

# 易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

## 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	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	14
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1	资产负债表	16
6.2	利润表	17
6.3	净资产（基金净值）变动表	18
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	53
7.1	期末基金资产组合情况	53
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	54
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	61
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	62
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	62
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62

7.12	投资组合报告附注.....	62
§ 8	基金份额持有人信息.....	65
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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.....	65
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	66
§ 9	开放式基金份额变动.....	66
§ 10	重大事件揭示.....	66
10.1	基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	67
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4	基金投资策略的改变.....	67
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8	其他重大事件.....	69
§ 11	备查文件目录.....	70
11.1	备查文件目录.....	70
11.2	存放地点.....	70
11.3	查阅方式.....	70

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金	
基金简称	易方达裕惠定开混合发起式	
基金主代码	000436	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 8 月 18 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,473,907,158.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	000436	016344
报告期末下属分级基金的份额总额	2,472,122,889.20 份	1,784,268.98 份

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

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制基金资产净值波动的基础上，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭期与开放期将采取不同的投资策略。1、封闭运作期内，本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。本基金将在严格控制投资风险前提下适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将投资股票期权、股票指数期权、场外衍生工具等金融产品。2、开放运作期内，本基金为方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将增加高流动性投资品种的投资比例，以降低基金净值的波动。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的三年期银行定期整存整取存款利率（税后）+1.75%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	龚小武
	联系电话	020-85102688	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95561
传真		020-38798812	021-62159217
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	福建省福州市台江区江滨中大 道398号兴业银行大厦
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	上海市浦东新区银城路167号4 楼
邮政编码		510620	200120
法定代表人		刘晓艳	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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）	
	易方达裕惠定开混合发 起式 A	易方达裕惠定开混合发起 式 C

本期已实现收益	110,689,063.86	46,056.62
本期利润	152,169,971.14	44,017.33
加权平均基金份额本期利润	0.0615	0.0367
本期加权平均净值利润率	3.74%	2.24%
本期基金份额净值增长率	3.67%	3.49%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
期末可供分配利润	1,560,130,820.85	1,118,603.73
期末可供分配基金份额利润	0.6311	0.6269
期末基金资产净值	4,072,226,682.68	2,931,711.91
期末基金份额净值	1.647	1.643
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
基金份额累计净值增长率	127.88%	1.77%

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

易方达裕惠定开混合发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.67%	0.14%	0.38%	0.01%	0.29%	0.13%
过去三个月	0.86%	0.16%	1.14%	0.01%	-0.28%	0.15%
过去六个月	3.67%	0.17%	2.26%	0.02%	1.41%	0.15%
过去一年	2.25%	0.17%	4.56%	0.01%	-2.31%	0.16%
过去三年	18.77%	0.17%	13.69%	0.01%	5.08%	0.16%
自基金合同生效起至今	127.88%	0.20%	41.65%	0.01%	86.23%	0.19%

易方达裕惠定开混合发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	--------------	-----	-----

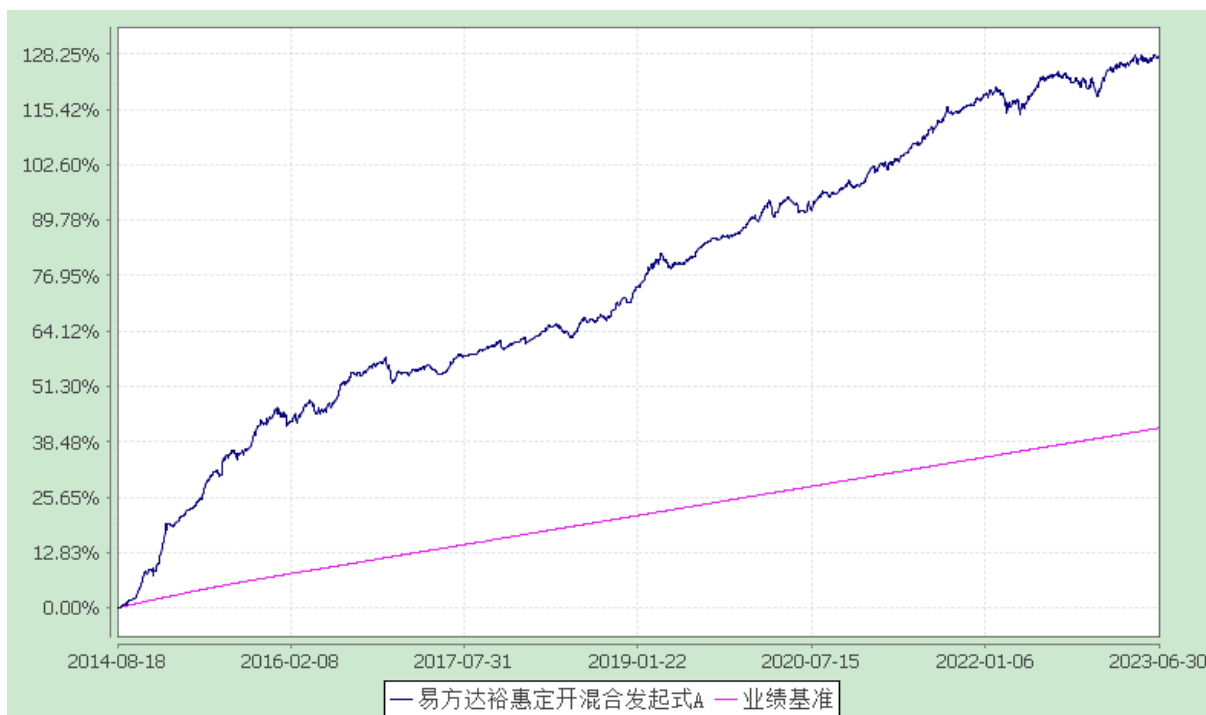
		②		准差④		
过去一个月	0.61%	0.13%	0.38%	0.01%	0.23%	0.12%
过去三个月	0.74%	0.16%	1.14%	0.01%	-0.40%	0.15%
过去六个月	3.49%	0.17%	2.26%	0.02%	1.23%	0.15%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.77%	0.18%	3.86%	0.02%	-2.09%	0.16%

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

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

易方达裕惠定开混合发起式 A

(2014 年 8 月 18 日至 2023 年 6 月 30 日)



易方达裕惠定开混合发起式 C

(2022 年 8 月 26 日至 2023 年 6 月 30 日)





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

2.自基金转型至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 127.88%，同期业绩比较基准收益率为 41.65%；C 类基金份额净值增长率为 1.77%，同期业绩比较基准收益率为 3.86%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡	本基金的基金经理，易方达稳健收	2014-	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾

剑	益债券、易方达信用债债券、易方达岁丰添利债券（LOF）、易方达恒利 3 个月定开债券发起式、易方达恒益定开债券发起式、易方达恒盛 3 个月定开混合发起式、易方达恒信定开债券发起式、易方达高等级信用债债券的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员、基础设施资产管理委员会委员	08-18			任易方达基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、固定收益投资业务总部总经理，易方达中债新综指发起式（LOF）、易方达纯债债券、易方达永旭定期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕惠回报债券、易方达瑞财混合、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达高等级信用债债券、易方达丰惠混合、易方达瑞富混合、易方达睿智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合、易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）、易方达富惠纯债债券、易方达中债 3-5 年期国债指数、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数、易方达恒惠定开债券发起式、易方达科润混合（LOF）的基金经理。
李一硕	本基金的基金经理助理，易方达永旭定期开放债券、易方达纯债 1 年定期开放债券、易方达裕如混合、易方达安源中短债债券、易方达年年恒夏纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒秋纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒春纯债一年定开债券发起式、易方达年年恒实纯债一年定开债券发起式、易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达富惠纯债债券、易方达恒安定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式的基金经理，易方达信用债债券（自 2015 年 02 月 17 日至 2023 年 04 月 28 日）、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	2015-02-17	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任瑞银证券有限公司研究员，中国国际金融有限公司研究员，易方达基金管理有限公司固定收益研究员、固定收益投资部总经理助理、固定收益特定策略投资部负责人，易方达瑞景混合、易方达富惠纯债债券、易方达新利混合、易方达新享混合、易方达恒信定开债券发起式、易方达恒惠定开债券发起式、易方达聚盈分级债券发起式、易方达恒益定开债券发起式的基金经理。

胡文伯	<p>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（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</p>	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。
-----	--	------------	------------	-----	--------------------------------------

	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、易方达裕如混合、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 年上半年经济基本面呈现疫后修复走势，但经济增长动能在二季度明显走弱。受疫后人员流动恢复带动，1-2 月份各项经济数据均出现显著回升，以餐饮为代表的社会消费品零售总额数据修复较好，基建和制造业投资保持了高位增长，地产数据也出现明显好转。出口数据则由于国际航线开放带来线下经贸往来恢复而有所好转。不过上述恢复势头自 3 月份开始走弱，4、5 月份出现加速下滑的情况。一方面消费端的改善在二季度动能下降，另一方面我们看到地产再度出现销售增速下行的压力，同时我们在 4 月份观察到企业主动去库存的情况，而基建和制造业投资边际上也有所下滑。上述各方面的下行压力，在 6 月份都有一定程度的环比企稳，仅剩地产数据依然维持颓势。

政策面整体保持了平稳的节奏。总量政策相机逐步加码，围绕推动高质量发展相关的结构性政策持续发力。货币政策方面保持流动性持续平稳，银行间资金利率中枢水平保持宽松。

在上述基本面和政策面的环境下，债券市场收益率水平出现较为显著的下行。10 年国债收益率下行 20BP，绝对收益率水平接近 2.6% 的历史低点。信用利差出现较为显著的压缩，3 年 AAA 中票与国开债的利差从 63BP 下降至 41BP。带有永续条款、次级条款等特殊条款的信用债券收益率下行幅度更大。2 年证券公司次级债、3 年 AAA 产业永续债和 4 年商业银行二级资本债年初以来收益率分别下行 79BP、60BP 和 49BP。权益市场在 1 月份有一波上涨后持续震荡走低，2023 年上半年沪深 300 指数下跌 0.75%，创业板指下跌 5.61%。行业方面分化较大，通信、传媒和计算机分别取得 51%、43% 和 28% 的正收益，而商贸零售、地产、美容护理和建筑材料等行业则下跌 11%~23%。转债表现相对较好，中证转债指数获得 3.37% 的正收益。

操作上，组合主要配置债券类资产，久期处于中性水平，以获取持有期收益为主要投资策略。权益方面，组合在一季度保持了偏高的权益资产配置，二季度之后观察到经济动能减弱，随后在 5 月中旬主动降低了股票仓位，权益市场波动对组合净值的负面影响相对有限。组合整体在上半年获得了较为稳健有竞争力的持有期回报。

#### 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 1.647 元，本报告期份额净值增长率为 3.67%，同期业绩比较基准收益率为 2.26%；C 类基金份额净值为 1.643 元，本报告期份额净值增长率为 3.49%，同期业绩比较基准收益率为 2.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为 7 月底的中共中央政治局会议之后，在政策转为更加关注扩内需、稳风险的情况下，下半年经济有望低位企稳。

目前居民消费倾向仍远低于疫情前水平，参考东南亚国家经验，消费仍有进一步修复空间。7 月份中共中央政治局会议强调着力扩大内需、提振信心，大力推动现代化产业体系建设，加快培育壮大战略性新兴产业，加强逆周期调节和政策储备。在此政策基调下，预计制造业投资和基建投资仍将维持较高增速。地产方面，跟随后续相关政策的陆续松绑，销售快速下滑的局面可能边际改善。而出口方面，考虑到欧美发达国家的经济韧性较强，出现硬着陆风险下降，出口大幅下降的风险也在减小。

然而经济增速向上的弹性有限。首先，我国总需求不足的状况需要较长时间缓解。在经济结构转型升级的过渡期，在房地产行业 and 地方政府都面临债务压力的大环境下，总需求短期难以实现快速的提升。而居民消费的提升需要收入水平和企业盈利逐步形成正向循环，而这一循环的形成也需要时间。其次，各主要行业的库销比维持在较高水平，这使得企业需要更多时间去库存。第三，2020 年疫情以来，尽管主要宏观数据均持续低于疫情前趋势线水平，但 2022 年底至 2023 年初制造业投资已经修复至疫情前趋势线水平。这说明我国实体经济层面供给端的修复快于需求侧。工业企业的产能利用率持续偏低。在高产能高库存状况下，即使需求侧有所回暖，工业企业利润回升弹性也较为有限。第四，房地产市场目前仍处于下行周期，在房地产市场供求关系发生重大变化的新形势下，即使政策有所调整，市场出现持续显著回升的可能性也相对较小。

综上，在基本面企稳，但经济向上弹性有限的大环境下，债券市场有望延续震荡的行情。债券组合的配置将以重点获取持有期收益为主，坚持相对中性的配置思路，积极运用杠杆、骑乘、期限结构、类属等结构性策略，并在出现收益率上行的机会时积极增加久期和仓位，争取为投资者提供稳定持续的投资收益。权益方面，考虑股票市场估值处于偏低水平，且下半年中微观层面的需求刺激政策有利于提振市场情绪，本组合计划维持目前的仓位，坚持稳健的投资风格，并积极关注结构性的投资机会，深耕个股，选择有安全边际且有增长潜力的品种长期持有，争取为投资者提供持续有竞争力的投资回报。

#### 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

易方达裕惠定开混合发起式 A:本报告期内实施的利润分配金额为 170,371,055.27 元。

易方达裕惠定开混合发起式 C:本报告期内实施的利润分配金额为 31,707.72 元。

#### 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

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

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

报告截止日：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	5,247,740.39	1,493,237.02
结算备付金		42,216,230.92	56,290,848.44
存出保证金		197,139.53	233,945.08
交易性金融资产	6.4.7.2	6,444,546,054.71	6,365,753,754.86
其中：股票投资		470,593,521.74	651,151,106.81
基金投资		-	-
债券投资		5,456,824,477.05	5,204,703,227.04
资产支持证券投资		517,128,055.92	509,899,421.01
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		3,311,922.03	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-



递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		6,495,519,087.58	6,423,771,785.40
<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		2,418,007,027.51	2,213,897,017.08
应付清算款		41,650.69	302,963.83
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,336,760.24	1,433,432.24
应付托管费		334,190.06	358,358.05
应付销售服务费		961.87	270.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		363,722.26	402,389.37
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	276,380.36	464,943.05
负债合计		2,420,360,692.99	2,216,859,374.06
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,473,907,158.18	2,543,332,142.13
未分配利润	6.4.7.8	1,601,251,236.41	1,663,580,269.21
净资产合计		4,075,158,394.59	4,206,912,411.34
负债和净资产总计		6,495,519,087.58	6,423,771,785.40

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.647 元，C 类基金份额净值 1.643 元；基金份额总额 2,473,907,158.18 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 2,472,122,889.20 份，C 类基金份额总额 1,784,268.98 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

本报告期：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		183,977,913.12	102,491,694.71
1.利息收入		410,884.34	603,393.73
其中：存款利息收入	6.4.7.9	410,884.34	567,315.73

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		-	36,078.00
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		141,118,634.92	102,160,714.00
其中：股票投资收益	6.4.7.10	39,066,671.56	15,087,193.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	90,170,338.13	76,715,842.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	7,028,894.24	5,017,195.71
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	4,852,730.99	5,340,483.19
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	41,478,867.99	-1,038,594.98
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	969,525.87	766,181.96
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>31,763,924.65</b>	<b>24,412,692.58</b>
1. 管理人报酬		8,098,790.28	6,892,515.02
2. 托管费		2,024,697.54	1,723,128.74
3. 销售服务费		3,877.99	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		21,222,809.91	15,396,757.00
其中：卖出回购金融资产支出		21,222,809.91	15,396,757.00
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		260,392.24	255,095.61
8. 其他费用	6.4.7.18	153,356.69	145,196.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>152,213,988.47</b>	<b>78,079,002.13</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>152,213,988.47</b>	<b>78,079,002.13</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>152,213,988.47</b>	<b>78,079,002.13</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金

本报告期：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)	2,543,332,142.13	1,663,580,269.21	4,206,912,411.34
二、本期期初净资产(基金净值)	2,543,332,142.13	1,663,580,269.21	4,206,912,411.34
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-69,424,983.95	-62,329,032.80	-131,754,016.75
(一)、综合收益总额	-	152,213,988.47	152,213,988.47
(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)	-69,424,983.95	-44,140,258.28	-113,565,242.23
其中：1.基金申购款	846,281,911.97	534,002,887.06	1,380,284,799.03
2.基金赎回款	-915,706,895.92	-578,143,145.34	-1,493,850,041.26
(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)	-	-170,402,762.99	-170,402,762.99
四、本期期末净资产(基金净值)	2,473,907,158.18	1,601,251,236.41	4,075,158,394.59
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)	1,789,783,380.60	1,406,164,265.57	3,195,947,646.17
二、本期期初净资产(基金净值)	1,789,783,380.60	1,406,164,265.57	3,195,947,646.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	511,789,604.42	153,064,186.81	664,853,791.23
(一)、综合收益总额	-	78,079,002.13	78,079,002.13
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	511,789,604.42	327,541,929.91	839,331,534.33

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	1,208,793,216.91	772,325,164.81	1,981,118,381.72
2.基金赎回款	-697,003,612.49	-444,783,234.90	-1,141,786,847.39
(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)	-	-252,556,745.23	-252,556,745.23
四、本期期末净资产(基金净值)	2,301,572,985.02	1,559,228,452.38	3,860,801,437.40

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

易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金由易方达裕惠回报债券型证券投资基金转换运作方式、变更基金类别及修改其他相关事项而来。《关于易方达裕惠回报债券型证券投资基金转换运作方式、变更基金类别及修改其他相关事项的议案》经 2014 年 8 月 18 日易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过。自 2014 年 8 月 18 日起，由《易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金合同》修订而成的《易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金合同》生效。易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

原易方达裕惠回报债券型证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1375 号《关于核准易方达裕惠回报债券型证券投资基金募集的批复》注册，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,000,083,493.89 份基金份额，其中认购资金利息折合 40,006.81 份基金份额。根据《易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金合同》的约定，原易方达裕惠回报债券型证券投资基金为契约型开放式基金，存续期限不定。原易方达裕惠回报债券型证券投资基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份

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

#### 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	5,247,740.39
等于：本金	5,247,587.17
加：应计利息	153.22
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	5,247,740.39

##### 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	472,404,025.17	-	470,593,521.74	-1,810,503.43	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所 市场	15,247,646.18	1,549,798,356.43	-12,519,656.04	
	银行间 市场	3,834,378,642.17	3,907,026,120.62	20,321,357.83	
	合计	5,381,449,008.46	67,573,766.80	5,456,824,477.05	7,801,701.79

资产支持证券	511,892,904.11	6,066,055.92	517,128,055.92	-830,904.11
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,365,745,937.74	73,639,822.72	6,444,546,054.71	5,160,294.25

### 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	165,052.69
其中：交易所市场	89,667.66
银行间市场	75,385.03
应付利息	-
预提费用	111,327.67
合计	276,380.36

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 易方达裕惠定开混合发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	2,542,851,722.15	2,542,851,722.15
本期申购	844,668,386.53	844,668,386.53
本期赎回（以“-”号填列）	-915,397,219.48	-915,397,219.48
本期末	2,472,122,889.20	2,472,122,889.20

## 易方达裕惠定开混合发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期 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	480,419.98	480,419.98
本期申购	1,613,525.44	1,613,525.44
本期赎回（以“-”号填列）	-309,676.44	-309,676.44
本期末	1,784,268.98	1,784,268.98

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

## 易方达裕惠定开混合发起式 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,662,094,043.06	1,173,065.87	1,663,267,108.93
本期利润	110,689,063.86	41,480,907.28	152,169,971.14
本期基金份额交易产生的变动数	-42,281,230.80	-2,681,000.52	-44,962,231.32
其中：基金申购款	513,086,485.12	19,900,511.29	532,986,996.41
基金赎回款	-555,367,715.92	-22,581,511.81	-577,949,227.73
本期已分配利润	-170,371,055.27	-	-170,371,055.27
本期末	1,560,130,820.85	39,972,972.63	1,600,103,793.48

## 易方达裕惠定开混合发起式 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	312,925.11	235.17	313,160.28
本期利润	46,056.62	-2,039.29	44,017.33
本期基金份额交易产生的变动数	791,329.72	30,643.32	821,973.04
其中：基金申购款	978,309.05	37,581.60	1,015,890.65
基金赎回款	-186,979.33	-6,938.28	-193,917.61
本期已分配利润	-31,707.72	-	-31,707.72

本期末	1,118,603.73	28,839.20	1,147,442.93
-----	--------------	-----------	--------------

#### 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	24,102.47
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	384,885.69
其他	1,896.18
合计	410,884.34

#### 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	39,066,671.56
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	39,066,671.56

##### 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	446,554,218.26
减：卖出股票成本总额	406,531,266.52
减：交易费用	956,280.18
买卖股票差价收入	39,066,671.56

#### 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	79,008,366.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,161,971.26
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	90,170,338.13

## 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	2,913,570,568.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,853,563,654.57
减：应计利息总额	48,786,460.72
减：交易费用	58,481.98
买卖债券差价收入	11,161,971.26

## 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	7,216,492.88
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-187,598.64
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	7,028,894.24

## 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	49,461,072.27
减：卖出资产支持证券成本总额	48,763,598.64
减：应计利息总额	885,072.27
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-187,598.64

**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	4,852,730.99
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	4,852,730.99

**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	41,478,867.99
——股票投资	-4,990,529.17
——债券投资	42,729,798.52
——资产支持证券投资	3,739,598.64
——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	41,478,867.99

**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	969,433.65
其他	92.22
合计	969,525.87

**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	51,820.30
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	16,900.00
银行汇划费	24,529.02
其他	600.00
合计	153,356.69

#### 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
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东

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	8,098,790.28	6,892,515.02
其中：支付销售机构的客户维护费	1,276,203.08	540,125.29

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

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	2,024,697.54	1,723,128.74

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

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			
获得销售服务费的各关联方名称	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	386.48	386.48
合计	-	386.48	386.48
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			
获得销售服务费的各关联方名称	易方达裕惠定开混合发起式A	易方达裕惠定开混合发起式C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 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
兴业银行	-	-	-	-	390,000,000.00	16,398.50
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自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自有资金投资本基金。

##### 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

###### 易方达裕惠定开混合发起式 A

无。

###### 易方达裕惠定开混合发起式 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
兴业银行-活期存款	5,247,740.39	24,102.47	1,833,494.88	25,048.64

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

#### 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

##### 易方达裕惠定开混合发起式 A

单位：人民币元

序号	权益登记 日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2023-02-14	-	2023- 02-14	0.670	158,128,867. 75	12,242,187.5 2	170,371,055. 27	-
合计				0.670	158,128,867. 75	12,242,187.5 2	170,371,055. 27	-

##### 易方达裕惠定开混合发起式 C

单位：人民币元

序号	权益登记 日	除息日	每 10 份 基金份额	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总	利润分配合 计	备注
----	-----------	-----	----------------	--------------	--------------	------------	----

		场 内	场 外	分红数		额		
1	2023-02-14	-	2023-02-14	0.660	17,868.30	13,839.42	31,707.72	-
合计				0.660	17,868.30	13,839.42	31,707.72	-

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

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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

301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月以内	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月以内	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	338	10,647.38	8,483.80	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301292	海科新源	2023-06-29	1个月以内	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6个月	新股流通	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

				受限						
30130 1	川宁 生物	2022-1 2-20	6 个月	新股 流通 受限	5.00	8.96	3,574	17,870 .00	32,023 .04	-
30130 5	朗坤 环境	2023-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	25.25	19.69	753	19,013 .25	14,826 .57	-
30130 7	美利 信	2023-0 4-14	6 个月	新股 流通 受限	32.34	31.86	687	22,217 .58	21,887 .82	-
30131 5	威士 顿	2023-0 6-13	6 个月	新股 流通 受限	32.29	51.12	226	7,297. 54	11,553 .12	-
30132 0	豪江 智能	2023-0 6-01	6 个月	新股 流通 受限	13.06	20.62	642	8,384. 52	13,238 .04	-
30132 3	新莱 福	2023-0 5-29	6 个月	新股 流通 受限	39.06	39.36	228	8,905. 68	8,974. 08	-
30133 2	德尔 玛	2023-0 5-09	6 个月	新股 流通 受限	14.81	13.73	1,122	16,616 .82	15,405 .06	-
30133 7	亚华 电子	2023-0 5-16	6 个月	新股 流通 受限	32.60	30.37	232	7,563. 20	7,045. 84	-
30134 5	涛涛 车业	2023-0 3-10	6 个月	新股 流通 受限	73.45	46.64	266	19,537 .70	12,406 .24	-
30135 5	南王 科技	2023-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	17.55	16.75	563	9,880. 65	9,430. 25	-
30135 8	湖南 裕能	2023-0 2-01	6 个月	新股 流通 受限	23.77	42.89	2,023	48,086 .71	86,766 .47	-
30136 0	荣旗 科技	2023-0 4-17	6 个月	新股 流通 受限	71.88	92.60	134	9,631. 92	12,408 .40	-
30137 3	凌玮 科技	2023-0 1-20	6 个月	新股 流通 受限	33.73	31.85	277	9,343. 21	8,822. 45	-
30137 6	致欧 科技	2023-0 6-14	6 个月	新股 流通 受限	24.66	22.51	420	10,357 .20	9,454. 20	-
30138	蜂助	2023-0	6 个月	新股	23.80	32.84	408	9,710.	13,398	-

2	手	5-09		流通受限				40	.72	
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月以内	新股流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月以内	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
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	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
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	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
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	3,033	114,890.04	89,443.17	-
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	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股流通	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-

				受限						
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	-
688486	龙迅股份	2023-02-10	6 个月	新股流通受限	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	-
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	-
688522	纳睿雷达	2023-02-22	6 个月	新股流通受限	46.68	51.50	4,299	200,677.32	221,398.50	-
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	-
68859	新相	2023-0	6 个月	新股	11.18	14.59	959	10,721	13,991	-

3	微	5-25		流通受限				.62	.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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	4,592,000	28,262,201.49	32,006,240.00	-

#### 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 1,956,041,946.80 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
101900292	19 首创集 MTN001	2023-07-03	102.44	100,000	10,243,579.23
101900356	19 泰州城建 MTN001	2023-07-03	102.78	200,000	20,555,956.28
101900710	19 五矿 MTN001	2023-07-03	101.94	100,000	10,194,497.27
101901099	19 陕煤化 MTN003	2023-07-03	104.88	500,000	52,440,465.75
101901600	19 陕煤化	2023-07-03	104.30	335,000	34,941,918.93



	MTN006				
102000020	20 豫交投 MTN001	2023-07-03	103.52	100,000	10,351,604.38
102000560	20 镜湖开发 MTN001	2023-07-03	101.70	100,000	10,170,032.79
102000628	20 京能洁能 MTN001	2023-07-03	101.80	100,000	10,180,120.22
102001982	20 长发集团 MTN004	2023-07-03	103.28	100,000	10,327,731.51
102101163	21 大连港 MTN002	2023-07-03	101.20	100,000	10,120,455.74
102103326	21 泰州城建 MTN003	2023-07-03	102.58	100,000	10,257,986.30
102200198	22 北辰实业 MTN002	2023-07-03	103.07	100,000	10,306,737.53
102280066	22 闽投 MTN001	2023-07-03	101.89	300,000	30,566,702.47
102280406	22 百联集 MTN001	2023-07-03	101.29	300,000	30,387,934.43
102280502	22 芜湖宜居 MTN001	2023-07-03	101.79	100,000	10,179,438.25
102280694	22 粤珠江 MTN001	2023-07-03	101.70	100,000	10,169,822.95
102280956	22 中建投资 MTN002	2023-07-03	100.94	100,000	10,093,901.64
102281494	22 冀建投 MTN002	2023-07-03	103.77	200,000	20,753,873.97
102281543	22 粤珠江 MTN004	2023-07-03	103.30	200,000	20,659,589.04
102281701	22 余姚城投 MTN002	2023-07-03	101.66	100,000	10,166,251.51
102281755	22 渝高速 MTN003(乡村 振兴)	2023-07-03	101.99	300,000	30,596,210.96
102281814	22 苏州高技 MTN003	2023-07-03	101.87	300,000	30,559,923.29
102281880	22 吉林高速 MTN002	2023-07-03	101.91	100,000	10,191,040.55
102282337	22 渝高速 MTN004	2023-07-03	101.40	100,000	10,139,589.04
102282540	22 大唐集 MTN010	2023-07-03	103.31	600,000	61,984,060.27
102282588	22 中电投 MTN036	2023-07-03	102.94	300,000	30,881,243.84

102282600	22 中电投 MTN037	2023-07-03	102.41	45,000	4,608,308.71
102282703	22 中核 MTN002	2023-07-03	105.13	100,000	10,513,189.04
102380854	23 湘高速 MTN002	2023-07-03	100.74	202,000	20,348,541.75
102380893	23 中电投 MTN009	2023-07-03	101.30	400,000	40,518,911.48
102381173	23 中电投 MTN016	2023-07-03	100.68	500,000	50,340,027.32
042280564	22 三门峡 CP004	2023-07-04	104.15	100,000	10,415,289.32
101459002	14 营口港 MTN001	2023-07-04	104.59	200,000	20,918,465.75
101659041	16 柯桥国资 MTN001	2023-07-04	103.87	100,000	10,386,956.71
101754118	17 淄博资运 MTN002	2023-07-04	105.86	100,000	10,586,082.19
101801234	18 新盛建设 MTN004	2023-07-04	104.22	100,000	10,421,606.03
101900627	19 重庆交投 MTN002	2023-07-04	102.53	100,000	10,252,748.63
101901534	19 锡产业 MTN002	2023-07-04	104.75	100,000	10,475,169.86
102000385	20 无锡住保 MTN001	2023-07-04	102.84	100,000	10,283,838.25
102000723	20 长春轨交 MTN003B	2023-07-04	101.55	100,000	10,154,606.56
102001873	20 通顺交投 MTN001	2023-07-04	105.18	100,000	10,518,122.19
102001970	20 开滦股 MTN001	2023-07-04	102.04	100,000	10,203,542.47
102002266	20 冀交投 MTN004	2023-07-04	103.29	200,000	20,657,468.49
102002312	20 信达地产 MTN003	2023-07-04	103.22	100,000	10,321,794.52
102100738	21 中科实业 MTN001	2023-07-04	102.20	100,000	10,219,595.63
102100871	21 东南国资 MTN001	2023-07-04	101.44	200,000	20,288,721.31
102101348	21 湘投 MTN001	2023-07-04	104.38	100,000	10,438,024.66
102101419	21 天恒置业 MTN002	2023-07-04	103.82	100,000	10,381,906.85

102101526	21 中节能 MTN002	2023-07-04	103.57	200,000	20,714,739.73
102101563	21 乐清国投 MTN001	2023-07-04	103.59	100,000	10,358,581.37
102101624	21 吴江城投 MTN002	2023-07-04	103.48	100,000	10,348,298.08
102101984	21 威海城投 MTN003	2023-07-04	103.56	100,000	10,355,664.11
102102231	21 天津港 MTN003	2023-07-04	104.98	100,000	10,498,441.10
102103015	21 安东控股 MTN001	2023-07-04	104.09	100,000	10,408,616.44
102180032	21 韵达股份 MTN003	2023-07-04	102.49	100,000	10,249,410.96
102200088	22 绿城地产 MTN001	2023-07-04	101.36	100,000	10,136,469.04
102200108	22 中交房产 MTN001	2023-07-04	101.46	300,000	30,438,049.18
102200120	22 华电租赁 MTN001	2023-07-04	101.73	100,000	10,172,701.64
102280403	22 格力 MTN002	2023-07-04	101.62	100,000	10,161,749.73
102280679	22 鲁能源 MTN003A(可 持续挂钩)	2023-07-04	101.99	100,000	10,198,927.87
102280717	22 厦钨 MTN002	2023-07-04	101.50	100,000	10,150,039.34
102280763	22 交子公园 MTN001	2023-07-04	101.23	100,000	10,123,163.93
102280802	22 宿迁城投 MTN002	2023-07-04	100.93	100,000	10,093,333.33
102280952	22 闽西兴杭 MTN001	2023-07-04	101.35	100,000	10,134,875.41
102281070	22 京城建 MTN001	2023-07-04	100.59	100,000	10,058,638.25
102281079	22 成华棚改 MTN001	2023-07-04	100.76	200,000	20,152,561.75
102281131	22 嘉公路 MTN001A	2023-07-04	99.95	124,000	12,393,264.70
102281310	22 吴中经发 MTN001	2023-07-04	100.16	52,000	5,208,180.20
102281646	22 中航租赁 MTN006	2023-07-04	102.60	100,000	10,259,585.75
102282269	22 海宁城投	2023-07-04	101.08	100,000	10,107,912.33

	MTN004				
102282583	22 漳州交通 MTN006	2023-07-04	103.10	100,000	10,310,311.23
102380023	23 南安市贸 MTN001	2023-07-04	105.15	100,000	10,514,802.74
102380187	23 嘉兴现代 MTN001	2023-07-04	102.61	100,000	10,260,936.99
102380338	23 成华棚改 MTN001	2023-07-04	102.66	100,000	10,265,835.62
102380904	23 锡产业 MTN001(可持 续挂钩)	2023-07-04	101.74	100,000	10,174,344.26
102381200	23 首创生态 MTN001	2023-07-04	101.06	100,000	10,105,794.54
131900019	19 重庆轨交 GN001	2023-07-04	104.84	300,000	31,450,765.48
132280048	22 融和融资 GN002(碳中 和债)	2023-07-04	100.60	100,000	10,059,814.21
101801461	18 陕煤化 MTN006	2023-07-05	103.34	100,000	10,334,329.32
101901550	19 金隅 MTN003	2023-07-05	104.54	500,000	52,271,460.27
101901600	19 陕煤化 MTN006	2023-07-05	104.30	102,000	10,639,032.03
102100194	21 中航租赁 MTN001	2023-07-05	102.72	200,000	20,544,853.70
102100821	21 晋焦煤 MTN001	2023-07-05	101.97	143,000	14,581,827.21
102101506	21 中航租赁 MTN006	2023-07-05	103.92	200,000	20,784,729.86
102101527	21 首钢 MTN002A	2023-07-05	103.73	200,000	20,746,031.78
112381038	23 汉口银行 CD197	2023-07-05	99.56	1,000,000	99,563,459.78
101801549	18 吉林高速 MTN004	2023-07-06	103.84	100,000	10,384,268.49
101900307	19 吉林高速 MTN002	2023-07-06	102.86	84,000	8,640,372.20
101900795	19 闽投 MTN003	2023-07-06	101.90	200,000	20,379,807.65
102000733	20 豫高管 MTN002	2023-07-06	101.41	200,000	20,282,406.56
102001888	20 盐城东方	2023-07-06	104.39	100,000	10,439,424.66

	MTN001				
102002269	20 金融街 MTN003	2023-07-06	102.82	300,000	30,844,913.42
102100669	21 新兴际华 MTN001	2023-07-06	101.96	300,000	30,589,239.34
102101764	21 临沂城投 MTN002(革命 老区)	2023-07-06	103.19	100,000	10,319,110.14
102103158	21 滨州城建 MTN001	2023-07-06	103.19	100,000	10,319,235.62
102281069	22 九江城发 MTN001	2023-07-06	100.58	100,000	10,057,560.66
102281310	22 吴中经发 MTN001	2023-07-06	100.16	300,000	30,047,193.44
102281864	22 豫投资 MTN002	2023-07-06	101.96	400,000	40,785,240.55
102282390	22 盐城交通 MTN004	2023-07-06	101.23	100,000	10,122,841.10
102282600	22 中电投 MTN037	2023-07-06	102.41	255,000	26,113,749.37
102282626	22 广安控股 MTN002	2023-07-06	103.36	100,000	10,335,736.99
102380040	23 武汉车都 MTN001	2023-07-06	103.51	300,000	31,052,753.42
102380060	23 海曙广聚 MTN001	2023-07-06	103.67	100,000	10,367,276.71
102380854	23 湘高速 MTN002	2023-07-06	100.74	298,000	30,019,135.85
102381179	23 淮河能源 MTN002	2023-07-06	100.91	100,000	10,091,185.79
132380026	23 郑州地铁 GN001	2023-07-06	101.11	100,000	10,110,846.99
230202	23 国开 02	2023-07-06	101.80	2,000,000	203,606,794.52
230203	23 国开 03	2023-07-06	102.14	1,000,000	102,138,986.30
合计				20,940,000	2,143,053,198.89

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 461,965,080.71 元，于 2023 年 7 月 3 日、2023 年 7 月 6 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，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

##### 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 133.83%(2022 年 12 月 31 日：131.75%)。

##### 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	213,620,050.85	81,102,803.83
合计	213,620,050.85	81,102,803.83

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	2,657,706,255.43	3,370,224,505.64
AAA 以下	792,924,397.41	976,988,862.20
未评级	1,693,010,313.58	776,387,055.37
合计	5,143,640,966.42	5,123,600,423.21

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	497,132,217.56	489,951,214.98
AAA 以下	19,995,838.36	19,948,206.03
未评级	0.00	0.00
合计	517,128,055.92	509,899,421.01

#### 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	99,563,459.78	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	99,563,459.78	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	5,247,740.39	-	-	-	5,247,740.39
结算备付金	42,216,230.92	-	-	-	42,216,230.92
存出保证金	197,139.53	-	-	-	197,139.53
交易性金融资产	1,320,659,736.16	4,365,814,383.28	287,478,413.53	470,593,521.74	6,444,546,054.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	3,311,922.03	3,311,922.03
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,368,320,847.00	4,365,814,383.28	287,478,413.53	473,905,443.77	6,495,519,087.58
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,418,007,027.51	-	-	-	2,418,007,027.51
应付清算款	-	-	-	41,650.69	41,650.69
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,336,760.24	1,336,760.24
应付托管费	-	-	-	334,190.06	334,190.06

应付销售服务费	-	-	-	961.87	961.87
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	363,722.26	363,722.26
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	276,380.36	276,380.36
负债总计	2,418,007,027.51	-	-	2,353,665.48	2,420,360,692.99
利率敏感度缺口	-1,049,686,180.51	4,365,814,383.28	287,478,413.53	471,551,778.29	4,075,158,394.59
<b>上年度末</b>					
<b>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	1,493,237.02	-	-	-	1,493,237.02
结算备付金	56,290,848.44	-	-	-	56,290,848.44
存出保证金	233,945.08	-	-	-	233,945.08
交易性金融资产	1,314,531,413.51	3,491,711,097.67	908,360,136.87	651,151,106.81	6,365,753,754.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,372,549,444.05	3,491,711,097.67	908,360,136.87	651,151,106.81	6,423,771,785.40
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,213,897,017.08	-	-	-	2,213,897,017.08
应付清算款	-	-	-	302,963.83	302,963.83
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,433,432.24	1,433,432.24

应付托管费	-	-	-	358,358.05	358,358.05
应付销售服务费	-	-	-	270.44	270.44
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	402,389.37	402,389.37
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	464,943.05	464,943.05
负债总计	2,213,897,017.08	-	-	2,962,356.98	2,216,859,374.06
利率敏感度缺口	-841,347,573.03	3,491,711,097.67	908,360,136.87	648,188,749.83	4,206,912,411.34

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	23,932,680.51	18,460,316.39
2.市场利率上升25个基点	-23,758,635.12	-18,335,426.72	

#### 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	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	470,593,521.74	11.55	651,151,106.81	15.48
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>470,593,521.74</b>	<b>11.55</b>	<b>651,151,106.81</b>	<b>15.48</b>

#### 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%	35,523,841.56	58,098,075.94
	2.业绩比较基准下降5%	-35,523,841.56	-58,098,075.94

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	884,082,388.46
第二层次	5,558,471,999.91
第三层次	1,991,666.34
合计	6,444,546,054.71

#### 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	470,593,521.74	7.24
	其中：股票	470,593,521.74	7.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,973,952,532.97	91.97
	其中：债券	5,456,824,477.05	84.01
	资产支持证券	517,128,055.92	7.96
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	47,463,971.31	0.73
8	其他各项资产	3,509,061.56	0.05

9	合计	6,495,519,087.58	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	3,081,165.00	0.08
B	采矿业	594,945.00	0.01
C	制造业	281,587,607.64	6.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,115,524.47	0.10
E	建筑业	12,032,603.95	0.30
F	批发和零售业	83,928.25	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	82,207,042.76	2.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,429,539.51	1.09
J	金融业	26,925,640.48	0.66
K	房地产业	6,886,248.68	0.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,695,898.47	0.16
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	1,938,550.96	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	470,593,521.74	11.55

## 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	600018	上港集团	6,244,600	32,784,150.00	0.80
2	601298	青岛港	4,592,000	32,006,240.00	0.79

3	601728	中国电信	4,353,800	24,511,894.00	0.60
4	600941	中国移动	210,563	19,645,527.90	0.48
5	601799	星宇股份	155,518	19,222,024.80	0.47
6	600150	中国船舶	472,100	15,536,811.00	0.38
7	600519	贵州茅台	9,000	15,219,000.00	0.37
8	600685	中船防务	437,007	13,088,359.65	0.32
9	603596	伯特利	163,437	12,954,016.62	0.32
10	002906	华阳集团	362,400	12,390,456.00	0.30
11	688007	光峰科技	519,456	10,830,657.60	0.27
12	002920	德赛西威	67,057	10,448,151.17	0.26
13	300760	迈瑞医疗	34,600	10,373,080.00	0.25
14	600660	福耀玻璃	276,300	9,905,355.00	0.24
15	000858	五粮液	59,800	9,781,486.00	0.24
16	600346	恒力石化	668,700	9,582,471.00	0.24
17	600690	海尔智家	404,952	9,508,272.96	0.23
18	603348	文灿股份	216,100	9,467,341.00	0.23
19	600873	梅花生物	1,012,414	9,040,857.02	0.22
20	301029	怡合达	201,800	9,016,424.00	0.22
21	002415	海康威视	260,100	8,611,911.00	0.21
22	601601	中国太保	303,238	7,878,123.24	0.19
23	300059	东方财富	498,168	7,073,985.60	0.17
24	300347	泰格医药	103,171	6,658,656.34	0.16
25	600585	海螺水泥	275,710	6,545,355.40	0.16
26	000786	北新建材	266,200	6,524,562.00	0.16
27	600104	上汽集团	430,200	6,095,934.00	0.15
28	601111	中国国航	620,528	5,113,150.72	0.13
29	601598	中国外运	1,094,900	5,102,234.00	0.13
30	000402	金融街	1,072,509	4,847,740.68	0.12
31	002493	荣盛石化	415,100	4,831,764.00	0.12
32	601611	中国核建	553,700	4,678,765.00	0.11
33	000333	美的集团	78,300	4,613,436.00	0.11
34	601318	中国平安	95,190	4,416,816.00	0.11
35	601238	广汽集团	417,900	4,354,518.00	0.11
36	600030	中信证券	210,955	4,172,689.90	0.10
37	002375	亚厦股份	825,827	3,864,870.36	0.09
38	000401	冀东水泥	491,273	3,620,682.01	0.09
39	603606	东方电缆	72,500	3,554,675.00	0.09
40	002402	和而泰	201,900	3,428,262.00	0.08
41	000001	平安银行	301,338	3,384,025.74	0.08
42	688660	电气风电	593,519	3,305,900.83	0.08
43	688169	石头科技	10,030	3,216,420.40	0.08
44	002714	牧原股份	73,100	3,081,165.00	0.08
45	601633	长城汽车	117,800	2,965,026.00	0.07
46	600438	通威股份	84,400	2,895,764.00	0.07

47	600029	南方航空	458,768	2,766,371.04	0.07
48	002202	金风科技	256,495	2,723,976.90	0.07
49	000933	神火股份	197,400	2,566,200.00	0.06
50	002532	天山铝业	419,100	2,510,409.00	0.06
51	601669	中国电建	420,572	2,414,083.28	0.06
52	603486	科沃斯	30,911	2,403,948.47	0.06
53	603885	吉祥航空	155,200	2,394,736.00	0.06
54	600703	三安光电	132,900	2,291,196.00	0.06
55	601989	中国重工	472,100	2,275,522.00	0.06
56	002180	纳思达	65,600	2,246,800.00	0.06
57	600027	华电国际	309,100	2,067,879.00	0.05
58	600426	华鲁恒升	67,190	2,058,029.70	0.05
59	603713	密尔克卫	22,900	2,040,161.00	0.05
60	000002	万科 A	145,400	2,038,508.00	0.05
61	600011	华能国际	217,300	2,012,198.00	0.05
62	002821	凯莱英	16,800	1,980,048.00	0.05
63	300015	爱尔眼科	103,222	1,914,768.10	0.05
64	601877	正泰电器	47,977	1,326,564.05	0.03
65	300850	新强联	33,110	1,237,651.80	0.03
66	000778	新兴铸管	277,384	1,131,726.72	0.03
67	601117	中国化学	128,547	1,064,369.16	0.03
68	601012	隆基绿能	32,728	938,311.76	0.02
69	002250	联化科技	78,600	822,156.00	0.02
70	600583	海油工程	101,700	594,945.00	0.01
71	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.01
72	002179	中航光电	6,815	309,060.25	0.01
73	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.01
74	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
75	688522	纳睿雷达	4,299	221,398.50	0.01
76	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.00
77	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.00
78	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.00
79	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.00
80	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
81	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
82	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
83	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
84	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
85	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
86	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.00
87	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
88	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
89	688247	宣泰医药	6,431	81,995.25	0.00
90	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.00



91	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
92	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
93	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
94	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
95	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
96	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
97	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
98	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
99	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
100	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
101	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
102	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
103	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
104	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
105	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
106	301339	通行宝	913	22,943.69	0.00
107	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.00
108	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
109	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
110	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
111	301171	易点天下	885	19,558.50	0.00
112	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
113	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
114	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
115	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
116	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
117	301296	新巨丰	942	15,900.96	0.00
118	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
119	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
120	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
121	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
122	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
123	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
124	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
125	301338	凯格精机	360	14,004.00	0.00
126	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
127	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
128	301132	满坤科技	468	13,754.52	0.00
129	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
130	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
131	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
132	301282	金禄电子	434	13,046.04	0.00
133	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
134	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00

135	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
136	301270	汉仪股份	210	11,468.10	0.00
137	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
138	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
139	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
140	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
141	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
142	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
143	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
144	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
145	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
146	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
147	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
148	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
149	301281	科源制药	338	8,483.80	0.00
150	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
151	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
152	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
153	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
154	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
155	301300	远翔新材	211	6,667.60	0.00
156	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
157	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
158	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
159	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
160	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
161	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
162	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
163	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	600018	上港集团	38,631,069.00	0.92
2	601298	青岛港	31,462,625.00	0.75
3	603596	伯特利	19,678,784.63	0.47
4	002920	德赛西威	19,671,628.00	0.47
5	002906	华阳集团	17,987,304.22	0.43
6	301029	怡合达	14,347,345.00	0.34

7	603348	文灿股份	13,841,605.00	0.33
8	600685	中船防务	11,186,017.41	0.27
9	601601	中国太保	9,996,971.00	0.24
10	600150	中国船舶	9,694,588.00	0.23
11	601799	星宇股份	7,987,247.00	0.19
12	600873	梅花生物	5,732,058.00	0.14
13	601598	中国外运	4,998,054.00	0.12
14	000977	浪潮信息	4,287,808.00	0.10
15	603713	密尔克卫	3,127,935.00	0.07
16	688007	光峰科技	1,699,165.37	0.04
17	688249	晶合集成	1,470,454.26	0.03
18	688443	智翔金泰	1,148,862.52	0.03
19	688469	中芯集成	785,185.86	0.02
20	688472	阿特斯	694,882.20	0.02

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600941	中国移动	44,792,586.04	1.06
2	601728	中国电信	23,975,822.00	0.57
3	300059	东方财富	23,340,734.40	0.55
4	002920	德赛西威	15,179,273.35	0.36
5	600519	贵州茅台	13,876,002.00	0.33
6	601111	中国国航	13,417,861.00	0.32
7	600873	梅花生物	13,196,172.30	0.31
8	002223	鱼跃医疗	12,851,245.00	0.31
9	601799	星宇股份	12,440,449.00	0.30
10	000977	浪潮信息	12,154,914.24	0.29
11	603596	伯特利	12,131,894.00	0.29
12	688007	光峰科技	10,658,607.95	0.25
13	600346	恒力石化	9,824,193.00	0.23
14	600690	海尔智家	9,027,924.62	0.21
15	600660	福耀玻璃	8,878,511.00	0.21
16	002415	海康威视	8,186,783.42	0.19
17	600685	中船防务	8,046,927.21	0.19
18	600150	中国船舶	7,456,438.00	0.18
19	300760	迈瑞医疗	7,440,148.00	0.18
20	300347	泰格医药	7,347,500.88	0.17

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	230,964,210.62
卖出股票收入（成交）总额	446,554,218.26

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	1,186,499,840.23	29.12
	其中：政策性金融债	520,237,652.05	12.77
4	企业债券	801,287,690.91	19.66
5	企业短期融资券	81,669,405.99	2.00
6	中期票据	2,819,931,952.08	69.20
7	可转债（可交换债）	467,872,128.06	11.48
8	同业存单	99,563,459.78	2.44
9	其他	-	-
10	合计	5,456,824,477.05	133.90

### 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	230203	23 国开 03	3,100,000	316,630,857.53	7.77
2	230202	23 国开 02	2,000,000	203,606,794.52	5.00
3	112381038	23 汉口银行 CD197	1,000,000	99,563,459.78	2.44
4	092280105	22 南京银	800,000	80,815,342.47	1.98

		行永续债 01			
5	188100	21 信投 Y1	700,000	72,064,520.55	1.77

## 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	800,000	81,328,486.58	2.00
2	112060	二发 A	400,000	40,660,657.54	1.00
3	180926	铁托 7 优	400,000	40,381,930.96	0.99
4	199694	G23XH 优	300,000	30,179,158.36	0.74
5	193933	和皖 A	200,000	20,477,766.09	0.50
6	180588	大板 A	200,000	20,385,643.84	0.50
7	180991	工鑫 15A	200,000	20,377,254.79	0.50
8	179863	21 工鑫 4A	200,000	20,365,363.29	0.50
9	189329	21 工鑫 5A	200,000	20,209,200.00	0.50
10	183916	22 保置优	200,000	20,106,579.51	0.49
11	180047	25 欲晓 A3	200,000	20,098,356.16	0.49
12	135572	荟臻 021A	200,000	19,933,218.63	0.49
13	135251	曦月 3A	100,000	10,232,205.48	0.25
14	112450	22 沪杭优	100,000	10,224,055.34	0.25
15	112280	22 中公 1A	100,000	10,188,772.60	0.25
16	112440	G 鄱阳 1A2	100,000	10,162,082.19	0.25
17	112424	星惠 5A	100,000	10,155,420.82	0.25
18	199488	荣茂 16 优	100,000	10,077,917.81	0.25
19	2289003	22 融腾 1B_bc	100,000	10,051,835.62	0.25
20	199430	23 济建优	100,000	10,044,178.08	0.25
21	2189533	21 招银和 信 2 优先 B	100,000	10,019,916.16	0.25
22	135290	荟享 087A	100,000	10,017,342.47	0.25
23	135348	荟享 091A	100,000	10,012,670.69	0.25
24	180961	耘睿 023A	100,000	10,000,895.89	0.25
25	135541	荟臻 023A	100,000	9,999,624.66	0.25
26	180802	铁建 37A1	100,000	9,968,338.02	0.24
27	2289219	22 融腾 4B_bc	100,000	9,944,002.74	0.24
28	2289311	22 汇聚达 2B_bc	100,000	9,925,958.90	0.24
29	135401	润嘉 011A	100,000	1,599,222.70	0.04

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体或原始权益人中，北京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北京监管局、国家外汇管理局北京外汇管理部的处罚。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	197,139.53

2	应收清算款	3,311,922.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,509,061.56

## 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	113050	南银转债	26,911,084.50	0.66
2	113056	重银转债	26,249,535.02	0.64
3	132020	19 蓝星 EB	19,735,055.10	0.48
4	127045	牧原转债	18,430,752.79	0.45
5	113641	华友转债	13,031,844.00	0.32
6	128037	岩土转债	12,378,205.66	0.30
7	113059	福莱转债	11,971,217.02	0.29
8	110073	国投转债	11,669,350.00	0.29
9	110085	通 22 转债	11,423,198.15	0.28
10	123151	康医转债	11,035,268.80	0.27
11	127018	本钢转债	10,977,641.70	0.27
12	127061	美锦转债	10,149,113.34	0.25
13	123149	通裕转债	10,006,483.16	0.25
14	113065	齐鲁转债	9,880,318.51	0.24
15	118024	冠宇转债	9,519,838.78	0.23
16	127047	帝欧转债	8,856,154.09	0.22
17	118022	锂科转债	8,824,096.41	0.22
18	118025	奕瑞转债	8,263,897.50	0.20
19	127032	苏行转债	7,899,743.80	0.19
20	110081	闻泰转债	7,832,144.32	0.19
21	113062	常银转债	7,738,037.17	0.19
22	128109	楚江转债	6,936,580.21	0.17
23	113053	隆 22 转债	6,919,009.85	0.17
24	123049	维尔转债	6,732,252.90	0.17
25	113647	禾丰转债	6,656,450.98	0.16

26	113625	江山转债	6,527,035.12	0.16
27	127005	长证转债	6,468,994.52	0.16
28	113061	拓普转债	5,922,165.86	0.15
29	110086	精工转债	5,878,510.89	0.14
30	123002	国祯转债	5,765,590.40	0.14
31	110047	山鹰转债	5,479,201.51	0.13
32	113048	晶科转债	4,915,125.96	0.12
33	127066	科利转债	4,900,294.51	0.12
34	127075	百川转 2	4,852,661.82	0.12
35	113051	节能转债	4,729,243.15	0.12
36	118013	道通转债	4,595,220.16	0.11
37	127053	豪美转债	4,584,679.18	0.11
38	113049	长汽转债	4,553,504.66	0.11
39	110089	兴发转债	4,181,130.87	0.10
40	123154	火星转债	4,175,251.51	0.10
41	113638	台 21 转债	3,847,338.19	0.09
42	118006	阿拉转债	3,681,297.55	0.09
43	128129	青农转债	3,220,122.32	0.08
44	118029	富淼转债	3,151,560.05	0.08
45	128081	海亮转债	2,994,870.78	0.07
46	123158	宙邦转债	2,704,324.00	0.07
47	118012	微芯转债	2,365,043.40	0.06
48	118020	芳源转债	2,190,605.24	0.05
49	128021	兄弟转债	2,152,449.37	0.05
50	123161	强联转债	2,122,144.04	0.05
51	113629	泉峰转债	2,043,323.97	0.05
52	123166	蒙泰转债	2,012,120.08	0.05
53	118023	广大转债	1,455,251.62	0.04
54	118015	芯海转债	1,435,682.37	0.04
55	127052	西子转债	993,068.75	0.02
56	113619	世运转债	928,980.49	0.02
57	113042	上银转债	330,059.30	0.01
58	127071	天箭转债	114,863.67	0.00
59	123035	利德转债	104,781.12	0.00
60	127022	恒逸转债	71,657.36	0.00
61	127058	科伦转债	944.86	0.00
62	127025	冀东转债	424.07	0.00

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	601298	青岛港	32,006,240.00	0.79	重大事项停牌



## § 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
易方达裕惠定开混合发起式 A	79,360	31,150.74	1,660,717,587.61	67.18%	811,405,301.59	32.82%
易方达裕惠定开混合发起式 C	114	15,651.48	613,882.25	34.41%	1,170,386.73	65.59%
合计	79,474	31,128.51	1,661,331,469.86	67.15%	812,575,688.32	32.85%

## 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	易方达裕惠定开混合发起式 A	496,436.17	0.0201%
	易方达裕惠定开混合发起式 C	5.95	0.0003%
	合计	496,442.12	0.0201%

## 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	易方达裕惠定开混合发起式 A	0
	易方达裕惠定开混合发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达裕惠定开混合发起式 A	0
	易方达裕惠定开混合发起式 C	0

	合计	0
--	----	---

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	9,149,130.83	0.3698%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	9,149,130.83	0.3698%	-

注：该基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年，发起份额已全部赎回。

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达裕惠定开混合发起式 A	易方达裕惠定开混合发起式 C
基金合同生效日（2014 年 8 月 18 日）基金份额总额	1,962,682,023.03	-
本报告期期初基金份额总额	2,542,851,722.15	480,419.98
本报告期基金总申购份额	844,668,386.53	1,613,525.44
减：本报告期基金总赎回份额	915,397,219.48	309,676.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,472,122,889.20	1,784,268.98

### § 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，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

自 2023 年 4 月 11 日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

## 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	
德邦证券	1	17,868,288.53	2.70%	10,721.41	2.37%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	310,682,101.57	46.99%	186,409.29	41.15%	-
申万宏源	3	281,513,512.01	42.58%	225,209.58	49.71%	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	51,111,446.78	7.73%	30,667.80	6.77%	-

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

德邦证券	41,105,556.26	2.94%	1,480,950,000.00	2.90%	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	919,903,174.25	65.87%	32,211,799,000.00	63.11%	-	-
申万宏源	228,255,886.28	16.34%	12,034,175,000.00	23.58%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	207,354,914.74	14.85%	5,315,600,000.00	10.41%	-	-

## 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聘任基金经理助理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
2	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	上海证券报	2023-01-20
3	易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-11
4	易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金第十八个运作期开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
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	上海证券报	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### 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