	17,547.13
其他	600.00
合计	142,763.37

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
上海浦东发展银行股份有限公司	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

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	2,251,659.59	4,344,042.93
其中：支付销售机构的客户维护费	889,267.24	1,724,995.05

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性

支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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	675,497.90	1,303,212.86

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达悦享一年持有混合 A	易方达悦享一年持有混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	2,138.37	2,138.37
浦发银行	-	118,222.07	118,222.07
合计	-	120,360.44	120,360.44
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		
	易方达悦享一年持有混合 A	易方达悦享一年持有混合 C	合计

易方达基金管理有限 公司	-	2,417.45	2,417.45
浦发银行	-	235,134.61	235,134.61
合计	-	237,552.06	237,552.06

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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	-	6,120,144.4 1	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

的证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达悦享一年持有混合 A

无。

易方达悦享一年持有混合 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 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
浦发银行-活期存款	1,899,649.28	5,653.55	2,136,440.43	10,723.12

注：本基金的上述银行存款由基金托管人上海浦东发展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	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

易方达悦享一年持有混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达悦享一年持有混合 C

本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	3,855	25,365.90	29,220.90	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
68814	中船	2023-0	6 个月	新股	36.15	38.13	1,011	36,547	38,549	-

6	特气	4-13		流通受限				.65	.43	
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	2,522	95,533.36	74,373.78	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	4,570	50,727.00	77,872.80	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688485	九州一轨	2023-01-11	6 个月	新股流通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
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	-

688515	裕太微	2023-02-01	6 个月	新股流通受限	92.00	162.75	4,183	384,836.00	680,783.25	-
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	二元科技	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 124,941,630.29 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
102002159	20 金融街 MTN002	2023-07-04	103.09	100,000	10,309,205.48
102101415	21 东浩兰生 MTN001(权益 出资)	2023-07-04	103.56	300,000	31,067,653.15
102102267	21 中建材集 MTN002	2023-07-04	102.71	100,000	10,271,216.44
102103063	21 鲁能源 MTN007	2023-07-04	103.15	100,000	10,315,284.93
102281686	22 蓝星 MTN001	2023-07-04	102.48	100,000	10,247,873.42
102281881	22 淄博矿业 MTN001	2023-07-04	102.71	100,000	10,271,452.60
2028013	20 农业银行 二级 01	2023-07-05	101.17	400,000	40,467,781.42
2028033	20 建设银行 二级	2023-07-05	106.34	116,000	12,335,392.33
合计				1,316,000	135,285,859.77

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

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 140,956,814.05 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 106.98%(2022 年 12 月 31 日：117.83%)。

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	42,832,991.78	55,296,141.10
合计	42,832,991.78	55,296,141.10

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

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	528,370,333.13	920,642,109.38
AAA 以下	39,830,959.43	12,701,135.49
未评级	173,158,109.42	130,456,791.79
合计	741,359,401.98	1,063,800,036.66

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	108,530,894.07	129,815,177.63
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	108,530,894.07	129,815,177.63

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	1,899,649.28	-	-	-	1,899,649.28
结算备付金	18,546,294.65	-	-	-	18,546,294.65
存出保证金	49,722.91	-	-	-	49,722.91
交易性金融资产	181,579,733.26	617,769,228.96	93,372,852.38	140,652,266.98	1,033,374,081.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	49,982,527.99	49,982,527.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	159.21	159.21
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	202,075,400.10	617,769,228.96	93,372,852.38	190,634,954.18	1,103,852,435.62
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	265,898,444.34	-	-	-	265,898,444.34
应付清算款	-	-	-	39,279,890.38	39,279,890.38
应付赎回款	-	-	-	3,513,628.97	3,513,628.97
应付管理人报酬	-	-	-	333,801.09	333,801.09
应付托管费	-	-	-	100,140.33	100,140.33
应付销售服务费	-	-	-	17,692.49	17,692.49
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	73,573.76	73,573.76
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	193,354.65	193,354.65
负债总计	265,898,444.34	-	-	43,512,081.67	309,410,526.01
利率敏感度缺口	-63,823,044.24	617,769,228.96	93,372,852.38	147,122,872.51	794,441,909.61
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,227,569.03	-	-	-	1,227,569.03
结算备付金	24,034,806.93	-	-	-	24,034,806.93
存出保证金	22,358.52	-	-	-	22,358.52
交易性金融资产	327,862,068.63	791,240,007.22	129,809,279.54	108,766,691.46	1,357,678,046.85
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	8,114,687.82	8,114,687.82
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,738.57	2,738.57
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	353,146,803.11	791,240,007.22	129,809,279.54	116,884,117.85	1,391,080,207.72
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	366,930,747.05	-	-	-	366,930,747.05
应付清算款	-	-	-	7,742,560.00	7,742,560.00
应付赎回款	-	-	-	2,469,236.27	2,469,236.27
应付管理人报酬	-	-	-	438,543.10	438,543.10
应付托管费	-	-	-	131,562.96	131,562.96
应付销售服务费	-	-	-	23,198.93	23,198.93
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	77,415.38	77,415.38

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	239,738.88	239,738.88
负债总计	366,930,747.05	-	-	11,122,255.52	378,053,002.57
利率敏感度缺口	-13,783,943.94	791,240,007.22	129,809,279.54	105,761,862.33	1,013,027,205.15

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	3,534,749.20	5,533,170.28
	2.市场利率上升25个基点	-3,513,318.98	-5,494,167.75

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	140,652,266.98	17.70	108,766,691.46	10.74
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	140,652,266.98	17.70	108,766,691.46	10.74

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%	79,293,957.75	60,937,626.31
2.业绩比较基准下降5%	-79,293,957.75	-60,937,626.31	

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	176,398,262.03
第二层次	855,326,945.39
第三层次	1,648,874.16
合计	1,033,374,081.58

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列

入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	140,652,266.98	12.74
	其中：股票	140,652,266.98	12.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	892,721,814.60	80.87
	其中：债券	784,190,920.53	71.04
	资产支持证券	108,530,894.07	9.83
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	20,445,943.93	1.85
8	其他各项资产	50,032,410.11	4.53
9	合计	1,103,852,435.62	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	111,891,927.33	14.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,096,696.15	0.52
F	批发和零售业	29,220.90	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	11,562,542.40	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	161,496.24	0.02
J	金融业	12,856,075.36	1.62
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	54,308.60	0.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	140,652,266.98	17.70

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	601799	星宇股份	103,800	12,829,680.00	1.61
2	000333	美的集团	202,600	11,937,192.00	1.50
3	600519	贵州茅台	5,100	8,624,100.00	1.09
4	000858	五粮液	51,700	8,456,569.00	1.06

5	601658	邮储银行	1,626,800	7,955,052.00	1.00
6	688696	极米科技	46,206	6,440,654.34	0.81
7	600486	扬农化工	63,100	5,516,202.00	0.69
8	601816	京沪高铁	1,030,200	5,418,852.00	0.68
9	002841	视源股份	80,600	5,387,304.00	0.68
10	000786	北新建材	194,400	4,764,744.00	0.60
11	300750	宁德时代	20,160	4,612,406.40	0.58
12	600036	招商银行	132,016	4,324,844.16	0.54
13	002572	索菲亚	248,000	4,320,160.00	0.54
14	601117	中国化学	493,500	4,086,180.00	0.51
15	600009	上海机场	88,600	4,024,212.00	0.51
16	300628	亿联网络	114,360	4,010,605.20	0.50
17	002916	深南电路	52,200	3,934,314.00	0.50
18	601100	恒立液压	59,300	3,814,769.00	0.48
19	688516	奥特维	18,789	3,539,847.60	0.45
20	688200	华峰测控	21,974	3,362,022.00	0.42
21	600309	万华化学	36,200	3,179,808.00	0.40
22	600585	海螺水泥	123,700	2,936,638.00	0.37
23	601233	桐昆股份	181,000	2,398,250.00	0.30
24	000651	格力电器	65,300	2,384,103.00	0.30
25	002532	天山铝业	365,400	2,188,746.00	0.28
26	603565	中谷物流	196,248	2,119,478.40	0.27
27	601966	玲珑轮胎	94,000	2,088,680.00	0.26
28	603799	华友钴业	34,500	1,583,895.00	0.20
29	000778	新兴铸管	188,300	768,264.00	0.10
30	688515	裕太微	4,183	680,783.25	0.09
31	002756	永兴材料	9,770	611,699.70	0.08
32	300059	东方财富	40,576	576,179.20	0.07
33	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.04
34	688502	茂莱光学	1,509	289,728.00	0.04
35	688623	二元科技	1,776	162,256.88	0.02
36	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.02
37	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
38	688472	阿特斯	4,570	77,872.80	0.01
39	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.01
40	688443	智翔金泰	2,522	74,373.78	0.01
41	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01
42	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.01
43	688531	日联科技	346	47,045.62	0.01
44	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
45	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
46	601061	中信金属	3,855	29,220.90	0.00
47	688352	顾中科技	2,361	28,497.27	0.00
48	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00

49	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
50	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
51	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
52	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
53	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
54	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
55	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
56	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
57	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
58	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
59	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
60	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
61	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
62	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
63	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
64	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
65	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
66	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
67	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
68	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	601799	星宇股份	9,267,173.75	0.91
2	601658	邮储银行	7,950,588.00	0.78
3	000333	美的集团	6,853,110.64	0.68
4	688696	极米科技	6,441,088.09	0.64
5	002841	视源股份	5,230,604.00	0.52
6	601117	中国化学	5,135,201.00	0.51
7	600009	上海机场	5,125,551.00	0.51
8	601816	京沪高铁	5,024,484.00	0.50
9	002756	永兴材料	5,011,869.00	0.49
10	000786	北新建材	4,841,895.00	0.48
11	605020	永和股份	4,551,407.00	0.45
12	300750	宁德时代	4,434,306.00	0.44
13	002572	索菲亚	4,429,247.00	0.44
14	688516	奥特维	4,085,503.31	0.40
15	601100	恒立液压	4,043,259.00	0.40

16	688200	华峰测控	4,041,172.58	0.40
17	300628	亿联网络	4,025,024.80	0.40
18	002916	深南电路	4,017,688.00	0.40
19	300059	东方财富	4,009,311.00	0.40
20	600585	海螺水泥	3,457,824.00	0.34

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	002415	海康威视	12,935,122.84	1.28
2	601012	隆基绿能	9,923,155.34	0.98
3	000661	长春高新	5,941,697.20	0.59
4	603259	药明康德	5,428,630.34	0.54
5	600036	招商银行	4,346,610.00	0.43
6	000001	平安银行	4,241,316.89	0.42
7	002142	宁波银行	4,120,516.44	0.41
8	601799	星宇股份	3,975,182.00	0.39
9	600900	长江电力	3,478,997.00	0.34
10	605020	永和股份	3,475,723.00	0.34
11	002756	永兴材料	3,356,973.20	0.33
12	002049	紫光国微	2,907,604.00	0.29
13	300059	东方财富	2,690,496.10	0.27
14	603806	福斯特	2,434,672.20	0.24
15	000333	美的集团	2,377,226.00	0.23
16	600399	抚顺特钢	1,838,580.00	0.18
17	002304	洋河股份	1,580,724.00	0.16
18	600519	贵州茅台	1,543,151.00	0.15
19	301269	华大九天	1,324,892.81	0.13
20	688249	晶合集成	1,324,649.49	0.13

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	130,678,299.82
卖出股票收入（成交）总额	92,307,173.59

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	2,010,526.03	0.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	205,147,082.78	25.82
	其中：政策性金融债	40,822,465.75	5.14
4	企业债券	222,449,383.57	28.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	316,968,936.75	39.90
7	可转债（可交换债）	37,614,991.40	4.73
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	784,190,920.53	98.71

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	149505	21 冀东 01	500,000	50,545,438.36	6.36
2	190203	19 国开 03	400,000	40,822,465.75	5.14
3	2028013	20 农业银行 二级 01	400,000	40,467,781.42	5.09
4	2128047	21 招商银行 永续债	300,000	31,090,818.08	3.91
5	102101415	21 东浩兰 生 MTN001(权 益出资)	300,000	31,067,653.15	3.91

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180297	燕山湖 A	300,000	30,149,072.81	3.80
2	189847	21LJZ 优	200,000	20,229,691.40	2.55
3	183105	21 电 4A2	200,000	17,885,914.58	2.25
4	183148	G 国电优	100,000	10,231,152.88	1.29
5	136815	光汇 01 优	100,000	10,049,554.52	1.26
6	180310	诚悦 7A	100,000	10,017,169.86	1.26
7	180802	铁建 37A1	100,000	9,968,338.02	1.25

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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或原始权益人中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行的处罚。中国建设银行股份有限公司

公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。资产支持证券燕山湖 A 的管理人中信建投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和原始权益人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	49,722.91
2	应收清算款	49,982,527.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	159.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,032,410.11

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	113056	重银转债	6,036,259.87	0.76
2	113052	兴业转债	3,683,030.21	0.46
3	113044	大秦转债	3,537,104.95	0.45
4	113021	中信转债	3,284,220.40	0.41
5	110079	杭银转债	1,691,868.03	0.21
6	110073	国投转债	1,683,276.96	0.21
7	123158	宙邦转债	911,992.63	0.11
8	127049	希望转 2	865,535.02	0.11
9	118009	华锐转债	828,937.62	0.10
10	127018	本钢转债	820,182.52	0.10

11	128081	海亮转债	806,115.13	0.10
12	127047	帝欧转债	789,100.63	0.10
13	113057	中银转债	751,870.20	0.09
14	127030	盛虹转债	544,392.13	0.07
15	110075	南航转债	504,276.33	0.06
16	127061	美锦转债	376,603.05	0.05
17	128034	江银转债	337,358.90	0.04
18	118022	锂科转债	260,448.86	0.03
19	132020	19 蓝星 EB	220,122.19	0.03
20	123161	强联转债	118,527.36	0.01

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
易方达悦享一年持有混合 A	6,270	110,587.06	0.00	0.00%	693,380,854.69	100.00%
易方达悦享一年持有混合 C	673	74,130.65	0.00	0.00%	49,889,926.60	100.00%
合计	6,943	107,053.26	0.00	0.00%	743,270,781.29	100.00%

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	易方达悦享一年持有混合 A	360,657.50	0.0520%
	易方达悦享一年持有混合 C	0.00	0.0000%

	合计	360,657.50	0.0485%
--	----	------------	---------

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	易方达悦享一年持有混合 A	0
	易方达悦享一年持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达悦享一年持有混合 A	10~50
	易方达悦享一年持有混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达悦享一年持有混合 A	易方达悦享一年持有混合 C
基金合同生效日（2020 年 9 月 18 日）基金份额总额	8,322,256,808.05	693,891,379.05
本报告期期初基金份额总额	897,907,480.10	63,801,772.06
本报告期基金总申购份额	1,277,713.87	250,041.81
减：本报告期基金总赎回份额	205,804,339.28	14,161,887.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	693,380,854.69	49,889,926.60

§ 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	

德邦证券	1	16,806,571.41	7.89%	10,083.94	6.67%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	13,008,044.80	6.11%	7,804.74	5.16%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	3,452,097.00	1.62%	2,761.80	1.83%	-
开源证券	3	56,143,916.70	26.36%	44,915.47	29.70%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	37,533,558.40	17.62%	30,026.86	19.86%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	42,308,938.30	19.86%	25,385.37	16.79%	-
招商证券	1	2,395,017.14	1.12%	1,916.02	1.27%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	18,950,060.55	8.90%	11,370.04	7.52%	-
中信建投	1	17,601,692.11	8.26%	14,081.11	9.31%	-
中信证券	1	4,800,344.00	2.25%	2,880.43	1.90%	-

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

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

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

德邦证券	14,483,259.29	2.84%	1,517,600,000.00	5.98%	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	31,085,186.76	6.10%	563,002,000.00	2.22%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	4,332,549.03	0.85%	235,000,000.00	0.93%	-	-
开源证券	22,152,464.68	4.35%	5,105,938,000.00	20.13%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	315,109,985.14	61.81%	12,437,300,000.00	49.03%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	3,213,146.30	0.63%	1,715,000,000.00	6.76%	-	-
招商证券	63,000,884.49	12.36%	712,000,000.00	2.81%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	41,653,432.83	8.17%	2,403,500,000.00	9.48%	-	-
中信建投	262,089.04	0.05%	438,000,000.00	1.73%	-	-
中信证券	14,472,825.22	2.84%	237,912,000.00	0.94%	-	-

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电子披露网站	2023-04-22
6	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理	中国证券报、基金管理人	2023-06-16

	助理的公告	网站及中国证监会基金 电子披露网站	
--	-------	----------------------	--

§ 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悦享一年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日