

# 易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：杭州银行股份有限公司

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。

基金托管人杭州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	13
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	14
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）	15
6.1	资产负债表	15
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	19
§ 7	投资组合报告	47
7.1	期末基金资产组合情况	47
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	54
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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54

7.12	投资组合报告附注.....	54
§ 8	基金份额持有人信息.....	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	57
§ 9	开放式基金份额变动.....	58
§ 10	重大事件揭示.....	58
10.1	基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4	基金投资策略的改变.....	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8	其他重大事件.....	60
§ 11	备查文件目录.....	61
11.1	备查文件目录.....	61
11.2	存放地点.....	61
11.3	查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达裕如混合	
基金主代码	001136	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 3 月 24 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	杭州银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,142,799,467.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达裕如混合 A	易方达裕如混合 C
下属分级基金的交易代码	001136	017417
报告期末下属分级基金的份额总额	1,140,449,801.32 份	2,349,666.26 份

注：自 2023 年 1 月 10 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 1 月 11 日。

### 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	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券等资产类别的配置比例。股票投资策略方面，本基金将通过分析行业景气度和行业竞争格局，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置的基础上，本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。债券投资策略方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	一年期人民币定期存款利率（税后）+2%
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	杭州银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	王玉	曲中雯
	联系电话	020-85102688	0571-86475538
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	quzhongwen@hzbk.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95398
传真		020-38798812	0571-86475525
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	杭州市下城区庆春路46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	杭州市庆春路46号杭州银行大 厦13楼资产托管部
邮政编码		510620	310003
法定代表人		刘晓艳	宋剑斌

## 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）	
	易方达裕如混合 A	易方达裕如混合 C
本期已实现收益	19,588,769.39	15,479.25
本期利润	41,348,409.13	7,014.99
加权平均基金份额本期利润	0.0271	0.0058
本期加权平均净值利润率	2.15%	0.46%

本期基金份额净值增长率	1.70%	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
	易方达裕如混合 A	易方达裕如混合 C
期末可供分配利润	257,426,224.94	525,126.22
期末可供分配基金份额利润	0.2257	0.2235
期末基金资产净值	1,431,838,662.07	2,944,868.13
期末基金份额净值	1.256	1.253
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
	易方达裕如混合 A	易方达裕如混合 C
基金份额累计净值增长率	55.51%	0.40%

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 1 月 10 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 1 月 11 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达裕如混合 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	0.88%	0.25%	0.29%	0.01%	0.59%	0.24%
过去三个月	0.00%	0.23%	0.88%	0.01%	-0.88%	0.22%
过去六个月	1.70%	0.23%	1.76%	0.01%	-0.06%	0.22%
过去一年	-0.64%	0.22%	3.55%	0.01%	-4.19%	0.21%
过去三年	16.16%	0.21%	10.65%	0.01%	5.51%	0.20%
自基金合同生效起至今	55.51%	0.17%	29.73%	0.01%	25.78%	0.16%

易方达裕如混合 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	0.80%	0.24%	0.29%	0.01%	0.51%	0.23%
过去三个月	-0.16%	0.22%	0.88%	0.01%	-1.04%	0.21%
过去六个月	-	-	-	-	-	-

过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.40%	0.23%	1.66%	0.01%	-1.26%	0.22%

### 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

易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

易方达裕如混合 A

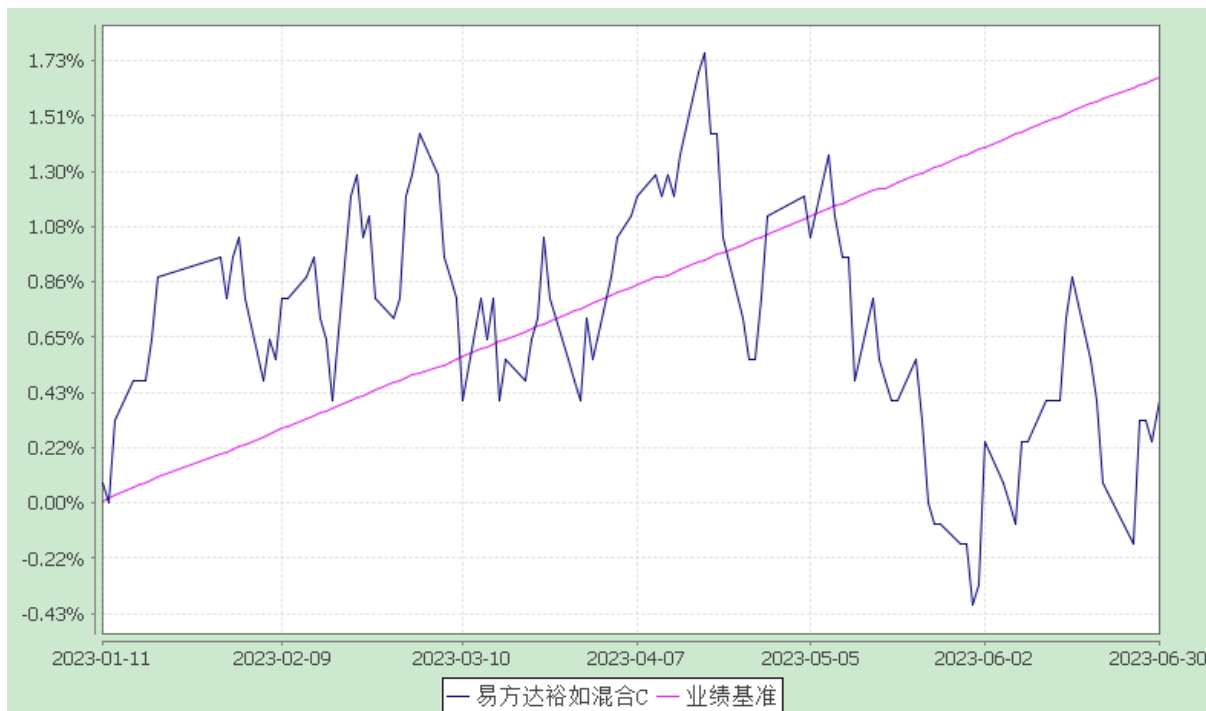
(2015 年 3 月 24 日至 2023 年 6 月 30 日)



易方达裕如混合 C

(2023 年 1 月 11 日至 2023 年 6 月 30 日)





注：1.自 2023 年 1 月 10 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 1 月 11 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 55.51%，同期业绩比较基准收益率为 29.73%；C 类基金份额净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准收益率为 1.66%。

## § 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		
李	本基金的基金经理，易方达永旭定	2017-	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾

一 硕	期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达安源中短债债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒春纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒实纯债一年定开债券发起式、易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达富惠纯债债券、易方达恒安定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式的基金经理，易方达信用债债券（自 2015 年 02 月 17 日至 2023 年 04 月 28 日）、易方达裕惠定开混合发起式、易方达稳健收益债券（自 2015 年 02 月 17 日至 2023 年 04 月 28 日）、易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达恒兴 3 个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达稳丰 90 天滚动短债的基金经理助理，固定收益特定策略投资部总经理	12-30			任瑞银证券有限公司研究员，中国国际金融有限公司研究员，易方达基金管理有限公司固定收益研究员、固定收益投资部总经理助理、固定收益特定策略投资部负责人，易方达瑞景混合、易方达富惠纯债债券、易方达新利混合、易方达新享混合、易方达恒信定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式、易方达聚盈分级债券发起式、易方达恒益定开债券发起式的基金经理。
胡 文 伯	本基金的基金经理助理，易方达双债增强债券（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	2018-07-31	2023-01-01	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。

	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(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、易方达悦享一年持有混合、易方达悦安一年持有债券的基金经理助理				
田鑫	本基金的基金经理助理, 易方达双债增强债券的基金经理, 易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达稳健收益债券、易方达裕惠定开混合发起式、易方达裕祥回报债券、易方达增强回报债券的基金经理助理, 固定收益研究员	2023-01-18	-	6 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任普特南投资管理公司量化分析师, 上海壹账通金融科技有限公司高级数据挖掘工程师, 易方达基金管理有限公司投资经理助理。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

#### 4.2 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 年年初中国经济一度全面快速复苏，其中改善最大的是消费部门，1-2 月社会消费品零售总额同比增速在去年 12 月的基础上大幅提高 5.3% 至 3.5%。生产方面，1-2 月份规模以上工业增加值同比实际增长 2.4%，同样较去年 12 月份 1.3% 的水平有所改善。此外，在地产投资迅速回升的带动下，同期固定资产投资增速抬升至 5.5%。此外，一季度融资规模的快速扩张也为经济复苏的持续

性创造了良好条件。但二季度以来经济的复苏进程开始面临一定挑战，压力主要来自于以下几个方面：首先，房地产行业在经历了年初的阶段性复苏后，销售数据增速开始边际放缓，二季度单月销售面积为近年来的最低水平。而在开工数据低迷的情况下，房地产投资数据同样呈现下行趋势。其次，在全球制造业处于低迷态势的背景下，我国出口增速迅速走低。最后，此前一季度恢复较好的消费数据从高位回落，二季度表现相对较为平淡。

1-2 月债券收益率一定程度上承受着来自于基本面改善带来的上行压力，但随着经济复苏进程中不确定性开始加大，且货币政策边际逐步宽松，银行间市场流动性充裕带动资金利率不断回落，3 月后债券收益率总体处于下行态势。在经历了一季度的上涨后，二季度转债市场走势持平，上半年中证转债指数走高 3.37%。不过权益市场相对表现较弱，上半年沪深 300 指数回落 0.75%。

操作上，组合坚持绝对收益风格的投资策略，主要配置债券类资产，以获取持有期收益为主要投资目标，权益部分持仓则以盈利基本面较好的价值型股票为主，关注估值安全边际，在个股及行业层面不进行极端配置。组合自去年四季度以来权益及转债配置力度逐步提升，并在今年上半年总体维持了中性偏高的仓位。未来组合力争在同类产品中能够更好地控制回撤及波动，以获取中长期绝对回报为主要投资目标。

#### 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 1.256 元，本报告期份额净值增长率为 1.70%，同期业绩比较基准收益率为 1.76%；C 类基金份额净值为 1.253 元，本报告期份额净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准收益率为 1.66%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来，债券市场的核心矛盾来自于两个方面——对经济基本面复苏预期的不断调整以及资金面的逐步宽松，这两个因素分别驱动了债券市场长端及短端收益率的下行。展望下半年债券市场走势，我们相信仍然需要继续关注这些核心矛盾的演变。

经济基本面这一线索上，市场对于前期经济环境中的不确定性因素——包括地产销售下行、消费复苏乏力、海外需求回落等，在很大程度上已经给予了相对充分的定价。实际上，4-5 月份经济数据低于预期后，6 月数据已经在很多维度出现了好转的迹象，这些边际变化不容忽视。其中当月工业增加值环比增速几乎处于历史同期最高值，甚至高于去年上海疫情影响过后的水平。此外，6 月固定资产投资中的制造业投资及基建投资也表现强势。7 月 24 日召开的中共中央政治局会议对下半年经济工作作出部署，其中很多新的表述显示出政策对经济的支持力度有所加强，后续政策落地值得期待。尤其值得关注的是地产行业政策的调整优化是否会扭转行业目前的不利预期。

资金面方面，随着 6 月 13 日央行将 7 天期逆回购操作利率下调 10 个基点至 1.9%，使得短端利率中枢的下行得以确认，后续主要跟踪银行间市场资金利率是否在公开市场操作利率调降后进一步下行。随着未来总量和结构性货币政策工具可能继续发力，我们相信市场流动性仍将保持充裕，短端利率有继续回落的空间。

综上所述，我们认为下半年债券市场长端收益率面临着经济预期可能出现底部拐点所带来的上行压力，尽管目前而言收益率大幅调整的风险仍然可控。而得益于经济复苏过程中资金利率将可能保持平稳甚至进一步走低，短端债券收益率的波动风险相对较低。在组合配置上，我们对于平均资产久期水平边际有所谨慎，但杠杆水平可保持在中性甚至略偏高的位置上。整体而言，下半年组合有效久期预计不会高于上半年的中枢水平。考虑到经济复苏预期开始好转，组合计划维持相对中性偏高的权益及转债配置比例。

#### 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

易方达裕如混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达裕如混合 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，杭州银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,454,217.83	1,430,898.34
结算备付金		16,266,774.02	24,373,221.95
存出保证金		161,669.87	251,692.81
交易性金融资产	6.4.7.2	1,863,033,302.68	3,325,198,265.21
其中：股票投资		270,819,989.03	420,460,929.71
基金投资		-	-
债券投资		1,389,606,622.04	2,585,931,298.45
资产支持证券投资		202,606,691.61	318,806,037.05
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		16,971,094.52	38,855,368.24
应收股利		-	-
应收申购款		3,325,539.63	79,927.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,904,212,598.55	3,390,189,373.56
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		448,068,952.59	889,789,163.33
应付清算款		-	37,037,807.99
应付赎回款		19,800,663.58	73,219.30
应付管理人报酬		755,290.35	1,335,704.74
应付托管费		125,881.71	222,617.46
应付销售服务费		862.27	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		139,708.67	224,479.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	537,709.18	648,061.20
负债合计		469,429,068.35	929,331,053.81
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,142,799,467.58	1,992,115,996.04
未分配利润	6.4.7.8	291,984,062.62	468,742,323.71
净资产合计		1,434,783,530.20	2,460,858,319.75



负债和净资产总计		1,904,212,598.55	3,390,189,373.56
----------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.256 元，C 类基金份额净值 1.253 元；基金份额总额 1,142,799,467.58 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,140,449,801.32 份，C 类基金份额总额 2,349,666.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		56,467,424.53	53,173,387.00
1.利息收入		226,386.42	191,517.91
其中：存款利息收入	6.4.7.9	204,002.49	170,628.76
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		22,383.93	20,889.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		34,182,290.70	33,103,185.81
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,349,896.96	-4,696,215.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	29,959,742.99	30,458,078.12
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	3,125,383.25	2,679,143.12
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	4,447,061.42	4,662,179.69
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	21,751,175.48	19,326,948.19
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	307,571.93	551,735.09
<b>减：二、营业总支出</b>		15,112,000.41	10,187,679.40
1. 管理人报酬		5,754,525.79	5,699,073.20
2. 托管费		959,087.64	949,845.51
3. 销售服务费		2,818.91	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		8,156,107.87	3,326,466.63

其中：卖出回购金融资产支出		8,156,107.87	3,326,466.63
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		113,264.26	89,178.57
8. 其他费用	6.4.7.18	126,195.94	123,115.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>41,355,424.12</b>	<b>42,985,707.60</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>41,355,424.12</b>	<b>42,985,707.60</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>41,355,424.12</b>	<b>42,985,707.60</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,992,115,996.04	468,742,323.71	2,460,858,319.75
二、本期期初净资产（基金净值）	1,992,115,996.04	468,742,323.71	2,460,858,319.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-849,316,528.46	-176,758,261.09	-1,026,074,789.55
（一）、综合收益总额	-	41,355,424.12	41,355,424.12
（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）	-849,316,528.46	-218,113,685.21	-1,067,430,213.67
其中：1. 基金申购款	260,095,272.83	66,953,226.42	327,048,499.25
2. 基金赎回款	-1,109,411,801.29	-285,066,911.63	-1,394,478,712.92
（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)	1,142,799,467.58	291,984,062.62	1,434,783,530.20
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)	1,031,602,810.11	292,310,241.19	1,323,913,051.30
二、本期期初净资产(基金净值)	1,031,602,810.11	292,310,241.19	1,323,913,051.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,144,124,422.17	369,528,601.34	1,513,653,023.51
(一)、综合收益总额	-	42,985,707.60	42,985,707.60
(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)	1,144,124,422.17	326,542,893.74	1,470,667,315.91
其中：1.基金申购款	1,482,013,450.26	420,985,958.07	1,902,999,408.33
2.基金赎回款	-337,889,028.09	-94,443,064.33	-432,332,092.42
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,175,727,232.28	661,838,842.53	2,837,566,074.81

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

易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会

(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]344 号《关于准予易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 3 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,694,230,027.10 份基金份额,其中认购资金利息折合 81,634.76 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,基金托管人为杭州银行股份有限公司。自 2023 年 1 月 10 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2023 年 1 月 11 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》《易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 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)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类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；

(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	4,454,217.83
等于：本金	4,453,880.33
加：应计利息	337.50
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	4,454,217.83

##### 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	311,306,093.11	-	270,819,989.03	-40,486,104.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	5,735,526.75		
	市场	449,724,669.65	450,699,303.46	-4,760,892.94
	银行间	14,842,518.58		
	市场	919,782,528.94	938,907,318.58	4,282,271.06
合计	1,369,507,198.59	20,578,045.33	1,389,606,622.04	-478,621.88

资产支持证券	199,795,341.91	3,286,691.61	202,606,691.61	-475,341.91
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,880,608,633.61	23,864,736.94	1,863,033,302.68	-41,440,067.87

#### 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	38.50
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	88,574.74
其中：交易所市场	46,058.97
银行间市场	42,515.77
应付利息	-
预提费用	449,095.94
合计	537,709.18

##### 6.4.7.7 实收基金

##### 易方达裕如混合 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	1,992,115,996.04	1,992,115,996.04
本期申购	256,220,416.96	256,220,416.96
本期赎回（以“-”号填列）	-1,107,886,611.68	-1,107,886,611.68
本期末	1,140,449,801.32	1,140,449,801.32

## 易方达裕如混合 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	3,874,855.87	3,874,855.87
本期赎回（以“-”号填列）	-1,525,189.61	-1,525,189.61
本期末	2,349,666.26	2,349,666.26

注：1.自 2023 年 1 月 10 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 1 月 11 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

## 易方达裕如混合 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	422,771,620.37	45,970,703.34	468,742,323.71
本期利润	19,588,769.39	21,759,639.74	41,348,409.13
本期基金份额交易产生的变动数	-184,934,164.82	-33,767,707.27	-218,701,872.09
其中：基金申购款	55,305,012.59	10,658,143.95	65,963,156.54
基金赎回款	-240,239,177.41	-44,425,851.22	-284,665,028.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	257,426,224.94	33,962,635.81	291,388,860.75

## 易方达裕如混合 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	15,479.25	-8,464.26	7,014.99
本期基金份额交易产生的变动数	509,646.97	78,539.91	588,186.88
其中：基金申购款	839,171.38	150,898.50	990,069.88
基金赎回款	-329,524.41	-72,358.59	-401,883.00



本期已分配利润	-	-	-
本期末	525,126.22	70,075.65	595,201.87

## 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	38,494.55
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	163,710.69
其他	1,797.25
合计	204,002.49

## 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	-3,349,896.96
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	-3,349,896.96

## 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	172,837,762.24
减：卖出股票成本总额	175,876,878.59
减：交易费用	310,780.61
买卖股票差价收入	-3,349,896.96

## 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	32,132,132.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,172,389.37

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	29,959,742.99

## 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	2,001,193,782.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,973,274,168.12
减：应计利息总额	30,058,296.21
减：交易费用	33,707.97
买卖债券差价收入	-2,172,389.37

## 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	3,402,449.87
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-277,066.62
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	3,125,383.25

## 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	120,852,337.70
减：卖出资产支持证券成本总额	120,100,000.00
减：应计利息总额	1,029,404.32
减：交易费用	-

资产支持证券投资收益	-277,066.62
------------	-------------

**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	4,447,061.42
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	4,447,061.42

**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	21,751,175.48
——股票投资	-4,059,708.62
——债券投资	23,326,884.10
——资产支持证券投资	2,484,000.00
——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	21,751,175.48

**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	307,571.93
合计	307,571.93

**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	16,500.00
其他	600.00
合计	126,195.94

#### 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
杭州银行股份有限公司	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	5,754,525.79	5,699,073.20
其中：支付销售机构的客户维护费	382,484.77	127,107.60

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 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 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托管费	959,087.64	949,845.51

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，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		
	易方达裕如混合 A	易方达裕如混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,049.71	1,049.71
合计	-	1,049.71	1,049.71
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		
	易方达裕如混合A	易方达裕如混合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。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

## 易方达裕如混合 A

无。

## 易方达裕如混合 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
杭州银行-活期存款	4,454,217.83	38,494.55	1,322,716.88	22,697.53

注：本基金的上述银行存款由基金托管人杭州银行股份有限公司 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

## 易方达裕如混合 A

本报告期内未发生利润分配。

## 易方达裕如混合 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	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-



				受限						
30120 2	朗威 股份	2023-0 6-28	1 个月 以内	新股 流通 受限	25.82	25.82	2,754	71,108 .28	71,108 .28	-
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	朗坤	2023-0	6 个月	新股	25.25	19.69	753	19,013	14,826	-

5	环境	5-15		流通受限				.25	.57	
301307	美利信	2023-04-14	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
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	-

30139 7	溯联 股份	2023-0 6-15	6 个月	新股 流通 受限	53.27	40.20	362	19,283 .74	14,552 .40	-
30139 9	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	17.80	17.89	628	11,178 .40	11,234 .92	-

				受限						
60313 7	恒尚 节能	2023-0 4-10	6 个月	新股 流通 受限	15.90	17.09	139	2,210. 10	2,375. 51	-
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	-
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	-
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 7	索辰 科技	2023-0 4-10	6 个月	新股 流通 受限	245.56	122.11	222	36,834 .00	27,108 .42	-
68851 2	慧智 微	2023-0 5-08	6 个月	新股 流通 受限	20.92	19.16	721	15,083 .32	13,814 .36	-
68852	航天	2023-0	6 个月	新股	21.86	23.85	472	10,317	11,257	-

3	环宇	5-26		流通受限				.92	.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 334,083,287.30 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
101459002	14 营口港 MTN001	2023-07-04	104.59	100,000	10,459,232.88
102100669	21 新兴际华 MTN001	2023-07-04	101.96	100,000	10,196,413.11
102101638	21 泰安城投 MTN001	2023-07-04	103.84	152,000	15,783,717.48
102280690	22 长春轨交 MTN001	2023-07-04	102.23	100,000	10,223,182.51
102280959	22 日照港 MTN001	2023-07-04	101.44	100,000	10,143,672.13
102281506	22 日照港 MTN002	2023-07-04	103.87	200,000	20,773,572.60
102300281	23 湖北宏泰 MTN001	2023-07-04	103.21	172,000	17,751,978.63
1880127	18 江北产投 债 01	2023-07-04	42.36	100,000	4,235,652.46
2020022	20 南京银行 二级 01	2023-07-04	101.62	200,000	20,324,701.64
2121062	21 北京农商 二级	2023-07-04	102.99	52,000	5,355,684.01
2180433	21 西安轨道 绿色债 01	2023-07-04	104.15	100,000	10,414,600.00
102281452	22 苏沙钢 MTN002	2023-07-05	99.27	207,000	20,548,150.23
190203	19 国开 03	2023-07-05	102.06	100,000	10,205,616.44
210303	21 进出 03	2023-07-05	101.53	600,000	60,919,278.69
230401	23 农发 01	2023-07-05	101.04	100,000	10,103,873.97
101800966	18 晋焦煤 MTN005	2023-07-06	104.80	100,000	10,479,756.16
101900025	19 吉林高速 MTN001	2023-07-06	103.29	50,000	5,164,599.73
101901732	19 平湖国资 MTN002	2023-07-06	104.25	300,000	31,274,066.30
102001517	20 广弘交通 MTN001	2023-07-06	103.60	100,000	10,360,361.10

102002307	20 粤珠江 MTN004	2023-07-06	103.45	70,000	7,241,551.39
102100194	21 中航租赁 MTN001	2023-07-06	102.72	100,000	10,272,426.85
102101481	21 陕煤化 MTN005	2023-07-06	105.95	143,000	15,151,186.93
102101634	21 吉林高速 MTN002	2023-07-06	104.23	100,000	10,423,328.22
102101638	21 泰安城投 MTN001	2023-07-06	103.84	48,000	4,984,331.84
102101654	21 华光环保 MTN001	2023-07-06	103.79	200,000	20,758,487.67
合计				3,594,000	363,549,422.97

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 113,985,665.29 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 104.60%(2022 年 12 月 31 日：112.70%)。

##### 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	10,149,835.62
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	141,254,628.35	141,618,191.78
合计	141,254,628.35	151,768,027.40

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	739,220,453.00	1,887,205,148.95
AAA 以下	426,794,474.94	427,419,797.72
未评级	82,337,065.75	119,538,324.38
合计	1,248,351,993.69	2,434,163,271.05

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	182,610,853.25	298,857,831.02
AAA 以下	19,995,838.36	19,948,206.03
未评级	0.00	0.00
合计	202,606,691.61	318,806,037.05

#### 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	4,454,217.83	-	-	-	4,454,217.83
结算备付金	16,266,774.02	-	-	-	16,266,774.02
存出保证金	161,669.87	-	-	-	161,669.87
交易性金融资产	486,333,033.50	988,842,201.23	117,038,078.92	270,819,989.03	1,863,033,302.68

					68
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	16,971,094.52	16,971,094.52
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,325,539.63	3,325,539.63
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	507,215,695.22	988,842,201.23	117,038,078.92	291,116,623.18	1,904,212,598.55
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	448,068,952.59	-	-	-	448,068,952.59
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	19,800,663.58	19,800,663.58
应付管理人报酬	-	-	-	755,290.35	755,290.35
应付托管费	-	-	-	125,881.71	125,881.71
应付销售服务费	-	-	-	862.27	862.27
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	139,708.67	139,708.67
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	537,709.18	537,709.18
负债总计	448,068,952.59	-	-	21,360,115.76	469,429,068.35
利率敏感度缺口	59,146,742.63	988,842,201.23	117,038,078.92	269,756,507.42	1,434,783,530.20
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	1,430,898.34	-	-	-	1,430,898.34
结算备付金	24,373,221.95	-	-	-	24,373,221.95
存出保证金	251,692.81	-	-	-	251,692.81

交易性金融资产	613,471,317.09	2,075,332,633.94	215,933,384.47	420,460,929.71	3,325,198,265.21
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	38,855,368.24	38,855,368.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	79,927.01	79,927.01
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	639,527,130.19	2,075,332,633.94	215,933,384.47	459,396,224.96	3,390,189,373.56
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	889,789,163.33	-	-	-	889,789,163.33
应付清算款	-	-	-	37,037,807.99	37,037,807.99
应付赎回款	-	-	-	73,219.30	73,219.30
应付管理人报酬	-	-	-	1,335,704.74	1,335,704.74
应付托管费	-	-	-	222,617.46	222,617.46
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	224,479.79	224,479.79
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	648,061.20	648,061.20
负债总计	889,789,163.33	-	-	39,541,890.48	929,331,053.81
利率敏感度缺口	-250,262,033.14	2,075,332,633.94	215,933,384.47	419,854,334.48	2,460,858,319.75

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	4,671,156.16	10,805,182.36
2.市场利率上升 25 个基点	-4,645,348.83	-10,730,658.30

#### 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	270,819,989.03	18.88	420,460,929.71	17.09
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	270,819,989.03	18.88	420,460,929.71	17.09

#### 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%	20,053,337.90	28,844,618.22
2.业绩比较基准下降 5%	-20,053,337.90	-28,844,618.22	

注：股票投资业绩基准取上证 A 指。

#### 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	436,730,266.52
第二层次	1,424,817,565.17
第三层次	1,485,470.99
合计	1,863,033,302.68

###### 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	270,819,989.03	14.22
	其中：股票	270,819,989.03	14.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,592,213,313.65	83.62
	其中：债券	1,389,606,622.04	72.98
	资产支持证券	202,606,691.61	10.64
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	20,720,991.85	1.09
8	其他各项资产	20,458,304.02	1.07
9	合计	1,904,212,598.55	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	23,130,887.64	1.61
C	制造业	150,776,825.34	10.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	40,033,222.43	2.79
F	批发和零售业	83,928.25	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,965,924.00	0.14

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,378,948.64	0.37
J	金融业	33,993,860.70	2.37
K	房地产业	12,640,867.00	0.88
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,741,468.13	0.19
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	270,819,989.03	18.88

### 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	600690	海尔智家	600,000	14,088,000.00	0.98
2	600036	招商银行	390,000	12,776,400.00	0.89
3	603806	福斯特	287,162	10,679,554.78	0.74
4	000001	平安银行	930,000	10,443,900.00	0.73
5	600519	贵州茅台	5,700	9,638,700.00	0.67
6	601800	中国交建	861,800	9,402,238.00	0.66
7	002049	紫光国微	86,500	8,066,125.00	0.56
8	601799	星宇股份	64,600	7,984,560.00	0.56
9	601668	中国建筑	1,333,500	7,654,290.00	0.53
10	002415	海康威视	224,200	7,423,262.00	0.52
11	001979	招商蛇口	566,400	7,380,192.00	0.51
12	600660	福耀玻璃	194,500	6,972,825.00	0.49
13	000786	北新建材	271,900	6,664,269.00	0.46
14	600438	通威股份	192,700	6,611,537.00	0.46
15	601390	中国中铁	854,300	6,475,594.00	0.45
16	000333	美的集团	104,300	6,145,356.00	0.43
17	601186	中国铁建	615,700	6,064,645.00	0.42
18	601012	隆基绿能	203,188	5,825,399.96	0.41
19	002541	鸿路钢构	198,788	5,727,082.28	0.40



20	601318	中国平安	121,600	5,642,240.00	0.39
21	601225	陕西煤业	302,500	5,502,475.00	0.38
22	601117	中国化学	661,076	5,473,709.28	0.38
23	000975	银泰黄金	456,900	5,345,730.00	0.37
24	002304	洋河股份	40,000	5,254,000.00	0.37
25	601728	中国电信	918,400	5,170,592.00	0.36
26	600309	万华化学	58,800	5,164,992.00	0.36
27	002142	宁波银行	202,819	5,131,320.70	0.36
28	601088	中国神华	163,000	5,012,250.00	0.35
29	000858	五粮液	30,600	5,005,242.00	0.35
30	002402	和而泰	245,550	4,169,439.00	0.29
31	600547	山东黄金	175,600	4,123,088.00	0.29
32	002371	北方华创	12,900	4,097,685.00	0.29
33	600585	海螺水泥	169,522	4,024,452.28	0.28
34	002791	坚朗五金	61,100	3,953,781.00	0.28
35	000498	山东路桥	601,500	3,861,630.00	0.27
36	300014	亿纬锂能	62,520	3,782,460.00	0.26
37	002271	东方雨虹	135,400	3,691,004.00	0.26
38	002466	天齐锂业	51,900	3,628,329.00	0.25
39	600048	保利发展	274,900	3,581,947.00	0.25
40	600188	兖矿能源	105,192	3,147,344.64	0.22
41	600875	东方电气	164,367	3,065,444.55	0.21
42	600219	南山铝业	1,000,000	3,020,000.00	0.21
43	002920	德赛西威	18,600	2,898,066.00	0.20
44	300347	泰格医药	41,900	2,704,226.00	0.19
45	002352	顺丰控股	43,600	1,965,924.00	0.14
46	000402	金融街	371,400	1,678,728.00	0.12
47	601669	中国电建	190,000	1,090,600.00	0.08
48	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.03
49	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.02
50	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
51	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.01
52	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.01
53	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.01
54	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
55	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
56	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.01
57	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.01
58	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
59	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.01
60	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
61	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.01
62	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
63	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.01

64	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
65	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.01
66	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
67	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
68	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
69	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
70	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
71	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
72	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
73	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
74	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
75	688352	顾中科技	2,361	28,497.27	0.00
76	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
77	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
78	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
79	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
80	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
81	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
82	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
83	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
84	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
85	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
86	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
87	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
88	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
89	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
90	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
91	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
92	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
93	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
94	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
95	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
96	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
97	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
98	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
99	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
100	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
101	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
102	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
103	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
104	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
105	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
106	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
107	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00

108	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
109	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
110	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
111	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
112	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
113	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
114	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
115	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
116	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
117	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
118	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
119	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
120	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
121	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
122	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
123	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
124	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
125	001367	海森药业	55	2,171.40	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	000786	北新建材	4,997,144.00	0.20
2	600875	东方电气	2,998,720.02	0.12
3	002920	德赛西威	2,988,693.00	0.12
4	603806	福斯特	1,996,587.80	0.08
5	688249	晶合集成	1,470,454.26	0.06
6	688443	智翔金泰	1,148,862.52	0.05
7	002049	紫光国微	994,241.00	0.04
8	000402	金融街	887,243.00	0.04
9	688472	阿特斯	694,882.20	0.03
10	688531	日联科技	527,234.80	0.02
11	301358	湖南裕能	480,772.02	0.02
12	301291	明阳电气	459,619.02	0.02
13	688484	南芯科技	402,739.29	0.02
14	688515	裕太微	384,836.00	0.02
15	688507	索辰科技	367,112.20	0.01
16	688146	中船特气	365,151.15	0.01
17	001286	陕西能源	361,603.20	0.01

18	688352	颀中科技	285,668.90	0.01
19	301486	致尚科技	277,921.20	0.01
20	688570	天玛智控	267,407.62	0.01

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	600941	中国移动	15,462,218.50	0.63
2	002142	宁波银行	9,147,698.87	0.37
3	601225	陕西煤业	9,051,507.00	0.37
4	600585	海螺水泥	8,206,859.00	0.33
5	300059	东方财富	7,896,171.20	0.32
6	600219	南山铝业	7,379,711.00	0.30
7	600690	海尔智家	6,966,682.00	0.28
8	601668	中国建筑	6,275,562.00	0.26
9	000001	平安银行	5,424,956.00	0.22
10	300347	泰格医药	5,241,030.00	0.21
11	001979	招商蛇口	5,198,575.00	0.21
12	002304	洋河股份	4,934,246.00	0.20
13	002541	鸿路钢构	4,741,949.00	0.19
14	600036	招商银行	4,035,487.00	0.16
15	603806	福斯特	3,235,201.60	0.13
16	000933	神火股份	2,820,548.00	0.11
17	002415	海康威视	2,783,824.00	0.11
18	002049	紫光国微	2,754,106.00	0.11
19	601012	隆基绿能	2,704,102.00	0.11
20	601800	中国交建	2,658,552.00	0.11

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	30,295,646.53
卖出股票收入（成交）总额	172,837,762.24

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	132,625,040.06	9.24
	其中：政策性金融债	91,442,667.73	6.37
4	企业债券	320,456,107.87	22.33
5	企业短期融资券	10,283,756.16	0.72
6	中期票据	758,195,669.57	52.84
7	可转债（可交换债）	168,046,048.38	11.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,389,606,622.04	96.85

#### 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	210303	21 进出 03	600,000	60,919,278.69	4.25
2	101900025	19 吉林高速 MTN001	500,000	51,645,997.26	3.60
3	102281452	22 苏沙钢 MTN002	400,000	39,706,570.49	2.77
4	101901732	19 平湖国资 MTN002	300,000	31,274,066.30	2.18
5	138681	22 铁一 Y1	300,000	31,232,375.34	2.18

#### 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	180335	工鑫 12A	600,000	60,996,364.93	4.25
2	180588	大板 A	300,000	30,578,465.75	2.13
3	112060	二发 A	200,000	20,330,328.77	1.42
4	180926	铁托 7 优	200,000	20,190,965.48	1.41
5	183916	22 保置优	200,000	20,106,579.51	1.40
6	193933	和皖 A	100,000	10,238,883.05	0.71
7	112294	星惠 3A	100,000	10,151,923.29	0.71
8	2289003	22 融腾 1B_bc	100,000	10,051,835.62	0.70
9	135290	荟享 087A	100,000	10,017,342.47	0.70
10	2289219	22 融腾 4B_bc	100,000	9,944,002.74	0.69

### 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，江苏沙钢集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。中铁一局集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到广东省茂名市应急管理局、福建省厦门市城市管理行政执法局、湖北省武汉铁路监督管理

局、吉林省白山市城市管理行政执法局、北京市住房和城乡建设委员会、广西省南宁市林业局、重庆市沙坪坝区住房和城乡建设委员会、北京市顺义区住房和城乡建设委员会、苏州市住房和城乡建设局、广州市交通运输局、陵川县人力资源和社会保障局、兰州铁路监督管理局、青岛市住房和城乡建设局、阿勒泰市自然资源局、通州区消防救援支队、宝鸡市住房和城乡建设局、淮安市淮安区住房和城乡建设局、绥阳县综合行政执法局、汉滨区住房和城乡建设局的处罚。资产支持证券大板 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。资产支持证券工鑫 12A 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	161,669.87
2	应收清算款	16,971,094.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,325,539.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,458,304.02

#### 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	11,858,023.07	0.83
2	113050	南银转债	8,007,013.05	0.56

3	123113	仙乐转债	5,735,728.50	0.40
4	113052	兴业转债	5,280,942.52	0.37
5	118022	锂科转债	4,719,244.30	0.33
6	128097	奥佳转债	4,332,758.61	0.30
7	113059	福莱转债	4,270,209.74	0.30
8	123149	通裕转债	4,212,519.83	0.29
9	127045	牧原转债	3,918,783.29	0.27
10	127061	美锦转债	3,900,600.74	0.27
11	123090	三诺转债	3,755,858.24	0.26
12	118024	冠宇转债	3,730,203.19	0.26
13	128109	楚江转债	3,546,043.89	0.25
14	127018	本钢转债	3,448,631.94	0.24
15	127068	顺博转债	3,417,237.06	0.24
16	113609	永安转债	3,396,780.30	0.24
17	113048	晶科转债	3,392,795.48	0.24
18	127050	麒麟转债	3,381,395.20	0.24
19	113021	中信转债	3,319,905.93	0.23
20	127027	能化转债	3,303,642.97	0.23
21	110088	淮 22 转债	3,258,359.19	0.23
22	127042	嘉美转债	3,227,998.06	0.22
23	113058	友发转债	3,219,712.59	0.22
24	110087	天业转债	3,173,871.37	0.22
25	127067	恒逸转 2	3,152,259.18	0.22
26	113638	台 21 转债	2,944,918.66	0.21
27	113051	节能转债	2,522,263.01	0.18
28	110085	通 22 转债	2,371,317.06	0.17
29	110043	无锡转债	2,286,804.92	0.16
30	110047	山鹰转债	2,260,863.01	0.16
31	113060	浙 22 转债	2,180,816.92	0.15
32	127005	长证转债	2,156,331.51	0.15
33	113017	吉视转债	2,093,959.76	0.15
34	128037	岩土转债	1,921,716.23	0.13
35	113045	环旭转债	1,877,793.72	0.13
36	113549	白电转债	1,870,043.84	0.13
37	113044	大秦转债	1,835,551.85	0.13
38	127066	科利转债	1,609,923.06	0.11
39	113641	华友转债	1,485,551.68	0.10
40	113656	嘉诚转债	1,436,841.44	0.10
41	123132	回盛转债	1,424,805.61	0.10
42	113651	松霖转债	1,424,726.51	0.10
43	113629	泉峰转债	1,368,443.25	0.10
44	128141	旺能转债	1,237,995.89	0.09
45	113659	莱克转债	994,915.29	0.07
46	127076	中宠转 2	878,434.46	0.06



47	110045	海澜转债	846,605.79	0.06
48	110084	贵燃转债	547,621.49	0.04
49	113625	江山转债	233,653.53	0.02
50	128090	汽模转 2	214,902.64	0.01
51	127025	冀东转债	199,100.52	0.01
52	123133	佩蒂转债	195,848.76	0.01
53	127022	恒逸转债	8,682.57	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
易方达裕如混合 A	9,315	122,431.54	1,062,986,038.10	93.21%	77,463,763.22	6.79%
易方达裕如混合 C	2,660	883.33	1,199,040.77	51.03%	1,150,625.49	48.97%
合计	11,975	95,432.11	1,064,185,078.87	93.12%	78,614,388.71	6.88%

### 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	易方达裕如混合 A	2,059,798.75	0.1806%
	易方达裕如混合 C	0.00	0.0000%
	合计	2,059,798.75	0.1802%

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	易方达裕如混合 A	>100
	易方达裕如混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达裕如混合 A	>100
	易方达裕如混合 C	0
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达裕如混合 A	易方达裕如混合 C
基金合同生效日（2015 年 3 月 24 日）基金份额总额	3,694,230,027.10	-
本报告期期初基金份额总额	1,992,115,996.04	-
本报告期基金总申购份额	256,220,416.96	3,874,855.87
减：本报告期基金总赎回份额	1,107,886,611.68	1,525,189.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,140,449,801.32	2,349,666.26

注：本基金 A 类基金份额由原基金份额变更而来，并于 2023 年 1 月 10 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，根据工作安排，陈卫剑同志不再担任杭州银行股份有限公司资产托管部总经理助理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	187,700,391.06	100.00%	118,495.46	100.00%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

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

元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；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
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	677,755,682.43	100.00%	21,535,200,000.00	100.00%	-	-

#### 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关于易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金增设 C 类基金份额等事宜并修订基金合同、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	2023-01-06
2	易方达裕如灵活配置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及在直销中心调整申购、转换转入金额限制的公告	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	2023-01-06
3	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电	2023-01-18

		子披露网站	
4	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
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裕如灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 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