

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52

7.12 投资组合报告附注.....	52
§ 8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	54
§ 9 开放式基金份额变动.....	54
§ 10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	58
§ 12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达量化策略精选混合	
基金主代码	002216	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 19 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	87,820,154.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达量化策略精选混合 A	易方达量化策略精选混合 C
下属分级基金的交易代码	002216	002217
报告期末下属分级基金的份额总额	65,585,748.73 份	22,234,405.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用量化策略进行投资组合管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	量化策略是指根据金融市场历史数据，借助量化模型，进行金融市场的分析、判断和交易的策略。本基金基于不同市场情况，精选多种量化模型进行投资，运用的量化模型包括但不限于量化资产配置模型、多因子量化模型、行业轮动模型、事件超额收益模型。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×60% + 上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778

注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25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； 广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	510620； 519031	100033
法定代表人	刘晓艳	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

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；广东省珠海市横琴新区 荣粤道188号6层

§ 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（2024年1月1日至2024年6月30日）	
	易方达量化策略精选混 合 A	易方达量化策略精选混合 C
本期已实现收益	-657,723.56	-430,527.60
本期利润	-855,496.58	-383,456.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0127	-0.0155
本期加权平均净值利润率	-1.06%	-1.33%
本期基金份额净值增长率	-0.98%	-1.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	易方达量化策略精选混合 A	易方达量化策略精选混合 C

期末可供分配利润	7,062,899.37	1,575,835.22
期末可供分配基金份额利润	0.1077	0.0709
期末基金资产净值	79,328,872.72	26,028,884.36
期末基金份额净值	1.210	1.171
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	易方达量化策略精选混合 A	易方达量化策略精选混合 C
基金份额累计净值增长率	21.00%	17.10%

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

易方达量化策略精选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.12%	0.80%	-1.72%	0.29%	-1.40%	0.51%
过去三个月	-0.90%	0.91%	-0.49%	0.45%	-0.41%	0.46%
过去六个月	-0.98%	1.36%	2.22%	0.53%	-3.20%	0.83%
过去一年	-10.90%	1.15%	-3.78%	0.52%	-7.12%	0.63%
过去三年	-38.70%	1.30%	-16.70%	0.63%	-22.00%	0.67%
自基金合同生效起至今	21.00%	1.36%	5.97%	0.73%	15.03%	0.63%

易方达量化策略精选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.22%	0.79%	-1.72%	0.29%	-1.50%	0.50%
过去三个月	-1.01%	0.92%	-0.49%	0.45%	-0.52%	0.47%
过去六个月	-1.26%	1.36%	2.22%	0.53%	-3.48%	0.83%
过去一年	-11.36%	1.15%	-3.78%	0.52%	-7.58%	0.63%
过去三年	-39.64%	1.30%	-16.70%	0.63%	-22.94%	0.67%
自基金合同生效起至今	17.10%	1.35%	5.97%	0.73%	11.13%	0.62%

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

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 12 月 19 日至 2024 年 6 月 30 日)

易方达量化策略精选混合 A



易方达量化策略精选混合 C



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 21.00%，同期业绩比较基准收益率为 5.97%；C 类基金份额净值增长率为 17.10%，同期业绩比较基准收益率为 5.97%。

§ 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。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
王建军	本基金的基金经理,易方达沪深 300 量化增强、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通量化增强的基金经理, 量化投资部负责人、量化投资决策委员会委员、投资经理	2022-09-14	-	17 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、量化投资部副总经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF 联接、易方达创业板 ETF、易方达中小板指数分级、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达重组分级的基金经理。
黄浩东	本基金的基金经理, 量化研究员	2023-11-09	-	4 年	硕士研究生，具有基金从业资格。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王建军	公募基金	3	988,534,824.14	2021-09-04
	私募资产管理计划	1	13,597,411,855.40	2019-07-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	4	14,585,946,679.54	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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 31 次，其中 26 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，5 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

回顾上半年，国内经济整体呈弱复苏态势。制造业采购经理指数 PMI 上半年仅两个月处于荣枯线上方；服务业 PMI 整体相对较好，上半年均处于荣枯线上方。从消费上看，上半年社会消费品零售总额累计同比增长 3.7%，月度上呈现增速下滑态势，说明居民消费信心不足，消费对经济的刺激潜力有待进一步释放。从投资端来看，上半年固定资产投资完成额累计同比增长 3.9%，月度上同样呈现增速下滑态势，说明投资对经济的拉动有待进一步发力。上半年，房地产政策出台较多，体现了政策对于房地产的呵护，使得经济整体处于稳中向好的发展。

从市场表现来看，上半年宽基指数整体表现震荡，其中上证指数收益率为-0.25%，沪深 300 指数收益率为 0.89%，中证 2000 指数的收益率为-23.28%，成长风格的创业板指数收益率为-10.99%，价值风格的中证红利指数收益率为 7.75%。从风格维度来看，在宏观经济弱复苏的背景下，大盘明显跑赢小盘，价值风格明显战胜成长风格。

报告期内，我们对模型进行了升级迭代，将交易类因子纳入了模型中，进一步地实现了模型的多样化，从更多的维度去积累更丰厚的超额收益，并保持投资策略与偏股混合型基金风格的偏离在可控的范围内，力争为投资者创造稳健且持续的超额回报。

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 1.210 元，本报告期份额净值增长率为-0.98%，同期业绩比较基准收益率为 2.22%；C 类基金份额净值为 1.171 元，本报告期份额净值增长率为-1.26%，同期业绩比较基准收益率为 2.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，宏观经济可能仍然会处于弱复苏状态，新质生产力有望逐步成为拉动经济增长的主动力。对于股票市场来说，我们现在可以更乐观一些。因为从宏观维度来看，经济逐步企稳；从政策维度看，房地产的支持政策与新质生产力的政策有望支撑起经济的韧性；从量化的角度来看，以沪深 300 指数市盈率倒数减去中国 10 年期国债收益率为代表的权益资产性价比指数仍然处于历史低估区间，表明当前权益资产处于具有性价比的位置。站在这个时点，在未来经济弱复苏、政策积极的背景下，以较高性价比的资产价格去持有权益资产大概率是一件正确的事情。从风格角度来看，下一阶段以新质生产力为代表的成长风格可能会占优。

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

易方达量化策略精选混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达量化策略精选混合 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监

督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	5,456,521.35	6,233,507.97
结算备付金		839,946.64	894,892.10
存出保证金		25,699.48	22,799.64
交易性金融资产	6.4.7.2	90,333,735.43	107,138,063.89
其中：股票投资		90,333,735.43	107,051,359.38
基金投资		-	-
债券投资		-	86,704.51
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	8,500,000.00	-
应收清算款		502,541.58	118,322.22
应收股利		-	-
应收申购款		14,852.64	105,976.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		105,673,297.12	114,513,562.08
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	102,350.74
应付赎回款		260.18	111,723.03
应付管理人报酬		106,017.04	115,266.52
应付托管费		17,669.54	19,211.09
应付销售服务费		10,979.49	13,163.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	180,613.79	219,828.41
负债合计		315,540.04	581,543.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	87,820,154.46	93,984,086.91
未分配利润	6.4.7.8	17,537,602.62	19,947,931.64
净资产合计		105,357,757.08	113,932,018.55
负债和净资产总计		105,673,297.12	114,513,562.08

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.210 元，C 类基金份额净值 1.171 元；基金份额总额 87,820,154.46 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 65,585,748.73 份，C 类基金份额总额 22,234,405.73 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-325,592.93	-20,865,197.29
1.利息收入		32,240.47	30,691.80
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,093.80	30,691.80
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		15,146.67	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-212,380.30	-20,990,131.39

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,575,106.37	-22,243,541.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	15,543.23	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,347,182.84	1,253,410.02
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	-150,702.24	-2,006.51
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	5,249.14	96,248.81
减：二、营业总支出		913,360.47	2,441,056.63
1. 管理人报酬		652,827.66	1,784,532.27
2. 托管费		108,804.63	297,422.05
3. 销售服务费		71,292.11	267,835.60
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.03	-
8. 其他费用	6.4.7.18	80,436.04	91,266.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,238,953.40	-23,306,253.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,238,953.40	-23,306,253.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,238,953.40	-23,306,253.92

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	93,984,086.91	19,947,931.64	113,932,018.55
二、本期期初净资产	93,984,086.91	19,947,931.64	113,932,018.55

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,163,932.45	-2,410,329.02	-8,574,261.47
（一）、综合收益总额	-	-1,238,953.40	-1,238,953.40
（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）	-6,163,932.45	-1,171,375.62	-7,335,308.07
其中：1.基金申购款	2,282,955.78	416,884.63	2,699,840.41
2.基金赎回款	-8,446,888.23	-1,588,260.25	-10,035,148.48
（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	87,820,154.46	17,537,602.62	105,357,757.08
项目	上年度可比期间 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	188,365,864.06	91,337,471.59	279,703,335.65
二、本期期初净资产	188,365,864.06	91,337,471.59	279,703,335.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-89,211,206.58	-56,994,391.25	-146,205,597.83
（一）、综合收益总额	-	-23,306,253.92	-23,306,253.92
（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）	-89,211,206.58	-33,688,137.33	-122,899,343.91
其中：1.基金申购款	4,318,493.63	1,925,685.17	6,244,178.80
2.基金赎回款	-93,529,700.21	-35,613,822.50	-129,143,522.71
（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	99,154,657.48	34,343,080.34	133,497,737.82

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

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2746号《关于准予易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2017]1098号《关于易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年12月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为422,049,630.98份基金份额，其中认购资金利息折合112,665.58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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红

利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,456,521.35
等于：本金	5,456,035.47
加：应计利息	485.88
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	5,456,521.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	93,095,683.35	-	90,333,735.43	-2,761,947.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	-	-	-
	市场	-	-	-
	银行间	-	-	-

	市场				
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		93,095,683.35	-	90,333,735.43	-2,761,947.92

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	8,500,000.00	-

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 2024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	101,050.67
其中：交易所市场	101,050.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,563.12
合计	180,613.79

6.4.7.7 实收基金

易方达量化策略精选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,727,297.42	67,727,297.42
本期申购	1,190,333.93	1,190,333.93
本期赎回（以“-”号填列）	-3,331,882.62	-3,331,882.62
本期末	65,585,748.73	65,585,748.73

易方达量化策略精选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,256,789.49	26,256,789.49
本期申购	1,092,621.85	1,092,621.85
本期赎回（以“-”号填列）	-5,115,005.61	-5,115,005.61
本期末	22,234,405.73	22,234,405.73

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

易方达量化策略精选混合 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	7,892,268.51	7,170,492.14	15,062,760.65
本期期初	7,892,268.51	7,170,492.14	15,062,760.65
本期利润	-657,723.56	-197,773.02	-855,496.58
本期基金份额交易产生的变动数	-171,645.58	-292,494.50	-464,140.08
其中：基金申购款	65,110.29	174,644.63	239,754.92
基金赎回款	-236,755.87	-467,139.13	-703,895.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,062,899.37	6,680,224.62	13,743,123.99

易方达量化策略精选混合 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	2,164,695.86	2,720,475.13	4,885,170.99
本期期初	2,164,695.86	2,720,475.13	4,885,170.99
本期利润	-430,527.60	47,070.78	-383,456.82
本期基金份额交易产生的变动数	-158,333.04	-548,902.50	-707,235.54
其中：基金申购款	37,378.49	139,751.22	177,129.71
基金赎回款	-195,711.53	-688,653.72	-884,365.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,575,835.22	2,218,643.41	3,794,478.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	12,708.61
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	4,225.95
其他	159.24
合计	17,093.80

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,575,106.37
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	-1,575,106.37

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	384,012,744.63
减：卖出股票成本总额	385,169,999.25
减：交易费用	417,851.75
买卖股票差价收入	-1,575,106.37

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	13.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,529.56
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	15,543.23

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	104,252.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	88,698.67
减：应计利息总额	19.75
减：交易费用	4.18
买卖债券差价收入	15,529.56

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,347,182.84
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,347,182.84

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-150,702.24
——股票投资	-150,702.24
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-150,702.24

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	5,249.14
合计	5,249.14

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	872.92
合计	80,436.04

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	652,827.66	1,784,532.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	92,606.81	230,520.54
应支付基金管理人的净管理费	560,220.85	1,554,011.73

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5

个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	108,804.63	297,422.05

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达量化策略精选混合 A	易方达量化策略精选混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	11,339.46	11,339.46
中国建设银行	-	5,460.84	5,460.84
广发证券	-	88.56	88.56
合计	-	16,888.86	16,888.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达量化策略精选混合 A	易方达量化策略精选混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	93,218.38	93,218.38

中国建设银行	-	7,504.23	7,504.23
广发证券	-	105.15	105.15
合计	-	100,827.76	100,827.76

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 0.50%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

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销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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

易方达量化策略精选混合 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
易方达资产管理有 限公司	49,999,000.00	76.2345%	49,999,000.00	73.8240%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

易方达量化策略精选混合 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	5,456,521.35	12,708.61	7,949,312.50	29,580.12

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设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 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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	1,677	41,354.82

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

易方达量化策略精选混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达量化策略精选混合 C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2024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
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股流通受限	16.20	15.96	160	2,592.00	2,553.60	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	52	1,106.56	1,533.48	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	43	1,247.86	1,090.48	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	19	1,376.74	1,293.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	67	1,285.06	1,518.22	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股流通受限	38.18	38.90	33	1,259.94	1,283.70	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	新股流通受限	22.66	15.89	166	3,761.56	2,637.74	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	129	2,561.94	5,483.79	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	39	3,391.44	6,822.27	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	109	2,444.87	3,438.95	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	209	3,279.21	3,927.11	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在

交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2024 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 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.08%)。

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 2024年6月30日	上年度末 2023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

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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	86,704.51
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	86,704.51

- 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2024 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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,456,521.35	-	-	-	5,456,521.35
结算备付金	839,946.64	-	-	-	839,946.64
存出保证金	25,699.48	-	-	-	25,699.48
交易性金融资产	-	-	-	90,333,735.43	90,333,735.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	8,500,000.00	-	-	-	8,500,000.00
应收清算款	-	-	-	502,541.58	502,541.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	14,852.64	14,852.64

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,822,167.47	-	-	90,851,129.65	105,673,297.12
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	260.18	260.18
应付管理人报酬	-	-	-	106,017.04	106,017.04
应付托管费	-	-	-	17,669.54	17,669.54
应付销售服务费	-	-	-	10,979.49	10,979.49
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	180,613.79	180,613.79
负债总计	-	-	-	315,540.04	315,540.04
利率敏感度缺口	14,822,167.47	-	-	90,535,589.61	105,357,757.08
上年度末					
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	6,233,507.97	-	-	-	6,233,507.97
结算备付金	894,892.10	-	-	-	894,892.10
存出保证金	22,799.64	-	-	-	22,799.64
交易性金融资产	-	67,003.09	19,701.42	107,051,359.38	107,138,063.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	118,322.22	118,322.22
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	105,976.26	105,976.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,151,199.71	67,003.09	19,701.42	107,275,657.86	114,513,562.08
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	102,350.74	102,350.74
应付赎回款	-	-	-	111,723.03	111,723.03
应付管理人报酬	-	-	-	115,266.52	115,266.52
应付托管费	-	-	-	19,211.09	19,211.09
应付销售服务费	-	-	-	13,163.67	13,163.67
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.07	0.07
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	219,828.41	219,828.41
负债总计	-	-	-	581,543.53	581,543.53
利率敏感度缺口	7,151,199.71	67,003.09	19,701.42	106,694,114.33	113,932,018.55

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

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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，因此无重大外汇风险。

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	90,333,735.43	85.74	107,051,359.38	93.96
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	90,333,735.43	85.74	107,051,359.38	93.96

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	7,801,525.82	7,851,328.78
	2.业绩比较基准下降5%	-7,801,525.82	-7,851,328.78

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
---------------	-----

	2024 年 6 月 30 日
第一层次	90,296,614.55
第二层次	-
第三层次	37,120.88
合计	90,333,735.43

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	90,333,735.43	85.48
	其中：股票	90,333,735.43	85.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	8,500,000.00	8.04
	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	6,296,467.99	5.96
8	其他各项资产	543,093.70	0.51
9	合计	105,673,297.12	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	2,886,020.00	2.74
B	采矿业	8,385,029.00	7.96
C	制造业	61,554,302.57	58.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,970,760.00	4.72
E	建筑业	809,978.00	0.77
F	批发和零售业	590,394.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	1,338,836.00	1.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,217,192.09	3.05
J	金融业	4,076,985.30	3.87
K	房地产业	272,988.00	0.26
L	租赁和商务服务业	290,663.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	519,266.77	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	597,355.70	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	86,240.00	0.08
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	567,679.00	0.54
S	综合	170,046.00	0.16
	合计	90,333,735.43	85.74

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	300750	宁德时代	7,760	1,397,032.80	1.33
2	002432	九安医疗	30,300	1,228,362.00	1.17
3	600519	贵州茅台	800	1,173,912.00	1.11
4	601600	中国铝业	136,900	1,044,547.00	0.99
5	300979	华利集团	17,100	1,040,535.00	0.99
6	300498	温氏股份	49,100	973,162.00	0.92
7	601899	紫金矿业	51,800	910,126.00	0.86
8	002475	立讯精密	21,000	825,510.00	0.78
9	601857	中国石油	79,300	818,376.00	0.78
10	601666	平煤股份	69,500	778,400.00	0.74
11	002463	沪电股份	20,000	730,000.00	0.69
12	600938	中国海油	20,700	683,100.00	0.65
13	603993	洛阳钼业	77,900	662,150.00	0.63
14	603477	巨星农牧	22,500	645,750.00	0.61
15	300677	英科医疗	22,200	595,182.00	0.56
16	600011	华能国际	55,500	533,910.00	0.51
17	600690	海尔智家	18,700	530,706.00	0.50
18	601058	赛轮轮胎	37,700	527,800.00	0.50
19	000933	神火股份	25,900	523,957.00	0.50
20	605296	神农集团	14,800	520,220.00	0.49
21	601825	沪农商行	77,400	520,128.00	0.49
22	600985	淮北矿业	30,900	517,266.00	0.49
23	600027	华电国际	73,800	512,172.00	0.49
24	600546	山煤国际	34,700	507,314.00	0.48
25	600975	新五丰	71,200	503,384.00	0.48
26	000568	泸州老窖	3,500	502,215.00	0.48
27	001286	陕西能源	43,400	500,402.00	0.47
28	000001	平安银行	49,300	500,395.00	0.47
29	000983	山西焦煤	47,600	490,756.00	0.47
30	601668	中国建筑	91,500	485,865.00	0.46
31	000937	冀中能源	71,700	480,390.00	0.46
32	002371	北方华创	1,500	479,835.00	0.46
33	600642	申能股份	53,700	474,171.00	0.45
34	600497	驰宏锌锗	85,800	458,172.00	0.43
35	600219	南山铝业	119,600	455,676.00	0.43
36	601138	工业富联	16,400	449,360.00	0.43
37	002601	龙佰集团	23,800	441,966.00	0.42

38	002966	苏州银行	58,500	438,750.00	0.42
39	000725	京东方 A	104,300	426,587.00	0.40
40	300274	阳光电源	6,860	425,525.80	0.40
41	000690	宝新能源	83,400	425,340.00	0.40
42	601717	郑煤机	28,400	420,320.00	0.40
43	301109	军信股份	27,900	417,105.00	0.40
44	600809	山西汾酒	1,900	400,672.00	0.38
45	603551	奥普科技	40,100	392,980.00	0.37
46	605377	华旺科技	29,560	391,670.00	0.37
47	002273	水晶光电	23,000	390,540.00	0.37
48	300049	福瑞股份	7,500	377,550.00	0.36
49	002984	森麒麟	14,800	356,532.00	0.34
50	002823	凯中精密	28,500	347,700.00	0.33
51	301004	嘉益股份	3,800	345,800.00	0.33
52	688008	澜起科技	5,785	330,670.60	0.31
53	600547	山东黄金	12,000	328,560.00	0.31
54	600887	伊利股份	12,700	328,168.00	0.31
55	600000	浦发银行	39,500	325,085.00	0.31
56	300743	天地数码	24,000	324,960.00	0.31
57	601963	重庆银行	41,800	323,950.00	0.31
58	002807	江阴银行	85,400	321,958.00	0.31
59	000858	五粮液	2,494	319,331.76	0.30
60	002001	新和成	16,600	318,720.00	0.30
61	603198	迎驾贡酒	5,500	316,250.00	0.30
62	000333	美的集团	4,900	316,050.00	0.30
63	002100	天康生物	45,600	316,008.00	0.30
64	601500	通用股份	58,500	312,390.00	0.30
65	002106	莱宝高科	28,500	310,650.00	0.29
66	002567	唐人神	57,700	309,272.00	0.29
67	300879	大叶股份	23,100	309,078.00	0.29
68	603583	捷昌驱动	15,000	305,700.00	0.29
69	688510	航亚科技	16,575	305,145.75	0.29
70	002139	拓邦股份	28,700	304,794.00	0.29
71	301327	华宝新能	5,300	303,690.00	0.29
72	002840	华统股份	18,200	301,938.00	0.29
73	001206	依依股份	23,000	299,460.00	0.28
74	300403	汉宇集团	43,800	299,154.00	0.28
75	603236	移远通信	6,400	299,072.00	0.28
76	603501	韦尔股份	3,005	298,606.85	0.28
77	300577	开润股份	14,300	297,869.00	0.28
78	688169	石头科技	754	296,020.40	0.28
79	688767	博拓生物	11,568	290,009.76	0.28
80	000400	许继电气	8,400	289,044.00	0.27
81	300636	同和药业	28,000	284,760.00	0.27

82	002399	海普瑞	32,500	281,775.00	0.27
83	600521	华海药业	16,500	281,325.00	0.27
84	301193	家联科技	17,300	276,108.00	0.26
85	600098	广州发展	42,100	269,440.00	0.26
86	600023	浙能电力	36,400	258,804.00	0.25
87	600160	巨化股份	10,600	255,778.00	0.24
88	688018	乐鑫科技	2,572	253,804.96	0.24
89	002156	通富微电	11,300	253,007.00	0.24
90	000651	格力电器	6,400	251,008.00	0.24
91	600183	生益科技	11,700	246,402.00	0.23
92	601918	新集能源	25,100	244,725.00	0.23
93	600578	京能电力	75,400	244,296.00	0.23
94	688019	安集科技	1,923	241,913.40	0.23
95	603228	景旺电子	7,600	241,680.00	0.23
96	002608	江苏国信	31,000	240,250.00	0.23
97	600863	内蒙华电	51,600	239,424.00	0.23
98	300705	九典制药	8,940	239,055.60	0.23
99	600502	安徽建工	55,500	238,650.00	0.23
100	600021	上海电力	24,000	237,360.00	0.23
101	601328	交通银行	31,500	235,305.00	0.22
102	603727	博迈科	17,700	232,932.00	0.22
103	000596	古井贡酒	1,100	232,177.00	0.22
104	000027	深圳能源	31,700	231,410.00	0.22
105	002444	巨星科技	9,300	229,710.00	0.22
106	601128	常熟银行	30,290	229,295.30	0.22
107	601989	中国重工	45,700	225,301.00	0.21
108	600926	杭州银行	17,200	224,460.00	0.21
109	000876	新希望	24,400	223,016.00	0.21
110	300181	佐力药业	14,700	222,264.00	0.21
111	300054	鼎龙股份	9,700	219,996.00	0.21
112	300251	光线传媒	26,100	219,501.00	0.21
113	600893	航发动力	6,000	219,300.00	0.21
114	600153	建发股份	24,500	218,785.00	0.21
115	600285	羚锐制药	9,000	217,890.00	0.21
116	300761	立华股份	9,600	217,344.00	0.21
117	300628	亿联网络	5,900	216,943.00	0.21
118	000039	中集集团	23,400	216,684.00	0.21
119	300857	协创数据	3,800	216,600.00	0.21
120	603806	福斯特	14,700	216,090.00	0.21
121	600114	东睦股份	14,800	212,972.00	0.20
122	002532	天山铝业	25,900	210,049.00	0.20
123	003000	劲仔食品	17,400	209,670.00	0.20
124	002948	青岛银行	61,300	206,581.00	0.20
125	605555	德昌股份	11,100	206,571.00	0.20

126	600872	中炬高新	9,100	206,479.00	0.20
127	600176	中国巨石	18,600	205,530.00	0.20
128	300017	网宿科技	25,800	203,820.00	0.19
129	300760	迈瑞医疗	700	203,637.00	0.19
130	603486	科沃斯	4,300	202,874.00	0.19
131	601865	福莱特	10,000	201,000.00	0.19
132	002154	报喜鸟	36,900	200,736.00	0.19
133	002557	洽洽食品	7,100	200,149.00	0.19
134	300673	佩蒂股份	15,100	198,112.00	0.19
135	601601	中国太保	7,100	197,806.00	0.19
136	688208	道通科技	8,171	197,247.94	0.19
137	688117	圣诺生物	8,020	196,810.80	0.19
138	002315	焦点科技	7,300	196,808.00	0.19
139	600282	南钢股份	39,500	196,710.00	0.19
140	002928	华夏航空	31,000	196,540.00	0.19
141	000975	银泰黄金	12,000	195,480.00	0.19
142	605333	沪光股份	7,000	194,950.00	0.19
143	601001	晋控煤业	11,800	194,936.00	0.19
144	601633	长城汽车	7,700	194,810.00	0.18
145	601333	广深铁路	60,100	194,724.00	0.18
146	688484	南芯科技	5,225	193,847.50	0.18
147	002558	巨人网络	20,500	193,520.00	0.18
148	600038	中直股份	4,700	193,217.00	0.18
149	600346	恒力石化	13,800	192,510.00	0.18
150	603368	柳药集团	11,000	192,500.00	0.18
151	601816	京沪高铁	35,700	191,709.00	0.18
152	002540	亚太科技	36,200	191,498.00	0.18
153	603558	健盛集团	19,200	191,040.00	0.18
154	688578	艾力斯	2,987	190,391.38	0.18
155	000915	华特达因	6,300	190,008.00	0.18
156	688516	奥特维	4,538	189,733.78	0.18
157	601991	大唐发电	63,000	189,630.00	0.18
158	603711	香飘飘	13,600	188,360.00	0.18
159	600256	广汇能源	28,000	187,600.00	0.18
160	688108	赛诺医疗	20,951	187,301.94	0.18
161	003021	兆威机电	4,020	185,523.00	0.18
162	688155	先惠技术	4,682	185,126.28	0.18
163	300207	欣旺达	12,200	185,074.00	0.18
164	688093	世华科技	10,172	184,825.24	0.18
165	300783	三只松鼠	8,400	183,708.00	0.17
166	002296	辉煌科技	17,800	183,518.00	0.17
167	301498	乖宝宠物	3,400	182,920.00	0.17
168	000860	顺鑫农业	10,900	182,466.00	0.17
169	688234	天岳先进	3,882	182,143.44	0.17

170	688517	金冠电气	13,010	181,879.80	0.17
171	002773	康弘药业	8,400	181,860.00	0.17
172	605166	聚合顺	17,300	181,477.00	0.17
173	603496	恒为科技	7,400	180,930.00	0.17
174	603726	朗迪集团	13,500	180,900.00	0.17
175	002897	意华股份	4,800	180,768.00	0.17
176	300396	迪瑞医疗	8,900	180,759.00	0.17
177	300482	万孚生物	7,400	180,560.00	0.17
178	601665	齐鲁银行	36,700	180,197.00	0.17
179	600362	江西铜业	7,600	179,968.00	0.17
180	600480	凌云股份	18,300	179,889.00	0.17
181	688798	艾为电子	3,174	179,711.88	0.17
182	002019	亿帆医药	14,500	179,220.00	0.17
183	301199	迈赫股份	7,400	178,932.00	0.17
184	688253	英诺特	4,694	178,888.34	0.17
185	002073	软控股份	24,200	178,838.00	0.17
186	605111	新洁能	5,840	178,645.60	0.17
187	001207	联科科技	12,300	178,596.00	0.17
188	300589	江龙船艇	15,000	178,200.00	0.17
189	688685	迈信林	7,284	178,093.80	0.17
190	002026	山东威达	21,400	177,620.00	0.17
191	300872	天阳科技	13,400	177,550.00	0.17
192	301285	鸿日达	6,800	177,412.00	0.17
193	688226	威腾电气	10,140	177,247.20	0.17
194	600276	恒瑞医药	4,600	176,916.00	0.17
195	002267	陕天然气	23,400	176,904.00	0.17
196	002215	诺普信	23,700	176,565.00	0.17
197	688401	路维光电	6,736	176,483.20	0.17
198	300916	朗特智能	7,000	176,260.00	0.17
199	603809	豪能股份	21,796	176,111.68	0.17
200	601528	瑞丰银行	37,200	175,584.00	0.17
201	300790	宇瞳光学	13,000	175,500.00	0.17
202	688581	安杰思	3,584	175,365.12	0.17
203	603269	海鸥股份	17,840	175,188.80	0.17
204	000703	恒逸石化	24,700	175,123.00	0.17
205	300634	彩讯股份	10,400	175,032.00	0.17
206	300170	汉得信息	28,500	174,990.00	0.17
207	300428	立中集团	9,400	174,746.00	0.17
208	002979	雷赛智能	9,600	174,720.00	0.17
209	603039	泛微网络	5,500	174,680.00	0.17
210	603103	横店影视	12,600	174,384.00	0.17
211	000758	中色股份	34,300	174,244.00	0.17
212	688690	纳微科技	10,031	174,238.47	0.17
213	688150	莱特光电	8,972	174,056.80	0.17

214	603220	中贝通信	6,400	173,824.00	0.16
215	600158	中体产业	22,600	173,794.00	0.16
216	300950	德固特	11,400	173,736.00	0.16
217	300424	航新科技	14,200	173,666.00	0.16
218	300660	江苏雷利	6,800	173,536.00	0.16
219	001213	中铁特货	43,900	173,405.00	0.16
220	000990	诚志股份	23,300	173,352.00	0.16
221	300307	慈星股份	29,100	173,145.00	0.16
222	688528	秦川物联	21,623	172,767.77	0.16
223	603239	浙江仙通	12,600	172,746.00	0.16
224	300249	依米康	26,600	172,368.00	0.16
225	000788	北大医药	34,500	172,155.00	0.16
226	002461	珠江啤酒	23,200	172,144.00	0.16
227	605389	长龄液压	8,200	172,118.00	0.16
228	600727	鲁北化工	27,300	171,990.00	0.16
229	301028	东亚机械	19,600	171,892.00	0.16
230	601700	风范股份	39,100	171,649.00	0.16
231	000544	中原环保	21,800	171,566.00	0.16
232	000797	中国武夷	73,600	171,488.00	0.16
233	002340	格林美	26,900	171,353.00	0.16
234	605018	长华集团	18,900	171,234.00	0.16
235	000710	贝瑞基因	23,800	170,884.00	0.16
236	002423	中粮资本	22,800	170,772.00	0.16
237	603976	正川股份	12,100	170,731.00	0.16
238	600315	上海家化	9,600	170,688.00	0.16
239	002165	红宝丽	51,700	170,610.00	0.16
240	688267	中触媒	8,587	170,537.82	0.16
241	603516	淳中科技	5,400	170,478.00	0.16
242	688678	福立旺	15,722	170,269.26	0.16
243	688616	西力科技	15,001	170,111.34	0.16
244	000532	华金资本	14,100	170,046.00	0.16
245	301301	川宁生物	13,300	169,974.00	0.16
246	300915	海融科技	6,500	169,910.00	0.16
247	605507	国邦医药	10,200	169,830.00	0.16
248	603693	江苏新能	14,600	169,652.00	0.16
249	300492	华图山鼎	1,800	169,560.00	0.16
250	301081	严牌股份	22,600	169,500.00	0.16
251	603535	嘉诚国际	10,500	169,470.00	0.16
252	300432	富临精工	26,300	169,372.00	0.16
253	300708	聚灿光电	18,800	169,200.00	0.16
254	002237	恒邦股份	14,700	169,197.00	0.16
255	688136	科兴制药	10,092	169,141.92	0.16
256	688183	生益电子	8,726	169,109.88	0.16
257	688222	成都先导	14,899	169,103.65	0.16

258	300758	七彩化学	15,700	168,775.00	0.16
259	603380	易德龙	8,400	168,672.00	0.16
260	603055	台华新材	16,600	168,158.00	0.16
261	300885	海昌新材	18,900	168,021.00	0.16
262	601566	九牧王	19,900	167,558.00	0.16
263	000930	中粮科技	33,300	167,499.00	0.16
264	002988	豪美新材	10,900	167,315.00	0.16
265	002534	西子洁能	16,700	167,167.00	0.16
266	300707	威唐工业	13,500	167,130.00	0.16
267	000913	钱江摩托	10,600	167,056.00	0.16
268	600711	盛屯矿业	45,300	166,251.00	0.16
269	002752	昇兴股份	32,800	165,968.00	0.16
270	688138	清溢光电	7,697	165,485.50	0.16
271	688480	赛恩斯	5,935	165,349.10	0.16
272	002035	华帝股份	26,300	163,849.00	0.16
273	300842	帝科股份	4,200	162,960.00	0.15
274	603201	常润股份	6,700	162,140.00	0.15
275	600575	淮河能源	41,600	161,824.00	0.15
276	000338	潍柴动力	9,800	159,152.00	0.15
276	300002	神州泰岳	19,600	159,152.00	0.15
278	688233	神工股份	8,244	158,861.88	0.15
279	688188	柏楚电子	858	158,343.90	0.15
280	301061	匠心家居	3,360	157,785.60	0.15
281	605499	东鹏饮料	700	151,025.00	0.14
282	300661	圣邦股份	1,800	149,004.00	0.14
283	603337	杰克股份	5,600	147,392.00	0.14
284	301299	卓创资讯	3,500	147,000.00	0.14
285	002050	三花智控	7,500	143,100.00	0.14
286	002947	恒铭达	4,000	140,800.00	0.13
287	301503	智迪科技	4,200	139,524.00	0.13
288	605116	奥锐特	5,500	137,665.00	0.13
289	688036	传音控股	1,744	133,485.76	0.13
290	603507	振江股份	4,000	131,280.00	0.12
291	601975	招商南油	36,300	130,317.00	0.12
292	300433	蓝思科技	7,100	129,575.00	0.12
293	600941	中国移动	1,200	129,000.00	0.12
294	603408	建霖家居	9,700	127,943.00	0.12
295	603617	君禾股份	21,500	126,850.00	0.12
296	603992	松霖科技	6,800	125,052.00	0.12
297	300968	格林精密	13,500	125,010.00	0.12
298	688012	中微公司	880	124,308.80	0.12
299	002635	安洁科技	8,000	123,520.00	0.12
300	301171	易点天下	8,400	123,480.00	0.12
301	300886	华业香料	7,500	123,150.00	0.12

302	002884	凌霄泵业	6,400	122,880.00	0.12
303	600933	爱柯迪	8,300	122,757.00	0.12
304	300120	经纬辉开	23,600	122,484.00	0.12
305	603580	艾艾精工	6,400	121,792.00	0.12
306	300907	康平科技	6,400	121,536.00	0.12
307	603730	岱美股份	12,200	121,268.00	0.12
308	600278	东方创业	22,500	120,825.00	0.11
309	000923	河钢资源	7,000	120,540.00	0.11
310	688210	统联精密	5,433	120,340.95	0.11
311	600299	安迪苏	12,400	120,280.00	0.11
312	603277	银都股份	4,000	120,160.00	0.11
313	000887	中鼎股份	9,800	119,952.00	0.11
314	600426	华鲁恒升	4,500	119,880.00	0.11
315	301298	东利机械	9,400	119,850.00	0.11
316	002083	孚日股份	28,300	119,709.00	0.11
317	002166	莱茵生物	17,500	119,700.00	0.11
318	603238	诺邦股份	12,000	119,520.00	0.11
319	002365	永安药业	16,500	119,130.00	0.11
320	002970	锐明技术	3,300	118,899.00	0.11
321	600439	瑞贝卡	55,300	118,895.00	0.11
322	603221	爱丽家居	13,400	118,858.00	0.11
323	600699	均胜电子	8,000	118,560.00	0.11
324	600150	中国船舶	2,900	118,059.00	0.11
325	603089	正裕工业	14,100	117,876.00	0.11
326	603235	天新药业	4,900	117,747.00	0.11
327	688087	英科再生	4,541	117,521.08	0.11
328	605376	博迁新材	5,200	117,364.00	0.11
329	301260	格力博	8,600	117,132.00	0.11
330	002536	飞龙股份	12,300	117,096.00	0.11
331	605080	浙江自然	7,400	117,068.00	0.11
332	300562	乐心医疗	13,100	116,721.00	0.11
333	603005	晶方科技	5,700	116,166.00	0.11
334	000921	海信家电	3,600	116,064.00	0.11
335	301206	三元生物	4,700	115,526.00	0.11
336	301219	腾远钴业	3,000	114,780.00	0.11
337	688550	瑞联新材	4,937	114,489.03	0.11
338	603733	仙鹤股份	6,500	114,270.00	0.11
339	688055	龙腾光电	36,023	114,192.91	0.11
340	002326	永太科技	14,600	114,172.00	0.11
341	603219	富佳股份	7,700	113,652.00	0.11
342	002311	海大集团	2,400	112,920.00	0.11
343	000807	云铝股份	8,000	108,080.00	0.10
344	600066	宇通客车	4,100	105,780.00	0.10
345	002078	太阳纸业	7,500	104,625.00	0.10

346	002422	科伦药业	3,400	103,122.00	0.10
347	601225	陕西煤业	4,000	103,080.00	0.10
348	002997	瑞鹄模具	3,200	102,304.00	0.10
349	000100	TCL 科技	23,600	101,952.00	0.10
350	688363	华熙生物	1,773	100,298.61	0.10
351	688111	金山办公	440	100,100.00	0.10
352	603606	东方电缆	2,000	97,620.00	0.09
353	300976	达瑞电子	2,100	96,285.00	0.09
354	600262	北方股份	5,800	95,294.00	0.09
355	000926	福星股份	30,000	95,100.00	0.09
356	000977	浪潮信息	2,600	94,562.00	0.09
357	000423	东阿阿胶	1,500	93,900.00	0.09
358	688120	华海清科	493	93,462.94	0.09
359	688506	百利天恒	504	91,425.60	0.09
360	603365	水星家纺	5,700	89,205.00	0.08
361	002697	红旗连锁	19,200	88,896.00	0.08
362	603605	珀莱雅	800	88,792.00	0.08
363	300573	兴齐眼药	540	88,560.00	0.08
364	002975	博杰股份	2,900	86,652.00	0.08
365	000526	学大教育	1,400	86,240.00	0.08
366	603379	三美股份	2,200	86,108.00	0.08
367	601068	中铝国际	20,300	85,463.00	0.08
368	300014	亿纬锂能	2,100	83,832.00	0.08
369	688072	拓荆科技	693	83,236.23	0.08
370	003006	百亚股份	3,500	82,950.00	0.08
371	002318	久立特材	3,500	81,655.00	0.08
372	600660	福耀玻璃	1,700	81,430.00	0.08
373	300679	电连技术	2,000	80,460.00	0.08
374	300529	健帆生物	2,900	78,909.00	0.07
375	600566	济川药业	2,300	72,933.00	0.07
376	000786	北新建材	2,400	71,184.00	0.07
377	688076	诺泰生物	902	70,608.56	0.07
378	601567	三星医疗	2,000	70,000.00	0.07
379	603369	今世缘	1,500	69,300.00	0.07
380	688789	宏华数科	640	68,992.00	0.07
381	300308	中际旭创	500	68,940.00	0.07
382	002850	科达利	900	68,742.00	0.07
383	601728	中国电信	11,100	68,265.00	0.06
384	002027	分众传媒	11,000	66,660.00	0.06
385	002380	科远智慧	3,500	64,050.00	0.06
386	600026	中远海能	4,100	64,001.00	0.06
387	600489	中金黄金	4,300	63,640.00	0.06
388	300502	新易盛	600	63,330.00	0.06
389	603596	伯特利	1,620	63,018.00	0.06

390	600761	安徽合力	2,900	62,756.00	0.06
391	300394	天孚通信	700	61,894.00	0.06
392	603345	安井食品	800	59,448.00	0.06
393	688408	中信博	613	56,445.04	0.05
394	000999	华润三九	1,290	54,928.20	0.05
395	688766	普冉股份	467	45,378.39	0.04
396	603786	科博达	700	44,905.00	0.04
397	688256	寒武纪	216	42,912.72	0.04
398	600132	重庆啤酒	700	42,490.00	0.04
399	600436	片仔癀	200	41,434.00	0.04
400	600900	长江电力	1,400	40,488.00	0.04
401	688543	国科军工	892	36,634.44	0.03
402	002837	英维克	1,700	36,363.00	0.03
403	000598	兴蓉环境	4,700	35,344.00	0.03
404	300870	欧陆通	800	34,704.00	0.03
405	603871	嘉友国际	1,900	33,611.00	0.03
406	002155	湖南黄金	1,800	32,580.00	0.03
407	300724	捷佳伟创	600	32,406.00	0.03
408	688187	时代电气	610	30,121.80	0.03
409	301308	江波龙	300	28,422.00	0.03
410	002415	海康威视	900	27,819.00	0.03
411	001309	德明利	310	26,784.00	0.03
412	002906	华阳集团	1,000	26,760.00	0.03
413	002714	牧原股份	600	26,160.00	0.02
414	002594	比亚迪	100	25,025.00	0.02
415	600309	万华化学	300	24,258.00	0.02
416	688525	佰维存储	370	23,735.50	0.02
417	601919	中远海控	1,500	23,235.00	0.02
418	605305	中际联合	900	23,211.00	0.02
419	603658	安图生物	500	23,035.00	0.02
420	000550	江铃汽车	1,000	21,710.00	0.02
421	002128	电投能源	1,000	21,100.00	0.02
422	600036	招商银行	600	20,514.00	0.02
423	688300	联瑞新材	400	19,240.00	0.02
424	688289	圣湘生物	1,027	18,054.66	0.02
425	688336	三生国健	814	16,564.90	0.02
426	688016	心脉医疗	168	16,472.40	0.02
427	000625	长安汽车	1,200	16,116.00	0.02
428	601689	拓普集团	300	16,083.00	0.02
429	601985	中国核电	1,500	15,990.00	0.02
430	601088	中国神华	300	13,311.00	0.01
431	603568	伟明环保	600	12,348.00	0.01
432	688361	中科飞测	223	10,547.90	0.01
433	000830	鲁西化工	900	10,431.00	0.01

434	603259	药明康德	248	9,719.12	0.01
435	603986	兆易创新	100	9,562.00	0.01
436	002920	德赛西威	100	8,709.00	0.01
437	688065	凯赛生物	174	7,897.86	0.01
438	605117	德业股份	100	7,434.00	0.01
439	301012	扬电科技	300	7,428.00	0.01
440	688692	达梦数据	39	6,822.27	0.01
441	002028	思源电气	100	6,690.00	0.01
442	000878	云南铜业	500	6,230.00	0.01
443	600048	保利发展	700	6,132.00	0.01
444	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.01
445	688691	灿芯股份	129	5,483.79	0.01
446	300781	因赛集团	100	5,218.00	0.00
447	688548	广钢气体	536	4,893.68	0.00
448	301050	雷电微力	100	4,816.00	0.00
449	301099	雅创电子	100	4,465.00	0.00
450	001301	尚太科技	100	4,322.00	0.00
451	000883	湖北能源	700	4,207.00	0.00
452	002008	大族激光	200	4,160.00	0.00
453	688582	芯动联科	147	4,139.52	0.00
454	600760	中航沈飞	100	4,010.00	0.00
455	688709	成都华微	209	3,927.11	0.00
456	688648	中邮科技	179	3,909.36	0.00
457	301121	紫建电子	100	3,693.00	0.00
458	688695	中创股份	109	3,438.95	0.00
459	601229	上海银行	400	2,904.00	0.00
460	000063	中兴通讯	100	2,797.00	0.00
461	688584	上海合晶	166	2,637.74	0.00
462	601033	永兴股份	160	2,553.60	0.00
463	300444	双杰电气	400	2,540.00	0.00
464	002142	宁波银行	100	2,206.00	0.00
465	001234	泰慕士	100	1,699.00	0.00
466	603082	北自科技	52	1,533.48	0.00
467	603344	星德胜	67	1,518.22	0.00
468	603325	博隆技术	19	1,293.14	0.00
469	603375	盛景微	33	1,283.70	0.00
470	002009	天奇股份	100	1,134.00	0.00
471	002961	瑞达期货	100	1,095.00	0.00
472	603312	西典新能	43	1,090.48	0.00
473	000517	荣安地产	100	268.00	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	300308	中际旭创	3,232,379.98	2.84
2	002432	九安医疗	2,946,335.00	2.59
3	000568	泸州老窖	2,536,283.00	2.23
4	600938	中国海油	2,227,969.00	1.96
5	600519	贵州茅台	2,178,315.00	1.91
6	300529	健帆生物	1,840,736.00	1.62
7	300760	迈瑞医疗	1,800,928.00	1.58
8	600276	恒瑞医药	1,794,975.00	1.58
9	300979	华利集团	1,793,153.00	1.57
10	601138	工业富联	1,740,476.66	1.53
11	300502	新易盛	1,707,100.00	1.50
12	601666	平煤股份	1,706,517.00	1.50
13	300750	宁德时代	1,449,955.00	1.27
14	002966	苏州银行	1,418,146.00	1.24
15	300394	天孚通信	1,264,061.20	1.11
16	601857	中国石油	1,197,375.00	1.05
17	601225	陕西煤业	1,189,333.00	1.04
18	603707	健友股份	1,159,201.00	1.02
19	002422	科伦药业	1,153,996.00	1.01
20	601077	渝农商行	1,151,556.00	1.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	4,494,065.80	3.94
2	600519	贵州茅台	3,359,682.00	2.95
3	000568	泸州老窖	3,319,100.33	2.91
4	600276	恒瑞医药	2,238,987.00	1.97
5	601138	工业富联	2,194,083.21	1.93
6	300502	新易盛	2,138,637.00	1.88
7	300529	健帆生物	1,865,529.00	1.64
8	600938	中国海油	1,730,157.00	1.52
9	300394	天孚通信	1,662,639.60	1.46
10	002432	九安医疗	1,648,013.00	1.45

11	300760	迈瑞医疗	1,615,056.00	1.42
12	300750	宁德时代	1,596,014.00	1.40
13	688235	百济神州	1,481,454.67	1.30
14	688617	惠泰医疗	1,318,042.58	1.16
15	002966	苏州银行	1,285,957.00	1.13
16	601888	中国中免	1,239,822.60	1.09
17	603707	健友股份	1,187,372.00	1.04
18	601077	渝农商行	1,183,832.00	1.04
19	002371	北方华创	1,181,092.00	1.04
20	601225	陕西煤业	1,133,972.00	1.00

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	368,603,077.54
卖出股票收入（成交）总额	384,012,744.63

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，平顶山天安煤业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家矿山安全监察局河南局、河南省工业和信息化厅、平顶山市生态环境局、平顶山市应急管理局、许昌市应急管理局、宝丰县林业局、襄城县卫生健康委员会、平顶山市新华区市场监督管理局的处罚。天津九安医疗电子股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到天津市药品监督管理局的处罚。中国铝业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到娄烦县消防救援大队、娄烦县应急管理局、清镇市应急管理局、运城市应急管理局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	25,699.48
2	应收清算款	502,541.58
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,852.64

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	543,093.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达量化策略精选混合 A	1,231	53,278.43	49,999,000.00	76.23%	15,586,748.73	23.77%
易方达量化策略精选混合 C	981	22,665.04	50,041.70	0.23%	22,184,364.03	99.77%
合计	2,212	39,701.70	50,049,041.70	56.99%	37,771,112.76	43.01%

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	易方达量化策略精选混合 A	319,642.70	0.4874%
	易方达量化策略精选混合 C	19,987.87	0.0899%
	合计	339,630.57	0.3867%

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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达量化策略精选混合 A	0
	易方达量化策略精选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达量化策略精选混合 A	0
	易方达量化策略精选混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达量化策略精选混合 A	易方达量化策略精选混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 19 日）基金份额总额	193,032,569.46	229,017,061.52
本报告期期初基金份额总额	67,727,297.42	26,256,789.49
本报告期基金总申购份额	1,190,333.93	1,092,621.85
减：本报告期基金总赎回份额	3,331,882.62	5,115,005.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	65,585,748.73	22,234,405.73

§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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	454,700.80	0.06%	272.76	0.15%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	751,887,200.77	99.94%	177,273.98	99.85%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为东北证券股份有限公司、申港证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、汇丰前海证券有限责任公司、万联证券股份有限公司。

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。本报告期内基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务

和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	104,252.16	100.00%	196,100,000.00	100.00%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-13
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-01-19
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证券报	2024-03-29
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-04-20
5	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024 年 01 月 01 日~2024 年 06 月 30 日	49,999,000.00	0.00	0.00	49,999,000.00	56.93%
产品特有风险							

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

§ 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量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

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

二〇二四年八月三十日