

# 易方达安心回馈混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十九日

## § 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§ 4 管理人报告.....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
4.9 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.....	20
§ 5 托管人报告.....	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
§ 6 审计报告.....	21
6.1 审计意见.....	21
6.2 形成审计意见的基础.....	21
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	21
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	22
§ 7 年度财务报表.....	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 净资产变动表.....	26
7.4 报表附注.....	27
§ 8 投资组合报告.....	64
8.1 期末基金资产组合情况.....	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	65
8.3 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.....	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	70
8.6	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 .....	71
8.7	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 .....	71
8.8	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 .....	72
8.9	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 .....	72
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	72
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	72
8.12	投资组合报告附注 .....	72
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>74</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	75
9.3	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情况 .....	75
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>75</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>75</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	75
11.2	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 .....	76
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	76
11.4	基金投资策略的改变 .....	76
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	76
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	76
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	76
11.8	其他重大事件 .....	78
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>79</b>
12.1	备查文件目录 .....	79
12.2	存放地点 .....	79
12.3	查阅方式 .....	79

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达安心回馈混合型证券投资基金	
基金简称	易方达安心回馈混合	
基金主代码	001182	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,016,804,271.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达安心回馈混合 A	易方达安心回馈混合 C
下属分级基金的交易代码	001182	016594
报告期末下属分级基金的份额总额	1,016,301,935.34 份	502,336.54 份

注：自 2022 年 9 月 13 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 9 月 14 日。

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。2、本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。3、本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。同时，本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金

	金，高于债券型基金和货币市场基金。
--	-------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路 30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	陈四清

### 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特 殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中 心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	易方达安心 回馈混合 A	易方达安心 回馈混合 C	易方达安心 回馈混合 A	易方达安心 回馈混合 C	易方达安心 回馈混合 A	易方达安心回 馈混合 C
本期已 实现收 益	-129,936,99 9.10	-47,082.40	-220,272,779. 81	-10,621.17	284,783,655. 92	-
本期利 润	-12,387,512 .52	-21,212.36	-1,176,568,85 4.16	-21,991.60	850,135,796. 02	-
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.0095	-0.0531	-0.3976	-0.0963	0.3277	-
本期加 权平均 净值利 润率	-0.41%	-2.32%	-16.31%	-4.17%	13.22%	-
本期基 金份额 净值增 长率	-1.13%	-1.49%	-13.06%	-6.88%	13.19%	-
3.1.2 期末 数据和指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	易方达安心回 馈混合 A	易方达安心回 馈混合 C	易方达安心回 馈混合 A	易方达安心回 馈混合 C	易方达安心回 馈混合 A	易方达安心回 馈混合 C
期末可 供分配 利润	993,236,059 .89	485,069.82	1,959,789,89 4.83	483,184.74	4,707,497,45 0.04	-
期末可 供分配 基金份 额利润	0.9773	0.9656	1.0670	1.0639	1.1316	-
期末基 金资产 净值	2,302,076,1 31.65	1,131,892.9 4	4,207,340,68 2.06	1,038,835.37	10,963,009,8 48.88	-
期末基 金份额 净值	2.265	2.253	2.291	2.287	2.635	-
3.1.3 累计 期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	易方达安心	易方达安心	易方达安心	易方达安心	易方达安心	易方达安心回

	回馈混合 A	回馈混合 C	回馈混合 A	回馈混合 C	回馈混合 A	回馈混合 C
基金份额累计净值增长率	126.50%	-8.27%	129.10%	-6.88%	163.50%	-

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 2022 年 9 月 13 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 9 月 14 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 易方达安心回馈混合 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
过去三个月	-2.03%	0.36%	-0.80%	0.20%	-1.23%	0.16%
过去六个月	-1.35%	0.35%	-1.28%	0.21%	-0.07%	0.14%
过去一年	-1.13%	0.37%	0.43%	0.21%	-1.56%	0.16%
过去三年	-2.71%	0.51%	-0.52%	0.28%	-2.19%	0.23%
过去五年	80.33%	0.61%	21.26%	0.30%	59.07%	0.31%
自基金合同生效起至今	126.50%	0.55%	22.18%	0.34%	104.32%	0.21%

##### 易方达安心回馈混合 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
过去三个月	-2.13%	0.36%	-0.80%	0.20%	-1.33%	0.16%
过去六个月	-1.57%	0.35%	-1.28%	0.21%	-0.29%	0.14%
过去一年	-1.49%	0.37%	0.43%	0.21%	-1.92%	0.16%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-8.27%	0.41%	-1.09%	0.23%	-7.18%	0.18%



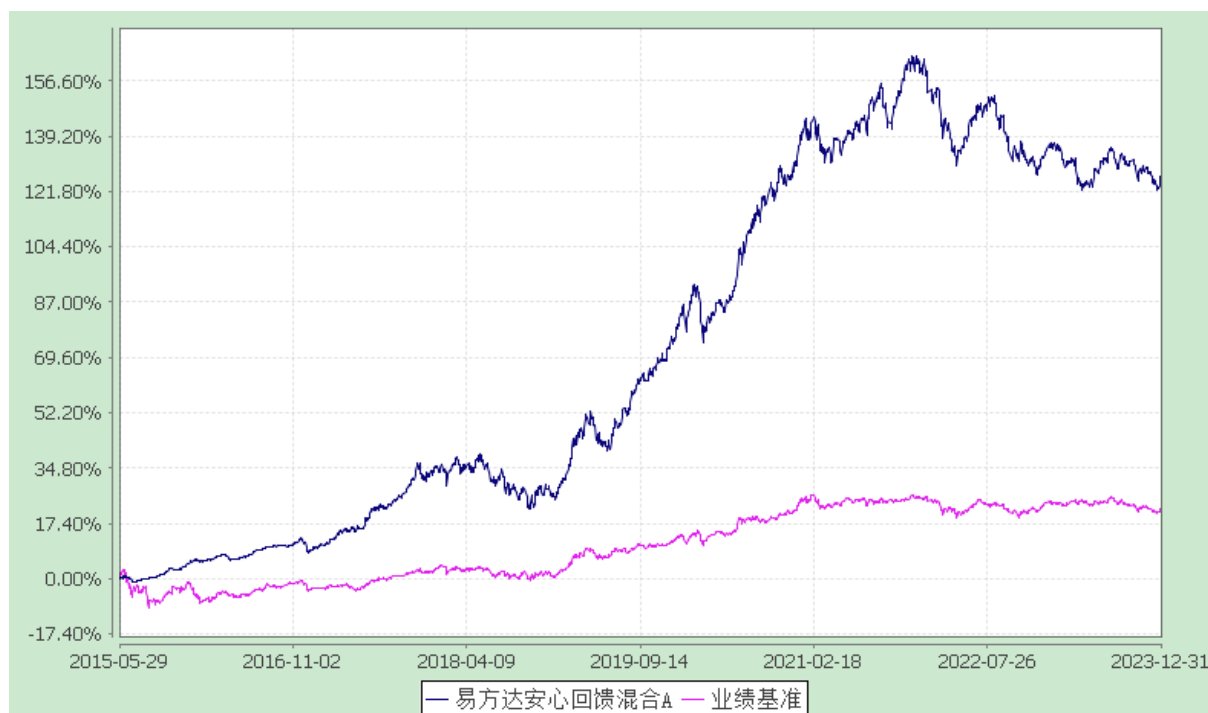
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达安心回馈混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

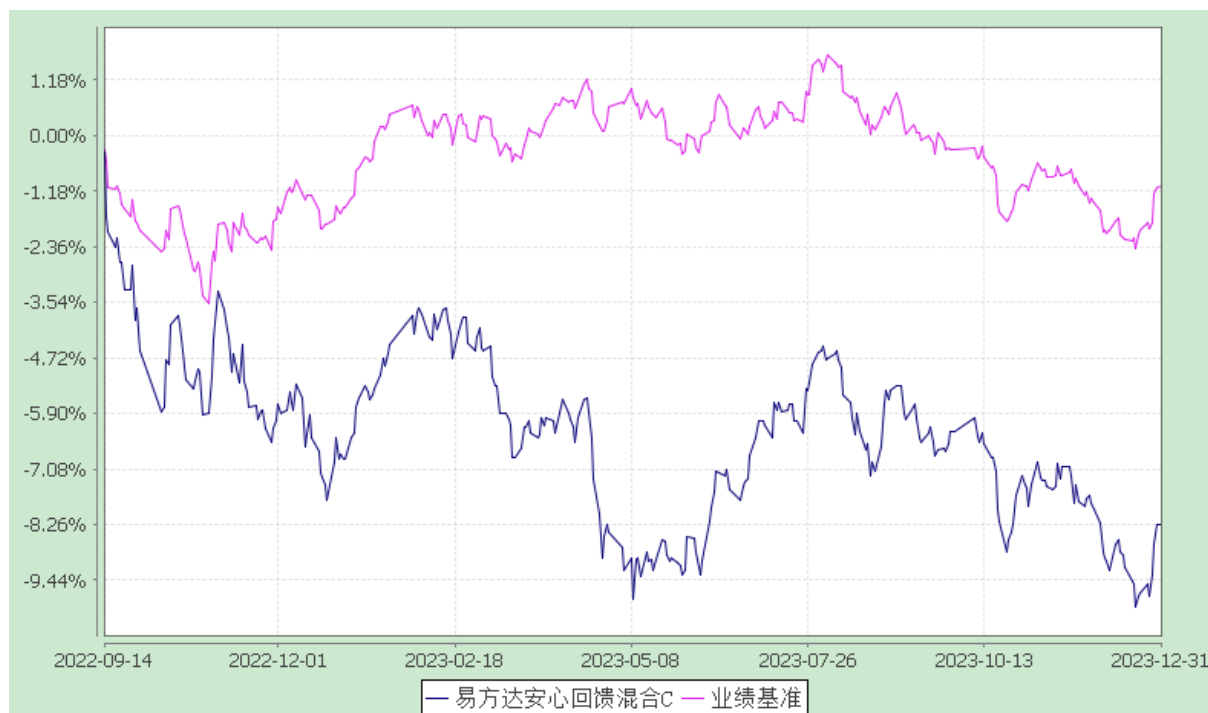
易方达安心回馈混合 A

(2015 年 5 月 29 日至 2023 年 12 月 31 日)



易方达安心回馈混合 C

(2022 年 9 月 14 日至 2023 年 12 月 31 日)



注：1.自 2022 年 9 月 13 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 9 月 14 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

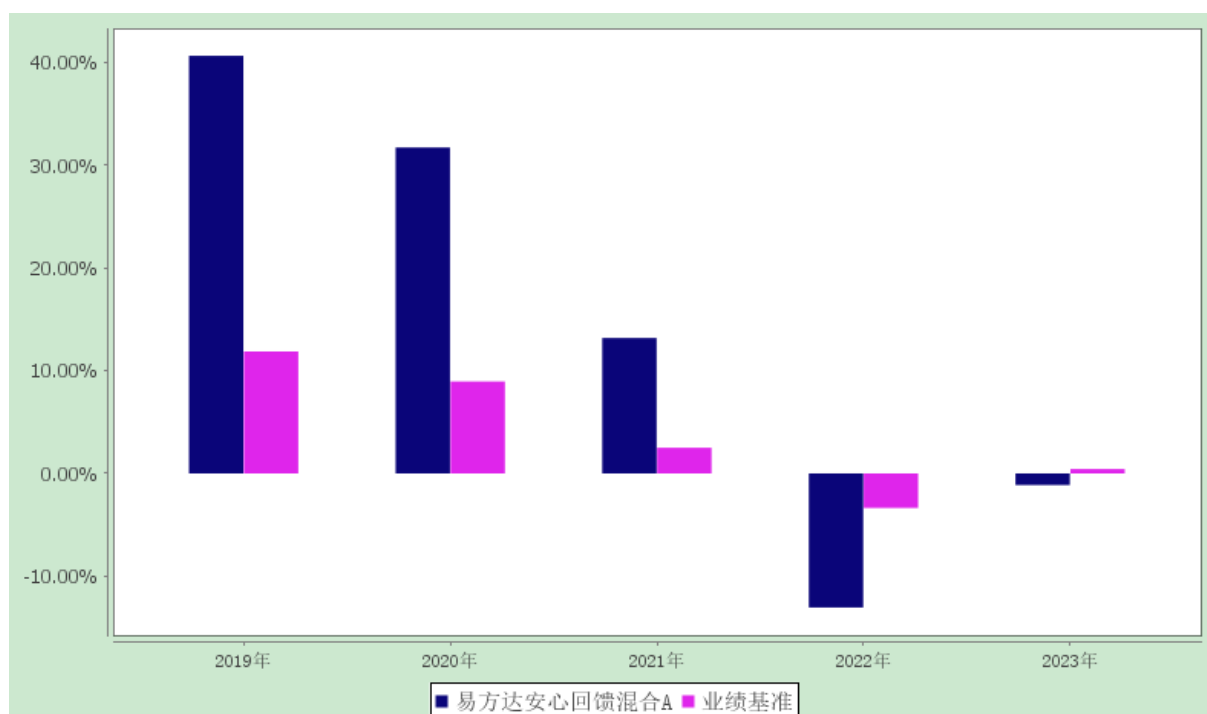
2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 126.50%，同期业绩比较基准收益率为 22.18%；C 类基金份额净值增长率为-8.27%，同期业绩比较基准收益率为-1.09%。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

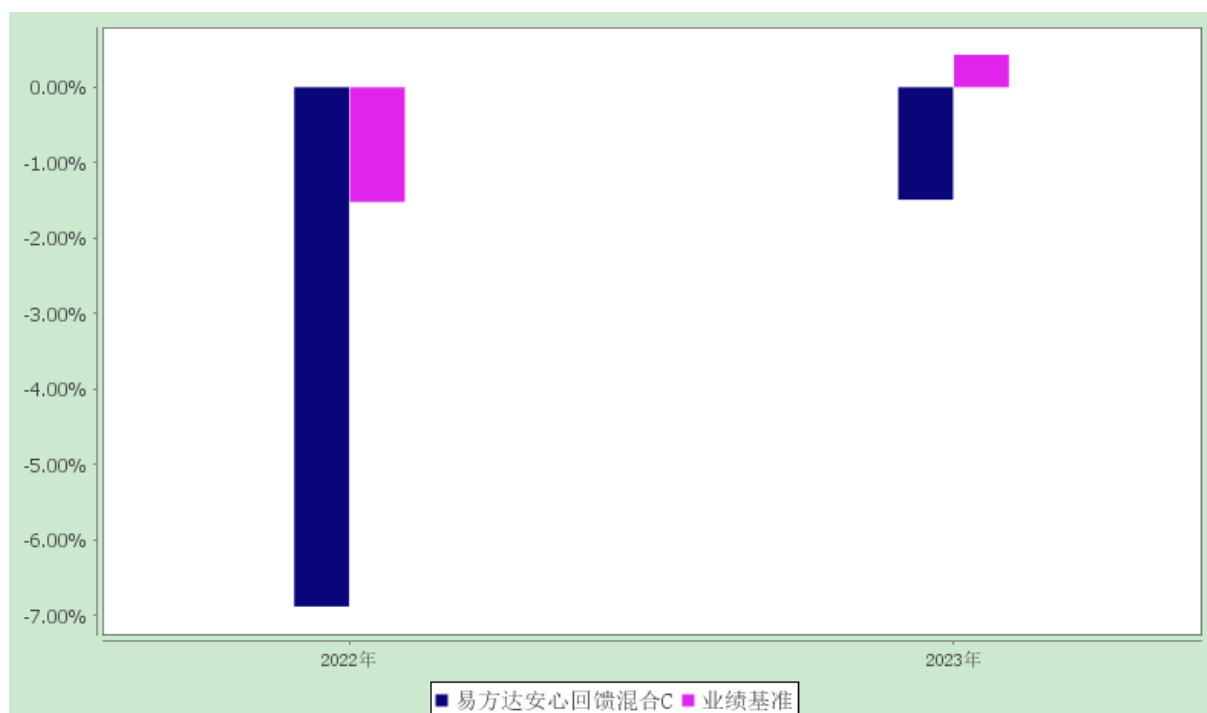
易方达安心回馈混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达安心回馈混合 A



### 易方达安心回馈混合 C



注：自 2022 年 9 月 13 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 9 月 14 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 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		
林虎	本基金的基金经理，易方达裕祥回报债券（自 2021 年 09 月 08 日至 2023 年 03 月 03 日）、易方达磐泰一年持有混合、易方达瑞富混合、易方达瑞祥混合的基金经理	2021-09-08	2023-03-04	11 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任宏源证券研究所固定收益分析师，国信证券研究所宏观分析师，易方达基金管理有限公司基金经理助理。
李中阳	本基金的基金经理，易方达磐固六个月持有混合（自 2021 年 05 月 19 日至 2023 年 06 月 20 日）、易方达丰华债券、易方达悦稳一年持有混合的基金经理，易方达悦享一年持有混合（自 2022 年 07 月 09 日至 2023 年 06 月 19 日）、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理助理，多资产研究部总经理助理	2022-04-30	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中信证券股份有限公司研究部研究员，易方达基金管理有限公司研究员。
王成	本基金的基金经理助理，易方达丰华债券、易方达悦享一年持有混合、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达悦夏一年持有	2022-04-30	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任安信证券股份有限公司交易员、投资经理，易方达基金管理有限公司年金投资部总经理助理。

	混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦鑫一年持有混合的基金经理，易方达磐固六个月持有混合（自 2022 年 07 月 09 日至 2023 年 06 月 19 日）、易方达悦稳一年持有混合的基金经理助理，多资产养老金投资部副总经理				
周琼	本基金的基金经理助理，易方达鑫转添利混合、易方达鑫转招利混合（自 2019 年 08 月 31 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达裕丰回报债券、易方达丰华债券、易方达新收益混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达安盈回报混合、易方达丰和债券、易方达裕鑫债券（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达鑫转增利混合（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达安心回报债券、易方达纯债债券（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 11 月 20 日）、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新益混合（自 2019 年 10 月 30 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞选混合（自 2019 年 10 月 30 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合（自 2019 年 11 月 14 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达裕富债券（自 2020 年 04 月 09 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达瑞川混合发起式（自 2020 年 05 月 01 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达丰惠混合、易方达招易一年持有混合、易方达瑞锦混合发起式、易方达磐恒九个月持有混合、易方达磐泰一年持有混合、易方达磐固六个月持有混合（自 2020 年 09 月 15 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达悦享一年持有混合、易方达悦兴一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达瑞安混合发起式（自 2021 年 01 月 15 日至 2023 年 10 月	2022-04-30	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任凯仁投资咨询（上海）有限公司客户经理，易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员。

11 日)、易方达瑞康混合(自 2021 年 02 月 05 日至 2023 年 10 月 11 日)、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达瑞富混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦浦一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦稳一年持有混合、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达悦鑫一年持有混合、易方达全球配置混合(QDII)的基金经理助理				
--	--	--	--	--

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易(含银行间市场)、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投

资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 47 次，其中 40 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，7 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。

### 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 年经济在曲折中复苏，全年实际 GDP（国内生产总值，下同）增速 5.2%，基本完成年初目标；但由于 GDP 平减指数为-0.54%，名义 GDP 仅为 4.6%。2023 年初疫情防控措施放开后，消费恢复明显，信贷和社会融资总量增速较高，房地产销售也有明显改善，参考其他国家放开后的经验，市场普遍对经济较为乐观。4 月份，以制造业 PMI（采购经理指数）为代表的高频数据开始出现回落，企业产成品库存逐步累积，经济增长动能逐步放缓；同时，社会融资规模数据总量和结构双双

回落，房地产市场走弱，内生需求不足，这是全年最大的预期差。随后 5-6 月份的经济增长和价格数据证实了内生需求不足，出口也有所回落；虽然央行进行了降低 1 年期 MLF（中期借贷便利）利率的宽松操作，但并未显著改善内生融资需求；财政政策也未见显著发力。7 月份中共中央政治局会议要求加大宏观政策调控力度，地方放松房地产限购等政策陆续出台，央行也进行了降准、降息操作；8-9 月份经济低位企稳，市场对政策预期较高，呈现“弱现实、强预期”特点。四季度经济整体低于预期，房地产销售和投资继续下滑，消费疲弱，基建未见明显回升；10 月份财政上调了赤字率，增发了一万亿特别国债，但没有在当年完全形成相应的实物工作量。以 PPI（生产者物价指数）和 CPI（消费者物价指数）为代表的价格数据也进一步回落，同比增长回落到负值区间。

2023 年权益市场震荡走弱，虽然年初对于疫后复苏有所期待，二季度之后随着经济数据不及预期，市场不断下行。在此情况下，市场分化比较剧烈，和经济关联度低的微盘股指数等显著跑赢沪深 300 指数，微盘/沪深 300 达到历史极值水平。

2023 年债券走出了一波牛市，超出年初预期，收益率震荡下行，收益率曲线平坦化，全年 1 年期国债收益率下行 2bp 到 2.08%，10 年期国债收益率下行 28bp 到 2.56%，而作为超长端利率的代表，30 年期国债收益率下行了 37bp 到 2.83%。信用债收益率下行幅度更多，信用利差压缩明显，全年 3 年期和 5 年期 AAA 级中期票据收益率分别下行了 46bp 和 56bp。从节奏上看，一季度 10 年期国债收益率基本在 2.8%-2.9% 区间震荡；短端震荡幅度更大，1 年期 AAA 级 NCD（同业存单，下同）收益率先下行到 2.4% 的低位，后随着资金紧张，又反弹到 2.9% 附近。随着 4 月份对经济复苏预期的落空，较大的预期差推动债券收益率持续下行；央行降息确认了继续宽松的政策取向，债券走出牛市节奏，收益率继续下行。8 月央行降准降息后 10 年期国债收益率下降至 2.54% 的阶段低点；信用债走势类似，但下行幅度更大，3 年期 AAA 级中期票据收益率下行至 2.65%，3 年期 AAA 级银行二级资本债、永续债收益率下行幅度较大，类属利差同样大幅压缩。8-9 月份经济低位企稳，叠加资金面的紧张，收益率出现调整，10 年期国债收益率反弹到 2.7%；短端受资金面影响更大，1 年期 AAA 级 NCD 收益率持续反弹到 2.67% 的高位，3 年 AAA 中期票据收益率也反弹至 2.97% 附近，银行二级资本债、永续债和产业永续债也跟随调整。11 月末，政策不及预期，内生增长动力疲弱，利率重新回归下行，10 年期国债收益率回到 2.55%。12 月中旬资金面逐步宽松，信用债收益率开始下行，1 年期 AAA 级 NCD 收益率下行至 2.4%；3 年 AAA 级中期票据收益率下行至 2.7%。

转债跟随正股走势，全年先涨后跌，全年中证转债指数下跌 0.48%。1 月份转债普遍上涨，中证转债指数上涨 4.7%，是全年的主要上涨时段。2-8 月份，转债以结构性行情为主，小盘表现相对占优，指数震荡走平。8 月以来权益市场持续下跌，中小盘个股下跌，带动转债指数震荡下跌。

权益方面，全年核心配置仍以制造业为主，主要集中在依靠竞争力优势在全球市场不断提升份



额的细分行业，如汽车零部件、家电、金属加工等。下半年市场继续下行，一些商业模式良好、经营稳健的龙头也回调到了赔率较高的位置，进行了部分左侧配置。

债券方面，考虑到信用债票息和利差处于高位，组合在 2023 年初判断票息策略和杠杆策略的确定性较高，骑乘策略也将有不错的收益，所以在年初组合持仓以信用债为主，相对超配了银行二级资本债、银行永续债和产业永续债。同时，考虑到组合权益仓位偏高，信用债底仓久期也较高，组合在该阶段获取了不错的收益。在 2023 年 4 月份宏观经济出现重大预期差时，组合没有及时提高久期，错过了二季度利率债的行情，虽然杠杆、类属、骑乘操作收益较好，但也仅仅只是弥补久期偏低的差距。三季度后，组合在继续持有偏高久期信用债的底仓，坚持票息、杠杆、类属、骑乘等信用债策略的基础上，加大了对利率债的灵活操作。8 月份有所加仓，9-10 月份及时做了止损，损失不大；11-12 月份获取了不错的收益。总结 2023 年的操作，组合抓住了高等级信用债的投资机会，但错失了超长利率债和城投债的结构机会。未来我们将增加策略的多样性，增加组合的交易属性和换手率，积极参与市场机会，努力创造出好的收益回报持有人。

转债方面，组合全年保持中性略偏高的转债仓位，以偏债型和平衡型转债为主，在前三个季度收益尚可，但在四季度下跌过程中回撤较大。未来组合将坚持逆势操作，在有足够安全边际的情况下才提高仓位，增加仓位的波动幅度，及时做好止盈止损。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 2.265 元，本报告期份额净值增长率为-1.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.43%；C 类基金份额净值为 2.253 元，本报告期份额净值增长率为-1.49%，同期业绩比较基准收益率为 0.43%。

#### 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，预计经济增速会低位企稳，向上弹性取决于政策力度；预计通胀保持低位，货币政策继续保持宽松。外需方面，美国就业市场保持稳定；财政政策偏宽松，预计美联储也会适当降息，外需预计保持平稳；得益于国内的成本优势，预期出口份额会保持或有所提升，预计出口将持平或小幅提升。国内需求方面，在特别国债等增量财政政策加持下，保障性住房、城中村改造、“平急两用”公共基础设施建设是政策的重点方向，基建将成为逆周期拉动经济的重要力量。经济的内生需求依然疲弱，主要体现在房地产产业链和居民消费，可能成为经济的拖累。地产方面，虽然 2023 年出台了很宽松政策，但居民收入预期转弱、买房信心不足制约了政策效果，地产销售依然同比负增长；如果没有政策提振居民购买信心，地产销售将维持低位；地产投资也将继续下滑，拖累经济表现。居民消费同样受制于收入增速降低和消费倾向不足，对经济增速的贡献提升幅度有限。价格数据方面，由于产能利用率处于中性偏低水平，猪肉等产品价格也未看到大幅上涨的动力，预计 PPI

（生产者物价指数）和 CPI（消费者物价指数）将保持低位。得益于美联储进入宽松周期和国内较低的物价水平，预计货币政策将继续保持宽松，资金利率维持低位。

回首 2023 年，全年的走势低于年初的预期，两个判断一对一错。国内需求恢复比我们预计的更加曲折，而且对于政策的预期不断落空，进一步加剧了资本市场的反应。年初组合配置了较多内需关联度较高的行业，对组合造成了比较大的回撤。好在第二个判断得到验证，高端制造业自身竞争力持续体现，弥补了组合的部分损失。

展望 2024 年，当前市场位于低位，很多自身基本面稳健、盈利稳定的优秀公司估值已经降低到历史极值附近。这种对未来的担忧，反映出在当前复杂的全球宏观政治环境下，资金对确定性要求的极大提升，而这种周期经验在历史上极少出现，传统投资框架至少需要进行部分修正。在此情况下，我们继续坚持寻找在自身的细分行业不断耕耘、实现增长的公司，伴随其共同成长穿越周期。与此同时我们也在思考，进入经济高质量发展和转型的时代，单纯利用资本开支跑马圈地的效率不断降低，投资回报的权重不断提高。我们在 2024 年试着去寻找供给稳定、经营壁垒较强的公司和行业，去抓取利润率潜在回升的机会。

经过 2023 年的牛市，债券收益率已经接近历史低点，信用利差也大幅压缩，预计未来债券波动将加大。在经济处于低位、内生增长动能偏弱、货币政策仍有宽松空间的背景下，债券依然具有配置价值，可以继续持有，久期策略预计将好于票息策略，杠杆和骑乘策略还可以坚持。由于信用利差已经到历史低位，压缩空间有限，考虑到流动性差异，我们预计利率债表现将优于信用债。

经过近期下跌，部分转债已经逐步具备配置价值，在下跌过程中，可以逐步提高配置比例。结构上，偏债品种逐步接近债底，在控制信用风险的基础上，我们认为其是较好的配置品种；平衡型和偏股型转债的主要驱动力是正股，更适合自下而上的选择。

在内生增长动力没有趋势性回升之前，债券大幅走熊的风险不大，是较为重要的配置资产，下跌将会带来加仓机会。作为含权基金，偏多的债券持仓，也可以对冲组合净值波动。基于上述两点考虑，组合将继续超配债券。同时，组合也将对持仓结构进行优化，提高利率债持仓，降低信用债，提高组合流动性，以在收益率反转时，能够及时降低仓位。未来组合将重点采用久期策略、杠杆策略和票息策略；根据利差情况，组合将灵活操作普通产业债、银行二永债、产业永续债、券商次级债等品种，加大交易力度，增厚组合收益。

可转债方面，组合将重点关注偏债品种和新发转债，根据市场节奏，逐步适当提高仓位。同时，组合也将做好止盈止损工作，防止对净值形成过大拖累。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规

底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，持续督促廉洁从业、执业操守和道德规范等规定贯彻落实，积极开展形式多样的文化宣导，引导员工树立正确的价值观、事业观、职业观，不断推动建设风清气正的公司及行业生态环境。

(2) 持续完善投资合规监控手段，协同投资、研究、交易等业务部门完善相应的内控机制，共同巩固投资合规内控防线。升级风控系统，提升投资合规监控工作效能，有效保障各类资产组合的合规运作。持续加强关联交易、公平交易、异常交易和内幕交易等监测管控机制，保护投资者利益。

(3) 持续督促优化基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，提升产品合规审查质效；坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求，坚持以投资者视角审核基金宣传推介材料，持续加强对网络直播、自媒体账号、对外言论发布、投资者交流等重点领域的合规管理。深入落实投资者适当性管理，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，完善信息披露管理工作机制流程，不断提高信息披露监测触发、制作、审核、报送的自动化水平和合规风险控制能力，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 贯彻落实风险为本的工作方法，持续完善洗钱风险管理体系，进一步健全内控制度流程，深入开展反洗钱系统建设与数据治理，探索优化风险评估识别方法，加强客户尽职调查，全面提高反洗钱工作的履职质效。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展 ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，聘请律师事务所完成年度合规有效性评估工作，从不同视角更加全面审视公司合规内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达安心回馈混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达安心回馈混合 C:本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 24410 号

易方达安心回馈混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### (一)我们审计的内容

我们审计了易方达安心回馈混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

#### (二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了易方达安心回馈混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达安心回馈混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达安心回馈混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达安心回馈混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达安心回馈混合型证券投资基金的财务报告过程。

#### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达安心回馈混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达安心回馈混合型证券投资基金不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵珏 成磊

中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：易方达安心回馈混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	1,849,353.80	1,361,416.04
结算备付金		10,221,512.31	62,106,793.26
存出保证金		213,754.68	469,629.85
交易性金融资产	7.4.7.2	3,118,032,674.78	5,633,488,900.56
其中：股票投资		735,003,559.12	1,475,507,037.73
基金投资		-	-
债券投资		2,252,226,976.21	4,004,270,980.71
资产支持证券投资		130,802,139.45	153,710,882.12
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		1,299,187.33	54,058,157.53
应收股利		-	-
应收申购款		345,822.81	1,217,551.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>3,131,962,305.71</b>	<b>5,752,702,448.33</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		820,929,644.72	1,464,235,328.53
应付清算款		150,599.44	52,117,465.90
应付赎回款		5,341,500.17	23,315,903.46
应付管理人报酬		1,176,857.49	2,327,028.11
应付托管费		392,285.82	969,595.05
应付销售服务费		379.57	350.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		92,612.83	161,007.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	670,401.08	1,196,251.13
<b>负债合计</b>		<b>828,754,281.12</b>	<b>1,544,322,930.90</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,016,804,271.88	1,837,220,019.83
未分配利润	7.4.7.8	1,286,403,752.71	2,371,159,497.60
<b>净资产合计</b>		<b>2,303,208,024.59</b>	<b>4,208,379,517.43</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>3,131,962,305.71</b>	<b>5,752,702,448.33</b>

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 2.265 元，C 类基金份额净值 2.253 元；基金份额总额 1,016,804,271.88 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,016,301,935.34 份，C 类基金份额总额 502,336.54 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达安心回馈混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日



<b>一、营业总收入</b>		<b>38,879,209.01</b>	<b>-1,089,783,378.55</b>
1.利息收入		727,039.65	1,468,833.20
其中：存款利息收入	7.4.7.9	686,093.76	1,247,149.48
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		40,945.89	221,683.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-79,781,557.04	-141,458,166.35
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-184,443,922.46	-372,009,932.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	88,574,430.64	203,378,323.05
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	4,927,791.22	3,523,207.24
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	11,160,143.56	23,650,236.22
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	117,575,356.62	-956,307,444.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	358,369.78	6,513,399.38
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>51,287,933.89</b>	<b>86,807,467.21</b>
1. 管理人报酬		18,192,616.33	43,756,566.97
2. 托管费		6,974,517.52	18,231,902.97
3. 销售服务费		3,653.84	592.05
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		25,641,484.41	24,156,155.13
其中：卖出回购金融资产支出		25,641,484.41	24,156,155.13
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		155,131.44	320,889.94

8. 其他费用	7.4.7.18	320,530.35	341,360.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		<b>-12,408,724.88</b>	<b>-1,176,590,845.76</b>
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>-12,408,724.88</b>	<b>-1,176,590,845.76</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		<b>-12,408,724.88</b>	<b>-1,176,590,845.76</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：易方达安心回馈混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,837,220,019.83	2,371,159,497.60	4,208,379,517.43
二、本期期初净资产	1,837,220,019.83	2,371,159,497.60	4,208,379,517.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-820,415,747.95	-1,084,755,744.89	-1,905,171,492.84
（一）、综合收益总额	-	-12,408,724.88	-12,408,724.88
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-820,415,747.95	-1,072,347,020.01	-1,892,762,767.96
其中：1.基金申购款	53,318,435.84	69,690,488.80	123,008,924.64
2.基金赎回款	-873,734,183.79	-1,142,037,508.81	-2,015,771,692.60
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	1,016,804,271.88	1,286,403,752.71	2,303,208,024.59
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,159,913,525.14	6,803,096,323.74	10,963,009,848.88
二、本期期初净资产	4,159,913,525.14	6,803,096,323.74	10,963,009,848.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,322,693,505.31	-4,431,936,826.14	-6,754,630,331.45
（一）、综合收益总额	-	-1,176,590,845.76	-1,176,590,845.76
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,322,693,505.31	-3,255,345,980.38	-5,578,039,485.69
其中：1.基金申购款	652,535,551.51	976,445,434.30	1,628,980,985.81
2.基金赎回款	-2,975,229,056.82	-4,231,791,414.68	-7,207,020,471.50
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,837,220,019.83	2,371,159,497.60	4,208,379,517.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

易方达安心回馈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] 433 号《关于准予易方达安心回馈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《易方达安心回馈混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达安心回馈混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为

207,386,846.12 份基金份额，其中认购资金利息折合 16,209.45 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。自 2022 年 9 月 13 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2022 年 9 月 14 日。

#### 7.4.2 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》、本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。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以

公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值

为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率

(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(3)本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4)在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。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不



活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无会计差错更正。

#### **7.4.6 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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

#### 7.4.7重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	1,849,353.80	1,361,416.04

等于：本金	1,849,002.17	1,359,822.15
加：应计利息	351.63	1,593.89
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	1,849,353.80	1,361,416.04

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		782,066,714.80	-	735,003,559.12	-47,063,155.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	473,780,639.35	3,004,116.86	468,916,484.07	-7,868,272.14
	银行间市场	1,755,649,088.93	20,226,492.14	1,783,310,492.14	7,434,911.07
	合计	2,229,429,728.28	23,230,609.00	2,252,226,976.21	-433,361.07
资产支持证券		129,375,450.73	1,152,539.45	130,802,139.45	274,149.27
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,140,871,893.81	24,383,148.45	3,118,032,674.78	-47,222,367.48
项目		上年度末			

		2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,594,140,233.16	-	1,475,507,037.73	-118,633,195.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,375,755,628.86	18,220,140.14	1,383,099,907.16	-10,875,861.84
	银行间市场	2,622,692,840.10	33,057,073.55	2,621,171,073.55	-34,578,840.10
	合计	3,998,448,468.96	51,277,213.69	4,004,270,980.71	-45,454,701.94
资产支持证券		153,028,826.73	1,391,882.12	153,710,882.12	-709,826.73
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		5,745,617,528.85	52,669,095.81	5,633,488,900.56	-164,797,724.10

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,157.29	10,948.20
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	568,243.79	1,063,302.93
其中：交易所市场	507,796.28	1,003,879.87
银行间市场	60,447.51	59,423.06
应付利息	-	-
预提费用	101,000.00	122,000.00
合计	670,401.08	1,196,251.13

#### 7.4.7.7 实收基金

易方达安心回馈混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,836,765,868.55	1,836,765,868.55
本期申购	52,739,145.48	52,739,145.48
本期赎回（以“-”号填列）	-873,203,078.69	-873,203,078.69
本期末	1,016,301,935.34	1,016,301,935.34

易方达安心回馈混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	454,151.28	454,151.28
本期申购	579,290.36	579,290.36
本期赎回（以“-”号填列）	-531,105.10	-531,105.10
本期末	502,336.54	502,336.54

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

易方达安心回馈混合 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	1,959,789,894.83	410,784,918.68	2,370,574,813.51
本期期初	1,959,789,894.83	410,784,918.68	2,370,574,813.51
本期利润	-129,936,999.10	117,549,486.58	-12,387,512.52
本期基金份额交易产生的变动数	-836,616,835.84	-235,796,268.84	-1,072,413,104.68
其中：基金申购款	54,153,572.86	14,785,707.27	68,939,280.13
基金赎回款	-890,770,408.70	-250,581,976.11	-1,141,352,384.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	993,236,059.89	292,538,136.42	1,285,774,196.31

易方达安心回馈混合 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	483,184.74	101,499.35	584,684.09
本期期初	483,184.74	101,499.35	584,684.09
本期利润	-47,082.40	25,870.04	-21,212.36
本期基金份额交易产生的变动数	48,967.48	17,117.19	66,084.67
其中：基金申购款	589,188.46	162,020.21	751,208.67
基金赎回款	-540,220.98	-144,903.02	-685,124.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	485,069.82	144,486.58	629,556.40

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	39,158.28	71,179.48
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	640,806.05	1,165,114.91
其他	6,129.43	10,855.09
合计	686,093.76	1,247,149.48

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-184,443,922.46	-372,009,932.86
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	-184,443,922.46	-372,009,932.86

##### 7.4.7.10.2 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12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
卖出股票成交总额	2,485,202,860.56	5,573,666,497.42
减：卖出股票成本总额	2,664,138,295.79	5,932,673,879.19
减：交易费用	5,508,487.23	13,002,551.09
买卖股票差价收入	-184,443,922.46	-372,009,932.86

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利息收入	87,059,795.52	186,701,311.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,514,635.12	16,677,011.80
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	88,574,430.64	203,378,323.05

## 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,781,499,938.30	11,866,344,071.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,719,233,615.06	11,714,143,685.23
减：应计利息总额	60,679,901.69	135,407,877.82
减：交易费用	71,786.43	115,496.83
买卖债券差价收入	1,514,635.12	16,677,011.80

## 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	4,924,643.41	3,514,862.67
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	3,147.81	8,344.57
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	4,927,791.22	3,523,207.24

## 7.4.7.12.2 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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	56,062,076.66	22,249,160.12
减：卖出资产支持证券成本总额	53,551,653.68	21,468,471.81
减：应计利息总额	2,507,275.17	772,177.35
减：交易费用	-	166.39



资产支持证券投资收益	3,147.81	8,344.57
------------	----------	----------

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,160,143.56	23,650,236.22
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,160,143.56	23,650,236.22

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	117,575,356.62	-956,307,444.78
——股票投资	71,570,039.75	-823,584,006.72
——债券投资	45,021,340.87	-131,815,868.98
——资产支持证券投资	983,976.00	-907,569.08
——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	117,575,356.62	-956,307,444.78

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	358,369.78	6,513,399.38
合计	358,369.78	6,513,399.38

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	101,000.00	122,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	35,550.00	35,850.00
银行汇划费	62,252.52	62,310.15
其他	1,727.83	1,200.00
合计	320,530.35	341,360.15

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1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。

##### 7.4.8.2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。

#### 7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东

珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	-	-	10,462,415.45	0.11%

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广发证券	6,277.40	0.10%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,192,616.33	43,756,566.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,610,942.90	8,715,843.44
应支付基金管理人的净管理费	13,581,673.43	35,040,723.53

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,974,517.52	18,231,902.97

注：1.本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

2.自 2023 年 7 月 10 日起本基金托管费率由 0.25% 调整为 0.20%。

#### 7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达安心回馈混合 A	易方达安心回馈混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	3,282.98	3,282.98
合计	-	3,282.98	3,282.98
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达安心回馈混合 A	易方达安心回馈混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	589.84	589.84
合计	-	589.84	589.84

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

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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。

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

易方达安心回馈混合 A

无。

易方达安心回馈混合 C

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	1,849,353.80	39,158.28	1,361,416.04	71,179.48

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

#### 7.4.10.7 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12月31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12月31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
广发证券股份有限公司	603057	紫燕食品	新股网下 发行	549	8,317.35
广发证券股份有限公司	603255	鼎际得	新股网下 发行	488	10,677.44
广发证券股份有限公司	688496	清越科技	新股网下 发行	12,000	109,920.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

易方达安心回馈混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达安心回馈混合 C

本报告期内未发生利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001239	永达 股份	2023-12-04	6 个月	新股 流通 受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001326	联域 股份	2023-11-01	6 个月	新股 流通 受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣 新材	2023-12-14	6 个月	新股 流通 受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301172	君逸	2023-07-19	6 个月	新股	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-

	数码			流通受限						
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023-08-30	6 个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023-07-06	6 个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6 个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6 个月	新股流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301372	科净源	2023-08-03	6 个月	新股流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301413	安培龙	2023-12-11	6 个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-



301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	新股流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023-08-01	6个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301499	维科精密	2023-07-13	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	新股流通	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-

				受限						
301511	德福科技	2023-08-08	6 个月	新股 流通 受限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6 个月	新股 流通 受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023-12-01	6 个月	新股 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6 个月	新股 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023-07-26	6 个月	新股 流通 受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6 个月	新股 流通 受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	新股 流通 受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6 个月	新股 流通 受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	新股 流通 受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	新股 流通 受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	新股 流通 受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	新股 流通 受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6 个月	新股 流通 受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏	2023-10-24	6 个月	新股	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-

	新材			流通受限						
301558	三态股份	2023-09-21	6 个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新股流通受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6 个月	新股流通受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6 个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6 个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023-10-09	6 个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-

603270	金帝股份	2023-08-25	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688347	华虹公司	2023-07-27	6 个月	新股流通受限	52.00	42.06	57,825	3,006,900.00	2,432,119.50	-
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新股流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6 个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月	新股流通受限	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信宇人	2023-08-09	6 个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688592	司南导航	2023-08-07	6 个月	新股流通受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	新股流通	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-

				受限						
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新股 流通 受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023-07-11	6 个月	新股 流通 受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6 个月	新股 流通 受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新股 流通 受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	新股 流通 受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股 流通 受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	新股 流通 受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新股 流通 受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6 个月	新股 流通 受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新股 流通 受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月	新股 流通 受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	新股 流通 受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月	新股 流通 受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

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。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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 706,941,808.47 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
2028048	20 中国银行 永续债 02	2024-01-02	103.73	500,000	51,863,770.49
2128042	21 兴业银行 二级 02	2024-01-02	102.41	195,000	19,970,489.18
2228011	22 农业银行 永续债 01	2024-01-02	104.56	400,000	41,825,694.25
230206	23 国开 06	2024-01-02	101.29	600,000	60,776,360.66
230421	23 农发 21	2024-01-02	100.57	442,000	44,453,582.40
2128030	21 交通银行 二级	2024-01-04	103.13	528,000	54,450,476.07
2128032	21 兴业银行 二级 01	2024-01-04	103.29	100,000	10,328,926.78
2128033	21 建设银行 二级 03	2024-01-04	102.60	500,000	51,298,524.59
2128042	21 兴业银行 二级 02	2024-01-04	102.41	774,000	79,267,480.13
2128049	21 建设银行 二级 05	2024-01-04	101.95	300,000	30,584,075.41
2228014	22 交通银行 二级 01	2024-01-04	104.64	500,000	52,322,054.79
2228041	22 农业银行 二级 01	2024-01-04	103.56	232,000	24,026,604.59
2128030	21 交通银行 二级	2024-01-05	103.13	472,000	48,675,425.57
2228006	22 中国银行 二级 01	2024-01-05	104.18	300,000	31,252,849.32
2228017	22 邮储银行 二级 01	2024-01-05	104.88	900,000	94,395,216.39
2228041	22 农业银行 二级 01	2024-01-05	103.56	668,000	69,180,051.15
合计				7,411,000	764,671,581.77

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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 113,987,836.25 元，于 2024 年 1 月 2 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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 12 月 31 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 94.38%(2022 年 12 月 31 日：91.80%)。

##### 7.4.13.2.1 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	上年度末

	2023年12月31日	2022年12月31日
A-1	10,336,371.58	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	138,506,516.03	231,371,989.04
合计	148,842,887.61	231,371,989.04

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。

#### 7.4.13.2.2 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12月31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

#### 7.4.13.2.3 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12月31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

#### 7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	1,549,164,566.36	3,322,629,234.80
AAA 以下	187,386,061.66	127,451,783.71



未评级	366,833,460.58	322,817,973.16
合计	2,103,384,088.60	3,772,898,991.67

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。

#### 7.4.13.2.5 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	130,802,139.45	153,710,882.12
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	130,802,139.45	153,710,882.12

#### 7.4.13.2.6 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12月31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

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易,除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外,其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高,组合变现比例能力较好。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	1,849,353.80	-	-	-	1,849,353.80
结算备付金	10,221,512.31	-	-	-	10,221,512.31
存出保证金	213,754.68	-	-	-	213,754.68
交易性金融资产	234,639,252.87	1,348,465,253.81	799,924,608.98	735,003,559.12	3,118,032,674.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,299,187.33	1,299,187.33
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	345,822.81	345,822.81
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	246,923,873.66	1,348,465,253.81	799,924,608.98	736,648,569.26	3,131,962,305.71
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	820,929,644.72	-	-	-	820,929,644.72
应付清算款	-	-	-	150,599.44	150,599.44
应付赎回款	-	-	-	5,341,500.17	5,341,500.17
应付管理人报酬	-	-	-	1,176,857.49	1,176,857.49
应付托管费	-	-	-	392,285.82	392,285.82
应付销售服务费	-	-	-	379.57	379.57
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	92,612.83	92,612.83
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	670,401.08	670,401.08
负债总计	820,929,644.72	-	-	7,824,636.40	828,754,281.12
利率敏感度缺口	-574,005,771.06	1,348,465,253.81	799,924,608.98	728,823,932.86	2,303,208,024.59
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	1,361,416.04	-	-	-	1,361,416.04
结算备付金	62,106,793.26	-	-	-	62,106,793.26
存出保证金	469,629.85	-	-	-	469,629.85
交易性金融资产	443,866,443.43	2,344,597,396.92	1,369,518,022.48	1,475,507,037.73	5,633,488,900.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	54,058,157.53	54,058,157.53
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,217,551.09	1,217,551.09
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	507,804,282.58	2,344,597,396.92	1,369,518,022.48	1,530,782,746.35	5,752,702,448.33
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,464,235,328.53	-	-	-	1,464,235,328.53
应付清算款	-	-	-	52,117,465.90	52,117,465.90
应付赎回款	-	-	-	23,315,903.46	23,315,903.46
应付管理人报酬	-	-	-	2,327,028.11	2,327,028.11
应付托管费	-	-	-	969,595.05	969,595.05
应付销售服务费	-	-	-	350.95	350.95
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	161,007.77	161,007.77
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,196,251.13	1,196,251.13
负债总计	1,464,235,328.53	-	-	80,087,602.37	1,544,322,930.90
利率敏感度缺口	-956,431,045.95	2,344,597,396.92	1,369,518,022.48	1,450,695,143.98	4,208,379,517.43

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	12,397,971.04	22,906,865.94
	2.市场利率上升 25 个基点	-12,286,344.73	-22,709,014.15

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	735,003,559.12	31.91	1,475,507,037.73	35.06
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	735,003,559.12	31.91	1,475,507,037.73	35.06

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	145,631,325.11	322,315,154.46
2.业绩比较基准下降 5%	-145,631,325.11	-322,315,154.46	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	955,911,320.97	1,718,067,452.70
第二层次	2,158,423,172.07	3,891,743,495.37
第三层次	3,698,181.74	23,677,952.49
合计	3,118,032,674.78	5,633,488,900.56

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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和债券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，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	23,677,952.49	23,677,952.49
当期购买	-	28,477,593.06	28,477,593.06
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	43,317,877.81	43,317,877.81
当期利得或损失总额	-	-5,139,486.00	-5,139,486.00
其中：计入损益的利得或损失	-	-5,139,486.00	-5,139,486.00
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	3,698,181.74	3,698,181.74
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-428,745.75	-428,745.75
项目	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	-	-
当期购买	-	28,601,841.81	28,601,841.81
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	7,739,299.15	7,739,299.15
当期利得或损失总额	-	2,815,409.83	2,815,409.83
其中：计入损益的利得或损失	-	2,815,409.83	2,815,409.83
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	23,677,952.49	23,677,952.49
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,964,584.40	1,964,584.40

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	3,698,181.74	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962—2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	23,677,952.49	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2063—2.4756	负相关

## 7.4.14.3 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。

## 7.4.14.4 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。

## 7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

## 8.1 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	735,003,559.12	23.47
	其中：股票	735,003,559.12	23.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,383,029,115.66	76.09
	其中：债券	2,252,226,976.21	71.91
	资产支持证券	130,802,139.45	4.18
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	12,070,866.11	0.39
8	其他各项资产	1,858,764.82	0.06
9	合计	3,131,962,305.71	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	708,421,541.87	30.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,338,404.00	0.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	56,342.59	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	182,646.54	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	20,977,515.42	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069.29	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	735,003,559.12	31.91
--	----	----------------	-------

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601799	星宇股份	869,291	113,972,743.01	4.95
2	600933	爱柯迪	2,863,370	62,822,337.80	2.73
3	601702	华峰铝业	3,478,432	62,437,854.40	2.71
4	002648	卫星化学	2,375,832	35,043,522.00	1.52
5	603197	保隆科技	603,906	34,060,298.40	1.48
6	600486	扬农化工	534,266	33,722,869.92	1.46
7	000708	中信特钢	2,115,928	29,707,629.12	1.29
8	600519	贵州茅台	13,600	23,473,600.00	1.02
9	601100	恒立液压	425,700	23,277,276.00	1.01
10	300750	宁德时代	139,900	22,840,074.00	0.99
11	600872	中炬高新	801,300	22,516,530.00	0.98
12	603259	药明康德	287,946	20,950,950.96	0.91
13	000661	长春高新	141,700	20,659,860.00	0.90
14	600690	海尔智家	941,500	19,771,500.00	0.86
15	000423	东阿阿胶	371,100	18,302,652.00	0.79
16	688200	华峰测控	145,627	17,882,995.60	0.78
17	300037	新宙邦	321,449	15,204,537.70	0.66
18	688169	石头科技	49,886	14,115,243.70	0.61
19	605020	永和股份	445,540	11,142,955.40	0.48
20	000807	云铝股份	873,700	10,676,614.00	0.46
21	603501	韦尔股份	99,134	10,578,589.14	0.46
22	601058	赛轮轮胎	884,800	10,396,400.00	0.45
23	603129	春风动力	94,800	9,692,352.00	0.42
24	600031	三一重工	703,400	9,685,818.00	0.42
25	601233	桐昆股份	624,000	9,441,120.00	0.41
26	300855	图南股份	308,400	9,313,680.00	0.40
27	603997	继峰股份	680,000	9,159,600.00	0.40
28	603915	国茂股份	427,260	7,041,244.80	0.31
29	688106	金宏气体	264,621	6,374,719.89	0.28
30	688268	华特气体	94,149	6,343,759.62	0.28
31	600027	华电国际	1,038,600	5,338,404.00	0.23
32	688601	力芯微	96,093	5,034,312.27	0.22
33	002859	洁美科技	192,437	4,801,303.15	0.21
34	300395	菲利华	126,900	4,639,464.00	0.20
35	688059	华锐精密	52,944	4,167,222.24	0.18
36	002139	拓邦股份	290,400	2,834,304.00	0.12

37	688347	华虹公司	57,825	2,432,119.50	0.11
38	603267	鸿远电子	43,400	2,178,680.00	0.09
39	688036	传音控股	7,669	1,061,389.60	0.05
40	300482	万孚生物	7,400	223,258.00	0.01
41	300274	阳光电源	1,800	157,662.00	0.01
42	688259	创耀科技	1,937	131,580.41	0.01
43	688249	晶合集成	7,405	127,736.25	0.01
44	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
45	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
46	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
47	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
48	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
49	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
50	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
51	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
52	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
53	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
54	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
55	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
56	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
57	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
58	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
59	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
60	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
61	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
62	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
63	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
64	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
65	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
66	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
67	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
68	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
69	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
70	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
71	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
72	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
73	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
74	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
75	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
76	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
77	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
78	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
79	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
80	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00

81	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
82	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
83	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
84	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
85	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
86	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
87	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
88	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
89	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
90	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
91	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
92	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
93	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
94	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
95	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
96	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
97	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
98	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
99	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
100	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
101	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
102	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
103	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
104	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
105	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
106	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
107	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
108	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
109	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
110	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
111	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
112	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
113	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
114	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
115	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
116	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
117	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
118	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
119	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
120	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
121	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
122	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
123	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
124	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00

125	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
126	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
127	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
128	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
129	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
130	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
131	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
132	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
133	300373	扬杰科技	20	734.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	600933	爱柯迪	63,953,258.78	1.52
2	300750	宁德时代	60,614,954.00	1.44
3	601702	华峰铝业	55,779,029.06	1.33
4	002756	永兴材料	43,382,411.39	1.03
5	000858	五粮液	43,223,254.00	1.03
6	603806	福斯特	42,504,394.28	1.01
7	601633	长城汽车	42,033,766.89	1.00
8	688099	晶晨股份	39,022,745.73	0.93
9	603259	药明康德	35,466,216.16	0.84
10	603197	保隆科技	35,400,780.10	0.84
11	601311	骆驼股份	34,583,246.21	0.82
12	600660	福耀玻璃	32,768,130.56	0.78
13	601799	星宇股份	32,178,499.16	0.76
14	688696	极米科技	32,157,921.99	0.76
15	000338	潍柴动力	31,445,473.00	0.75
16	000708	中信特钢	29,478,962.04	0.70
17	603260	合盛硅业	28,842,515.26	0.69
18	000651	格力电器	27,415,237.85	0.65
19	300782	卓胜微	27,097,125.80	0.64
20	002648	卫星化学	26,764,445.23	0.64

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。

##### 8.4.2 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	600036	招商银行	129,409,192.99	3.08
2	000333	美的集团	107,606,295.73	2.56
3	688200	华峰测控	107,444,502.24	2.55
4	601799	星宇股份	104,902,678.73	2.49
5	002756	永兴材料	72,139,086.28	1.71
6	603260	合盛硅业	51,671,388.60	1.23
7	688099	晶晨股份	49,732,973.35	1.18
8	300775	三角防务	48,303,607.10	1.15
9	688696	极米科技	47,606,213.88	1.13
10	002859	洁美科技	47,573,695.38	1.13
11	300373	扬杰科技	44,676,651.42	1.06
12	000858	五粮液	44,374,061.00	1.05
13	000951	中国重汽	42,080,559.60	1.00
14	603712	七一二	39,442,315.55	0.94
15	601633	长城汽车	38,406,968.20	0.91
16	603596	伯特利	35,927,382.00	0.85
17	603305	旭升集团	34,762,506.38	0.83
18	601100	恒立液压	34,742,817.00	0.83
19	002709	天赐材料	33,472,590.64	0.80
20	603806	福斯特	33,315,040.65	0.79

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。

#### 8.4.3 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	1,852,064,777.43
卖出股票收入（成交）总额	2,485,202,860.56

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。

#### 8.5 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	93,150,068.22	4.04
2	央行票据	-	-

3	金融债券	1,139,949,710.03	49.49
	其中：政策性金融债	116,085,594.26	5.04
4	企业债券	194,132,689.31	8.43
5	企业短期融资券	10,336,371.58	0.45
6	中期票据	582,590,688.60	25.29
7	可转债（可交换债）	232,067,448.47	10.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,252,226,976.21	97.79

## 8.6 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	2128042	21 兴业银行二级 02	2,000,000	204,825,530.05	8.89
2	2128030	21 交通银行二级	1,000,000	103,125,901.64	4.48
3	2228017	22 邮储银行二级 01	900,000	94,395,216.39	4.10
4	2228041	22 农业银行二级 01	900,000	93,206,655.74	4.05
5	230022	23 付息国债 22	900,000	91,137,098.36	3.96

## 8.7 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	135242	22 萧万 A	400,000	40,390,897.54	1.75
2	180297	燕山湖 A	300,000	30,529,552.01	1.33
3	156659	PR 产 1A	110,000	10,993,322.03	0.48
4	260418	G 黄河优	100,000	10,143,963.29	0.44
5	112887	G 中交泰 A	100,000	9,898,763.65	0.43
6	193398	PR 产 3A	100,000	9,869,066.87	0.43
7	136324	21 大悦 A	100,000	9,745,426.17	0.42

8	180802	铁建 37A1	100,000	9,231,147.89	0.40
---	--------	---------	---------	--------------	------

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 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。

##### 8.11.2 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚。中国邮政储蓄银行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。

8.12.2 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。

##### 8.12.3 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	213,754.68
2	应收清算款	1,299,187.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	345,822.81
6	其他应收款	-



7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,858,764.82

## 8.12.4 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	110072	广汇转债	27,534,971.57	1.20
2	113056	重银转债	25,898,011.37	1.12
3	113542	好客转债	12,408,126.51	0.54
4	113044	大秦转债	10,892,072.81	0.47
5	113060	浙 22 转债	9,425,502.55	0.41
6	127067	恒逸转 2	8,243,596.27	0.36
7	127061	美锦转债	7,087,279.56	0.31
8	113050	南银转债	6,582,586.17	0.29
9	113021	中信转债	5,619,492.84	0.24
10	132026	G 三峡 EB2	5,606,753.65	0.24
11	113065	齐鲁转债	5,439,373.48	0.24
12	123178	花园转债	5,234,679.34	0.23
13	110093	神马转债	4,595,130.90	0.20
14	127022	恒逸转债	4,345,539.80	0.19
15	113033	利群转债	4,292,964.38	0.19
16	110088	淮 22 转债	4,231,741.17	0.18
17	110083	苏租转债	3,920,068.00	0.17
18	113632	鹤 21 转债	3,467,469.76	0.15
19	128108	蓝帆转债	3,466,151.41	0.15
20	127018	本钢转债	3,375,110.99	0.15
21	127084	柳工转 2	3,260,114.43	0.14
22	127049	希望转 2	3,156,773.96	0.14
23	123190	道氏转 02	3,098,286.52	0.13
24	113037	紫银转债	2,697,477.42	0.12
25	113058	友发转债	2,471,129.89	0.11
26	127086	恒邦转债	2,318,546.87	0.10
27	123104	卫宁转债	2,277,156.16	0.10
28	123114	三角转债	2,096,514.52	0.09
29	118009	华锐转债	1,875,213.59	0.08
30	132018	G 三峡 EB1	1,854,751.23	0.08
31	127016	鲁泰转债	1,791,561.14	0.08

32	127082	亚科转债	1,659,139.90	0.07
33	127063	贵轮转债	1,657,786.10	0.07
34	110075	南航转债	1,410,079.51	0.06
35	113641	华友转债	1,405,169.53	0.06
36	127033	中装转 2	1,393,028.96	0.06
37	127050	麒麟转债	1,292,643.80	0.06
38	113066	平煤转债	1,248,217.12	0.05
39	123187	超达转债	1,167,174.16	0.05
40	123194	百洋转债	1,150,938.83	0.05
41	118031	天 23 转债	1,098,810.64	0.05
42	110047	山鹰转债	1,097,695.89	0.05
43	113662	豪能转债	986,059.31	0.04
44	123188	水羊转债	970,964.62	0.04
45	111008	沿浦转债	832,124.18	0.04
46	110090	爱迪转债	808,574.08	0.04
47	110045	海澜转债	722,414.34	0.03
48	123117	健帆转债	709,189.20	0.03
49	128125	华阳转债	662,660.53	0.03
50	123150	九强转债	548,901.48	0.02
51	118022	锂科转债	488,515.92	0.02
52	123182	广联转债	452,657.25	0.02
53	110067	华安转债	386,638.68	0.02
54	127073	天赐转债	229,319.19	0.01
55	123158	宙邦转债	27,194.22	0.00

#### 8.12.5 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达安心回馈混合 A	108,947	9,328.41	145,530,819.55	14.32%	870,771,115.79	85.68%
易方达安心回馈	44	11,416.74	0.00	0.00%	502,336.54	100.00

混合 C						%
合计	108,991	9,329.25	145,530,819.55	14.31%	871,273,452.33	85.69%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达安心回馈混合 A	1,080,451.32	0.1063%
	易方达安心回馈混合 C	4,071.66	0.8105%
	合计	1,084,522.98	0.1067%

## 9.3 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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	易方达安心回馈混合 A	0
	易方达安心回馈混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达安心回馈混合 A	10~50
	易方达安心回馈混合 C	0
	合计	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达安心回馈混合 A	易方达安心回馈混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	207,386,846.12	-
本报告期期初基金份额总额	1,836,765,868.55	454,151.28
本报告期基金总申购份额	52,739,145.48	579,290.36
减：本报告期基金总赎回份额	873,203,078.69	531,105.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,016,301,935.34	502,336.54

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

## 11.2 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 日起王骏先生担任公司副总经理级高级管理人员（首席市场官）。本基金管理人于 2023 年 8 月 23 日发布公告，自 2023 年 8 月 21 日起刘晓艳女士担任公司董事长（联席），并仍担任公司总经理，原任公司副董事长职务自行免去；自 2023 年 8 月 21 日起吴欣荣先生担任公司执行总经理（总经理级），原任公司副总经理职务自行免去。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 9 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 101,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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	/

### 11.6.2 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	单元数量	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	817,731,397.22	18.99%	654,185.03	21.63%	-
东北证券	1	175,451,242.37	4.07%	140,361.48	4.64%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	54,736,670.43	1.27%	43,789.34	1.45%	-
海通证券	1	1,100,982,707.61	25.56%	880,786.32	29.13%	-
华泰证券	2	839,325,733.77	19.49%	503,597.99	16.65%	-
申万宏源	1	469,421,270.31	10.90%	281,652.78	9.31%	-
西南证券	1	676,019,418.63	15.70%	405,611.65	13.41%	-
银河证券	1	48,104,107.53	1.12%	38,483.30	1.27%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	121,903,182.71	2.83%	73,141.71	2.42%	-
中信证券	1	3,043,682.20	0.07%	2,434.86	0.08%	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为国盛证券有限责任公司，无新增交易单元。

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

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

#### 11.7.2 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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
长江证券	216,379,583.23	12.19%	24,600,100,000.00	33.49%	-	-
东北证券	56,597,276.80	3.19%	88,567,000.00	0.12%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	37,310,231.84	2.10%	1,072,000,000.00	1.46%	-	-
海通证券	289,575,426.31	16.31%	5,582,265,000.00	7.60%	-	-
华泰证券	326,479,837.74	18.39%	12,406,209,000.00	16.89%	-	-
申万宏源	583,219,550.84	32.85%	6,472,300,000.00	8.81%	-	-
西南证券	260,699,367.64	14.69%	18,521,600,000.00	25.22%	-	-
银河证券	-	-	4,631,300,000.00	6.31%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	3,636,327.80	0.20%	74,948,000.00	0.10%	-	-
中信证券	1,291,546.44	0.07%	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2023-01-20
2	易方达安心回馈混合型证券投资基金基金经理变更公告	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	2023-03-04
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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	2023-06-15

		金电子披露网站	
8	易方达基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	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	2023-07-08
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报	2023-07-20
10	易方达基金管理有限公司董事长（联席）任职公告	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	2023-08-23
11	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	2023-08-23
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	上海证券报	2023-08-30
13	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报	2023-10-25

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日