

易方达易百智能量化策略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	12
§ 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	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48

7.12 投资组合报告附注.....	48
§ 8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§ 9 开放式基金份额变动.....	50
§ 10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
§ 12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达易百智能量化策略混合	
基金主代码	005437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 24 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	68,049,451.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
下属分级基金的交易代码	005437	005438
报告期末下属分级基金的份额总额	56,421,020.64 份	11,628,431.34 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要依托于百度提供的特色数据及其数据处理能力,通过大数据挖掘和分析技术,结合基金管理人自主研发的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	本基金主要借助百度在人工智能技术和算法方面的优势,同时结合其特有的互联网大数据,对证券市场相关数据进行深度分析,在海外成熟的多因子量化选股框架下扩充因子维度,对股票超额收益进行预测,并据此筛选具有投资价值的股票构建投资组合。同时,本基金也可应用定向增发套利与大宗交易套利等多种量化套利策略,根据各策略的预期收益、风险及其所使用的市场环境,发现和捕捉因市场波动及无效定价带来的价差机会,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。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×65%+中债新综合指数(财富)收益率×35%
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	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
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1 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	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		510620； 519031	100818
法定代表人		刘晓艳	葛海蛟

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）	
	易方达易百智能量化策 略混合 A	易方达易百智能量化策略 混合 C
本期已实现收益	-7,823,118.11	-1,571,557.92

本期利润	-7,036,109.30	-1,138,702.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1218	-0.0948
本期加权平均净值利润率	-14.44%	-11.43%
本期基金份额净值增长率	-12.22%	-12.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
期末可供分配利润	-10,099,424.68	-2,263,695.74
期末可供分配基金份额利润	-0.1790	-0.1947
期末基金资产净值	46,321,595.96	9,364,735.60
期末基金份额净值	0.8210	0.8053
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
基金份额累计净值增长率	-17.90%	-19.47%

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

易方达易百智能量化策略混合 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	-7.51%	1.79%	-1.86%	0.31%	-5.65%	1.48%
过去三个月	-6.39%	1.89%	-0.76%	0.48%	-5.63%	1.41%
过去六个月	-12.22%	2.29%	2.00%	0.58%	-14.22%	1.71%
过去一年	-27.21%	1.94%	-4.45%	0.56%	-22.76%	1.38%
过去三年	-41.46%	1.87%	-18.75%	0.68%	-22.71%	1.19%
自基金合同生效起至今	-17.90%	1.57%	-1.51%	0.79%	-16.39%	0.78%

易方达易百智能量化策略混合 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	-7.54%	1.79%	-1.86%	0.31%	-5.68%	1.48%
过去三个月	-6.46%	1.89%	-0.76%	0.48%	-5.70%	1.41%
过去六个月	-12.35%	2.29%	2.00%	0.58%	-14.35%	1.71%
过去一年	-27.43%	1.94%	-4.45%	0.56%	-22.98%	1.38%
过去三年	-41.99%	1.87%	-18.75%	0.68%	-23.24%	1.19%
自基金合同生效起至今	-19.47%	1.57%	-1.51%	0.79%	-17.96%	0.78%

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

易方达易百智能量化策略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

(2018 年 1 月 24 日至 2024 年 6 月 30 日)

易方达易百智能量化策略混合 A



易方达易百智能量化策略混合 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-17.90%，同期业绩比较基准收益率为-1.51%；C 类基金份额净值增长率为-19.47%，同期业绩比较基准收益率为-1.51%。

§ 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		
殷明	本基金的基金经理，易方达中证 1000 量化增强、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF 的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决	2021-03-20	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，国盛证券有限责任公司研究所金融工程分析师，易方达基金管

策委员会委员				理有限公司量化研究员。
--------	--	--	--	-------------

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 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

2024 年上半年，市场呈现了一定的波动。上半年，市场大小盘风格分化显著，代表大盘风格的沪深 300 指数上涨 0.89%，代表小盘风格的中证 1000 指数下跌 16.84%。行业层面，银行、煤炭、公用事业、家用电器、石油石化等行业表现较好，计算机、商贸零售、社会服务、传媒等行业表现较差，市场呈现出一定程度的红利风格。在传统量化因子层面，质量、估值类因子上半年表现较好。

上半年，在选股策略层面，我们进一步迭代了量化选股模型，使用机器学习方法进行模型的构建，使模型在历史上能够有更加稳健的表现，预期收益也得到了进一步提升。目前较多的行业和板块估值处于历史低位，市场整体向下的概率相对较小。接下来，我们会利用新的选股模型去跟踪市场的变化，进而获取相对稳定的超额收益。

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 0.8210 元，本报告期份额净值增长率为-12.22%，同期业绩比较基准收益率为 2.00%；C 类基金份额净值为 0.8053 元，本报告期份额净值增长率为-12.35%，同期业绩比较基准收益率为 2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从宏观和微观两个方面进行分析。宏观层面，预期国内经济将继续保持稳定增长的势头，宏观经济政策将持续发力，经济增速将保持在合理区间内。微观层面，我们需要关注制造业升级的趋势，随着人工智能、大数据等技术的不断发展，中国制造业可以实现更高水平的自动化和智能化水平。

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

易方达易百智能量化策略混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达易百智能量化策略混合 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达易百智能量化策略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	3,605,637.65	3,880,249.54
结算备付金		467,246.54	188,749.62
存出保证金		13,651.31	4,963.21
交易性金融资产	6.4.7.2	51,648,016.08	62,872,262.82
其中：股票投资		51,648,016.08	62,872,262.82
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		380,158.09	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,256.55	24,511.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		56,116,966.22	66,970,736.29
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		296,568.97	-
应付赎回款		11,115.67	143,048.03
应付管理人报酬		56,455.77	69,197.37
应付托管费		9,409.28	11,532.88
应付销售服务费		2,374.84	2,613.40
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	6.4.7.6	54,710.13	110,063.24
负债合计		430,634.66	336,454.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	68,049,451.98	71,441,740.99
未分配利润	6.4.7.8	-12,363,120.42	-4,807,459.62
净资产合计		55,686,331.56	66,634,281.37
负债和净资产总计		56,116,966.22	66,970,736.29

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.8210 元，C 类基金份额净值 0.8053 元；基金份额总额 68,049,451.98 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 56,421,020.64 份，C 类基金份额总额 11,628,431.34 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达易百智能量化策略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		-7,677,364.86	-5,564,223.63
1.利息收入		10,462.77	9,695.45
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,462.77	9,695.45
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,941,118.63	-8,962,241.58
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-9,484,897.39	-9,311,577.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	2,703.69
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	543,778.76	346,632.47
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	1,219,863.85	3,380,576.62

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	33,427.15	7,745.88
减：二、营业总支出		497,447.32	837,823.32
1. 管理人报酬		349,022.81	634,703.10
2. 托管费		58,170.40	105,783.86
3. 销售服务费		14,783.30	17,457.94
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		-	0.04
8. 其他费用	6.4.7.18	75,470.81	79,878.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,174,812.18	-6,402,046.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,174,812.18	-6,402,046.95
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,174,812.18	-6,402,046.95

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达易百智能量化策略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	71,441,740.99	-4,807,459.62	66,634,281.37
二、本期期初净资产	71,441,740.99	-4,807,459.62	66,634,281.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,392,289.01	-7,555,660.80	-10,947,949.81
（一）、综合收益总额	-	-8,174,812.18	-8,174,812.18
（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）	-3,392,289.01	619,151.38	-2,773,137.63

其中：1.基金申购款	9,985,102.38	-1,695,564.44	8,289,537.94
2.基金赎回款	-13,377,391.39	2,314,715.82	-11,062,675.57
（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	68,049,451.98	-12,363,120.42	55,686,331.56
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	74,542,847.61	15,995,432.57	90,538,280.18
二、本期期初净资产	74,542,847.61	15,995,432.57	90,538,280.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,560,575.33	-7,196,487.29	-11,757,062.62
（一）、综合收益总额	-	-6,402,046.95	-6,402,046.95
（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）	-4,560,575.33	-794,440.34	-5,355,015.67
其中：1.基金申购款	4,543,242.37	858,345.85	5,401,588.22
2.基金赎回款	-9,103,817.70	-1,652,786.19	-10,756,603.89
（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	69,982,272.28	8,798,945.28	78,781,217.56

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

易方达易百智能量化策略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[2017]2163号《关于准予易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达易百智能量化策略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,《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年1月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为794,754,696.47份基金份额,其中认购资金利息折合449,820.67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	3,605,637.65
等于：本金	3,605,296.34
加：应计利息	341.31
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	3,605,637.65

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	54,410,942.98	-	51,648,016.08	-2,762,926.90
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	54,410,942.98	-	51,648,016.08	-2,762,926.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	54,700.10
合计	54,710.13

6.4.7.7 实收基金

易方达易百智能量化策略混合 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	60,286,131.36	60,286,131.36
本期申购	2,651,500.82	2,651,500.82
本期赎回（以“-”号填列）	-6,516,611.54	-6,516,611.54
本期末	56,421,020.64	56,421,020.64

易方达易百智能量化策略混合 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	11,155,609.63	11,155,609.63
本期申购	7,333,601.56	7,333,601.56
本期赎回（以“-”号填列）	-6,860,779.85	-6,860,779.85
本期末	11,628,431.34	11,628,431.34

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

易方达易百智能量化策略混合 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	1,150,077.88	-5,051,631.68	-3,901,553.80
本期期初	1,150,077.88	-5,051,631.68	-3,901,553.80
本期利润	-7,823,118.11	787,008.81	-7,036,109.30
本期基金份额交易产生的变动数	158,067.64	680,170.78	838,238.42
其中：基金申购款	-293,584.63	-112,226.34	-405,810.97
基金赎回款	451,652.27	792,397.12	1,244,049.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,514,972.59	-3,584,452.09	-10,099,424.68

易方达易百智能量化策略混合 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	21,800.09	-927,705.91	-905,905.82
本期期初	21,800.09	-927,705.91	-905,905.82
本期利润	-1,571,557.92	432,855.04	-1,138,702.88
本期基金份额交易产生的变动数	21,977.64	-241,064.68	-219,087.04
其中：基金申购款	-739,446.63	-550,306.84	-1,289,753.47
基金赎回款	761,424.27	309,242.16	1,070,666.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,527,780.19	-735,915.55	-2,263,695.74

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	6,741.98

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	3,655.74
其他	65.05
合计	10,462.77

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	-9,484,897.39
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	-9,484,897.39

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	391,345,948.09
减：卖出股票成本总额	400,585,054.56
减：交易费用	245,790.92
买卖股票差价收入	-9,484,897.39

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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	543,778.76
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	543,778.76

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	1,219,863.85
——股票投资	1,219,863.85
——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	1,219,863.85

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	33,427.15
合计	33,427.15

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	14,918.54
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,170.71
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	75,470.81

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	349,022.81	634,703.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	81,272.17	145,366.14
应支付基金管理人的净管理费	267,750.64	489,336.96

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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	58,170.40	105,783.86

注：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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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		
	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	5,765.39	5,765.39
中国银行	-	1,233.35	1,233.35
广发证券	-	18.23	18.23
合计	-	7,016.97	7,016.97
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		
	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	7,846.25	7,846.25

中国银行	-	1,633.43	1,633.43
广发证券	-	68.95	68.95
合计	-	9,548.63	9,548.63

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 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付。

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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	
	易方达易百智能 化策略混合A	易方达易百智能 化策略混合C	易方达易百智能 化策略混合A	易方达易百智能 化策略混合C
报告期初持有的基金份额	23,782,305.37	-	23,782,305.37	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-

报告期末持有的基金份额	23,782,305.37	-	23,782,305.37	-
报告期末持有的基金份额占基金总额比例	42.1515%	-	38.6864%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

易方达易百智能量化策略混合 A

无。

易方达易百智能量化策略混合 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	3,605,637.65	6,741.98	3,979,521.27	8,195.88

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

易方达易百智能量化策略混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达易百智能量化策略混合 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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：0.00%)。

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	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	3,605,637.65	-	-	-	3,605,637.65
结算备付金	467,246.54	-	-	-	467,246.54
存出保证金	13,651.31	-	-	-	13,651.31
交易性金融资产	-	-	-	51,648,016.08	51,648,016.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	380,158.09	380,158.09
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,256.55	2,256.55
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,086,535.50	-	-	52,030,430.72	56,116,966.22

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	-	-	-	296,568.97	296,568.97
应付赎回款	-	-	-	11,115.67	11,115.67
应付管理人报酬	-	-	-	56,455.77	56,455.77
应付托管费	-	-	-	9,409.28	9,409.28
应付销售服务费	-	-	-	2,374.84	2,374.84
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	-	-	-	54,710.13	54,710.13
负债总计	-	-	-	430,634.66	430,634.66
利率敏感度缺口	4,086,535.50	-	-	51,599,796.06	55,686,331.56
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	3,880,249.54	-	-	-	3,880,249.54
结算备付金	188,749.62	-	-	-	188,749.62
存出保证金	4,963.21	-	-	-	4,963.21
交易性金融资产	-	-	-	62,872,262.82	62,872,262.82
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	24,511.10	24,511.10
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,073,962.37	-	-	62,896,773.92	66,970,736.29
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	-	-	143,048.03	143,048.03
应付管理人报酬	-	-	69,197.37	69,197.37
应付托管费	-	-	11,532.88	11,532.88
应付销售服务费	-	-	2,613.40	2,613.40
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	-	-	110,063.24	110,063.24
负债总计	-	-	336,454.92	336,454.92
利率敏感度缺口	4,073,962.37	-	62,560,319.00	66,634,281.37

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	51,648,016.08	92.75	62,872,262.82	94.35
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	51,648,016.08	92.75	62,872,262.82	94.35

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%	4,587,138.87	5,125,916.42
	2.业绩比较基准下降5%	-4,587,138.87	-5,125,916.42

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	51,648,016.08
第二层次	-
第三层次	-
合计	51,648,016.08

6.4.14.2.2 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。

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	51,648,016.08	92.04
	其中:股票	51,648,016.08	92.04
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	-	-
	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	4,072,884.19	7.26
8	其他各项资产	396,065.95	0.71
9	合计	56,116,966.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,266,181.00	2.27
C	制造业	36,883,822.51	66.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,672,731.00	3.00
E	建筑业	628,282.00	1.13
F	批发和零售业	1,754,021.00	3.15
G	交通运输、仓储和邮政业	1,131,723.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,459,899.27	8.01
J	金融业	749,383.00	1.35
K	房地产业	493,581.00	0.89
L	租赁和商务服务业	870,668.00	1.56
M	科学研究和技术服务业	498,758.30	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	246,750.00	0.44
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	865,586.00	1.55
S	综合	126,630.00	0.23
	合计	51,648,016.08	92.75

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	002451	摩恩电气	25,500	136,935.00	0.25
2	600601	方正科技	45,600	136,800.00	0.25
3	002296	辉煌科技	13,200	136,092.00	0.24
4	600765	中航重机	6,500	132,600.00	0.24

5	300968	格林精密	14,300	132,418.00	0.24
6	601989	中国重工	26,600	131,138.00	0.24
7	600114	东睦股份	9,100	130,949.00	0.24
8	600011	华能国际	13,600	130,832.00	0.23
9	002241	歌尔股份	6,700	130,717.00	0.23
10	600642	申能股份	14,800	130,684.00	0.23
11	600183	生益科技	6,200	130,572.00	0.23
11	600712	南宁百货	37,200	130,572.00	0.23
13	688155	先惠技术	3,302	130,561.08	0.23
14	600027	华电国际	18,800	130,472.00	0.23
15	301013	利和兴	12,200	130,296.00	0.23
16	300120	经纬辉开	25,100	130,269.00	0.23
17	002876	三利谱	5,400	130,248.00	0.23
18	000960	锡业股份	8,400	130,116.00	0.23
19	002583	海能达	31,900	129,833.00	0.23
20	002112	三变科技	14,600	129,648.00	0.23
21	003816	中国广核	28,000	129,640.00	0.23
22	601616	广电电气	44,500	129,495.00	0.23
23	688226	威腾电气	7,408	129,491.84	0.23
24	600023	浙能电力	18,200	129,402.00	0.23
25	300303	聚飞光电	26,600	129,276.00	0.23
26	000883	湖北能源	21,500	129,215.00	0.23
27	000027	深圳能源	17,700	129,210.00	0.23
28	603993	洛阳钼业	15,200	129,200.00	0.23
29	688260	昀冢科技	8,685	129,145.95	0.23
30	002273	水晶光电	7,600	129,048.00	0.23
31	002436	兴森科技	12,500	129,000.00	0.23
32	688373	盟科药业	29,646	128,960.10	0.23
33	601600	中国铝业	16,900	128,947.00	0.23
34	600237	铜峰电子	24,700	128,934.00	0.23
35	688159	有方科技	3,402	128,799.72	0.23
36	600795	国电电力	21,500	128,785.00	0.23
37	600489	中金黄金	8,700	128,760.00	0.23
38	000975	银泰黄金	7,900	128,691.00	0.23
39	300701	森霸传感	15,300	128,673.00	0.23
40	002608	江苏国信	16,600	128,650.00	0.23
41	002358	森源电气	37,600	128,592.00	0.23
42	300517	海波重科	15,000	128,550.00	0.23
43	300227	光韵达	23,500	128,545.00	0.23
44	601728	中国电信	20,900	128,535.00	0.23
45	601975	招商南油	35,800	128,522.00	0.23
46	000738	航发控制	6,400	128,448.00	0.23
47	601872	招商轮船	15,200	128,440.00	0.23
48	002297	博云新材	21,400	128,400.00	0.23

49	300088	长信科技	27,300	128,310.00	0.23
50	002845	同兴达	9,700	128,234.00	0.23
50	300065	海兰信	19,400	128,234.00	0.23
52	688307	中润光学	6,194	128,153.86	0.23
53	601985	中国核电	12,000	127,920.00	0.23
54	601700	风范股份	29,100	127,749.00	0.23
55	601117	中国化学	15,500	127,720.00	0.23
56	002446	盛路通信	22,600	127,690.00	0.23
57	300980	祥源新材	8,100	127,656.00	0.23
58	600219	南山铝业	33,500	127,635.00	0.23
59	300279	和晶科技	30,600	127,602.00	0.23
60	002036	联创电子	18,900	127,575.00	0.23
61	300222	科大智能	23,800	127,568.00	0.23
62	688678	福立旺	11,778	127,555.74	0.23
63	002106	莱宝高科	11,700	127,530.00	0.23
64	000045	深纺织 A	15,900	127,518.00	0.23
65	002139	拓邦股份	12,000	127,440.00	0.23
66	002866	传艺科技	9,900	127,413.00	0.23
67	601058	赛轮轮胎	9,100	127,400.00	0.23
68	002476	宝莫股份	34,700	127,349.00	0.23
69	300307	慈星股份	21,400	127,330.00	0.23
70	002532	天山铝业	15,700	127,327.00	0.23
71	002935	天奥电子	10,540	127,323.20	0.23
72	300566	激智科技	9,100	127,309.00	0.23
73	688055	龙腾光电	40,158	127,300.86	0.23
74	002286	保龄宝	23,100	127,281.00	0.23
75	300743	天地数码	9,400	127,276.00	0.23
76	603018	华设集团	14,000	127,260.00	0.23
77	002849	威星智能	11,400	127,224.00	0.23
78	002023	海特高新	13,900	127,185.00	0.23
79	002519	银河电子	25,900	127,169.00	0.23
80	603496	恒为科技	5,200	127,140.00	0.23
81	003015	日久光电	14,000	127,120.00	0.23
82	002245	蔚蓝锂芯	16,400	127,100.00	0.23
83	000598	兴蓉环境	16,900	127,088.00	0.23
84	600577	精达股份	32,000	127,040.00	0.23
85	603618	杭电股份	29,000	127,020.00	0.23
86	000100	TCL 科技	29,400	127,008.00	0.23
87	603577	汇金通	18,300	127,002.00	0.23
88	000758	中色股份	25,000	127,000.00	0.23
89	000533	顺钠股份	38,600	126,994.00	0.23
90	001268	联合精密	7,500	126,975.00	0.23
91	600130	波导股份	39,800	126,962.00	0.23
92	002148	北纬科技	27,300	126,945.00	0.23

93	300414	中光防雷	19,200	126,912.00	0.23
94	603606	东方电缆	2,600	126,906.00	0.23
95	300708	聚灿光电	14,100	126,900.00	0.23
96	688252	天德钰	8,725	126,774.25	0.23
97	600973	宝胜股份	35,100	126,711.00	0.23
98	002580	圣阳股份	20,600	126,690.00	0.23
99	603269	海鸥股份	12,900	126,678.00	0.23
100	002835	同为股份	7,500	126,675.00	0.23
101	300837	浙矿股份	6,100	126,636.00	0.23
102	000532	华金资本	10,500	126,630.00	0.23
103	002137	实益达	26,600	126,616.00	0.23
104	600398	海澜之家	13,700	126,588.00	0.23
105	300771	智莱科技	14,400	126,576.00	0.23
106	300473	德尔股份	9,300	126,573.00	0.23
107	301198	喜悦智行	15,800	126,558.00	0.23
108	600262	北方股份	7,700	126,511.00	0.23
109	000922	佳电股份	10,600	126,458.00	0.23
110	300886	华业香料	7,700	126,434.00	0.23
111	601128	常熟银行	16,700	126,419.00	0.23
112	300126	锐奇股份	27,900	126,387.00	0.23
113	000725	京东方 A	30,900	126,381.00	0.23
114	601668	中国建筑	23,800	126,378.00	0.23
115	002073	软控股份	17,100	126,369.00	0.23
116	002774	快意电梯	19,900	126,365.00	0.23
117	603321	梅轮电梯	18,500	126,355.00	0.23
118	000096	广聚能源	13,300	126,350.00	0.23
119	688662	富信科技	5,176	126,294.40	0.23
120	001206	依依股份	9,700	126,294.00	0.23
121	000593	德龙汇能	27,100	126,286.00	0.23
122	603516	淳中科技	4,000	126,280.00	0.23
123	601225	陕西煤业	4,900	126,273.00	0.23
124	603333	尚纬股份	40,600	126,266.00	0.23
125	300328	宜安科技	29,500	126,260.00	0.23
126	003036	泰坦股份	15,800	126,242.00	0.23
127	000548	湖南投资	31,400	126,228.00	0.23
128	300493	润欣科技	15,600	126,204.00	0.23
129	300657	弘信电子	8,400	126,168.00	0.23
130	002026	山东威达	15,200	126,160.00	0.23
131	301007	德迈仕	10,800	126,144.00	0.23
132	002534	西子洁能	12,600	126,126.00	0.23
132	002860	星帅尔	15,400	126,126.00	0.23
132	601801	皖新传媒	18,200	126,126.00	0.23
135	688659	元琛科技	21,019	126,114.00	0.23
136	600399	抚顺特钢	22,400	126,112.00	0.23

137	603045	福达合金	12,700	126,111.00	0.23
138	002826	易明医药	15,900	126,087.00	0.23
139	002531	天顺风能	14,100	126,054.00	0.23
140	002027	分众传媒	20,800	126,048.00	0.23
141	600235	民丰特纸	27,400	126,040.00	0.23
142	603186	华正新材	5,300	126,034.00	0.23
143	600420	国药现代	11,800	126,024.00	0.23
144	300490	华自科技	17,600	126,016.00	0.23
145	688203	海正生材	14,825	126,012.50	0.23
146	003023	彩虹集团	7,900	126,005.00	0.23
147	600707	彩虹股份	18,500	125,985.00	0.23
148	300213	佳讯飞鸿	22,100	125,970.00	0.23
149	002692	远程股份	37,600	125,960.00	0.23
150	600547	山东黄金	4,600	125,948.00	0.23
151	300797	钢研纳克	13,600	125,936.00	0.23
152	300805	电声股份	19,800	125,928.00	0.23
153	000034	神州数码	5,500	125,895.00	0.23
153	002209	达意隆	16,500	125,895.00	0.23
155	002282	博深股份	19,700	125,883.00	0.23
156	300872	天阳科技	9,500	125,875.00	0.23
157	000856	冀东装备	20,700	125,856.00	0.23
158	600468	百利电气	29,200	125,852.00	0.23
159	000425	徐工机械	17,600	125,840.00	0.23
160	300870	欧陆通	2,900	125,802.00	0.23
161	000983	山西焦煤	12,200	125,782.00	0.23
162	601918	新集能源	12,900	125,775.00	0.23
163	001202	炬申股份	11,100	125,763.00	0.23
164	300011	鼎汉技术	25,200	125,748.00	0.23
165	300499	高澜股份	11,600	125,744.00	0.23
166	300441	鲍斯股份	21,200	125,716.00	0.23
167	000551	创元科技	14,400	125,712.00	0.23
168	002686	亿利达	30,000	125,700.00	0.23
169	002054	德美化工	25,600	125,696.00	0.23
170	300403	汉字集团	18,400	125,672.00	0.23
171	603326	我乐家居	22,600	125,656.00	0.23
172	300571	平治信息	6,000	125,640.00	0.23
173	300174	元力股份	9,200	125,580.00	0.23
174	601001	晋控煤业	7,600	125,552.00	0.23
175	603629	利通电子	6,800	125,528.00	0.23
176	603015	弘讯科技	16,600	125,496.00	0.23
177	002765	蓝黛科技	26,700	125,490.00	0.23
177	002817	黄山胶囊	23,500	125,490.00	0.23
177	300131	英唐智控	28,200	125,490.00	0.23
180	301078	孩子王	24,800	125,488.00	0.23

181	301032	新柴股份	18,700	125,477.00	0.23
182	000852	石化机械	23,400	125,424.00	0.23
183	002469	三维化学	22,000	125,400.00	0.23
183	002723	小崧股份	20,000	125,400.00	0.23
183	300857	协创数据	2,200	125,400.00	0.23
186	002115	三维通信	25,800	125,388.00	0.23
186	002120	韵达股份	16,200	125,388.00	0.23
186	002919	名臣健康	10,800	125,388.00	0.23
189	601601	中国太保	4,500	125,370.00	0.23
190	002998	优彩资源	22,100	125,307.00	0.23
191	300195	长荣股份	29,900	125,281.00	0.22
192	300323	华灿光电	28,800	125,280.00	0.22
192	600926	杭州银行	9,600	125,280.00	0.22
194	688313	仕佳光子	13,157	125,254.64	0.22
195	000530	冰山冷热	34,600	125,252.00	0.22
196	301081	严牌股份	16,700	125,250.00	0.22
197	000828	东莞控股	13,900	125,239.00	0.22
198	300387	富邦股份	20,900	125,191.00	0.22
199	688565	力源科技	26,691	125,180.79	0.22
200	003003	天元股份	15,700	125,129.00	0.22
201	300203	聚光科技	12,400	125,116.00	0.22
202	300235	方直科技	15,600	125,112.00	0.22
203	002517	恺英网络	13,100	125,105.00	0.22
204	600829	人民同泰	22,300	125,103.00	0.22
205	600448	华纺股份	63,500	125,095.00	0.22
206	002165	红宝丽	37,900	125,070.00	0.22
207	002787	华源控股	18,500	125,060.00	0.22
208	300707	威唐工业	10,100	125,038.00	0.22
209	301056	森赫股份	16,300	125,021.00	0.22
210	600386	北巴传媒	44,800	124,992.00	0.22
211	600232	金鹰股份	29,000	124,990.00	0.22
212	300310	宜通世纪	33,500	124,955.00	0.22
213	603681	永冠新材	9,800	124,950.00	0.22
214	300931	通用电梯	22,800	124,944.00	0.22
215	600864	哈投股份	26,300	124,925.00	0.22
216	600609	金杯汽车	36,000	124,920.00	0.22
217	002753	永东股份	21,500	124,915.00	0.22
218	300658	延江股份	29,600	124,912.00	0.22
219	000926	福星股份	39,400	124,898.00	0.22
220	600513	联环药业	15,400	124,894.00	0.22
221	002566	益盛药业	20,400	124,848.00	0.22
222	600493	凤竹纺织	28,700	124,845.00	0.22
223	300211	亿通科技	23,600	124,844.00	0.22
224	600480	凌云股份	12,700	124,841.00	0.22

225	300753	爱朋医疗	11,400	124,830.00	0.22
226	300569	天能重工	30,000	124,800.00	0.22
227	000703	恒逸石化	17,600	124,784.00	0.22
228	000788	北大医药	25,000	124,750.00	0.22
229	601328	交通银行	16,700	124,749.00	0.22
230	000419	通程控股	30,500	124,745.00	0.22
231	000917	电广传媒	24,700	124,735.00	0.22
232	600272	开开实业	14,500	124,700.00	0.22
233	002357	富临运业	24,300	124,659.00	0.22
234	603683	晶华新材	15,700	124,658.00	0.22
235	000797	中国武夷	53,500	124,655.00	0.22
236	300388	节能国祯	22,500	124,650.00	0.22
237	603987	康德莱	20,400	124,644.00	0.22
238	300079	数码视讯	30,700	124,642.00	0.22
239	001367	海森药业	5,340	124,635.60	0.22
240	300275	梅安森	12,500	124,625.00	0.22
241	600664	哈药股份	47,200	124,608.00	0.22
242	002825	纳尔股份	20,000	124,600.00	0.22
242	603121	华培动力	17,500	124,600.00	0.22
244	002412	汉森制药	24,100	124,597.00	0.22
245	002613	北玻股份	35,800	124,584.00	0.22
246	600158	中体产业	16,200	124,578.00	0.22
247	002852	道道全	17,300	124,560.00	0.22
248	002707	众信旅游	21,700	124,558.00	0.22
249	603990	麦迪科技	14,300	124,553.00	0.22
250	000605	渤海股份	26,900	124,547.00	0.22
251	301028	东亚机械	14,200	124,534.00	0.22
252	300110	华仁药业	40,300	124,527.00	0.22
253	002688	金河生物	34,300	124,509.00	0.22
254	002788	鹭燕医药	15,800	124,504.00	0.22
255	000153	丰原药业	23,140	124,493.20	0.22
256	688150	莱特光电	6,417	124,489.80	0.22
257	300509	新美星	26,600	124,488.00	0.22
257	600603	广汇物流	24,700	124,488.00	0.22
259	600880	博瑞传播	33,100	124,456.00	0.22
260	002836	新宏泽	21,200	124,444.00	0.22
261	000949	新乡化纤	36,600	124,440.00	0.22
262	601218	吉鑫科技	44,600	124,434.00	0.22
263	002123	梦网科技	17,700	124,431.00	0.22
264	300440	运达科技	23,700	124,425.00	0.22
265	300249	依米康	19,200	124,416.00	0.22
266	603658	安图生物	2,700	124,389.00	0.22
267	002284	亚太股份	18,400	124,384.00	0.22
268	300883	龙利得	29,400	124,362.00	0.22

269	002303	美盈森	51,600	124,356.00	0.22
270	002422	科伦药业	4,100	124,353.00	0.22
270	002743	富煌钢构	33,700	124,353.00	0.22
272	002438	江苏神通	11,500	124,315.00	0.22
273	301010	晶雪节能	10,800	124,308.00	0.22
274	002437	誉衡药业	73,100	124,270.00	0.22
275	300047	天源迪科	19,000	124,260.00	0.22
276	300694	蠡湖股份	14,600	124,246.00	0.22
277	002691	冀凯股份	28,300	124,237.00	0.22
278	300002	神州泰岳	15,300	124,236.00	0.22
279	002132	恒星科技	58,600	124,232.00	0.22
280	605500	森林包装	20,200	124,230.00	0.22
281	002340	格林美	19,500	124,215.00	0.22
281	300231	银信科技	16,900	124,215.00	0.22
283	300611	美力科技	16,300	124,206.00	0.22
284	002584	西陇科学	22,100	124,202.00	0.22
285	300662	科锐国际	7,700	124,201.00	0.22
286	002702	海欣食品	34,500	124,200.00	0.22
286	603601	再升科技	45,000	124,200.00	0.22
288	002107	沃华医药	31,600	124,188.00	0.22
289	300194	福安药业	33,200	124,168.00	0.22
290	300532	今天国际	10,100	124,129.00	0.22
291	600336	澳柯玛	29,000	124,120.00	0.22
292	002463	沪电股份	3,400	124,100.00	0.22
293	688247	宣泰医药	15,094	124,072.68	0.22
294	002100	天康生物	17,900	124,047.00	0.22
295	300381	溢多利	20,200	124,028.00	0.22
296	001234	泰慕士	7,300	124,027.00	0.22
297	603112	华翔股份	11,800	124,018.00	0.22
297	603859	能科科技	5,900	124,018.00	0.22
299	600201	生物股份	17,200	124,012.00	0.22
300	002661	克明食品	16,600	124,002.00	0.22
301	603969	银龙股份	25,000	124,000.00	0.22
302	300181	佐力药业	8,200	123,984.00	0.22
303	300445	康斯特	7,700	123,970.00	0.22
304	688233	神工股份	6,433	123,963.91	0.22
305	688579	山大地纬	15,784	123,904.40	0.22
306	300535	达威股份	10,500	123,900.00	0.22
306	600986	浙文互联	29,500	123,900.00	0.22
306	603819	神力股份	11,800	123,900.00	0.22
309	000920	沃顿科技	16,900	123,877.00	0.22
310	000860	顺鑫农业	7,400	123,876.00	0.22
311	002494	华斯股份	39,700	123,864.00	0.22
312	688468	科美诊断	19,565	123,846.45	0.22

313	603399	吉翔股份	20,000	123,800.00	0.22
314	605166	聚合顺	11,800	123,782.00	0.22
315	688616	西力科技	10,915	123,776.10	0.22
316	002863	今飞凯达	30,400	123,728.00	0.22
317	688590	新致软件	9,589	123,698.10	0.22
318	002558	巨人网络	13,100	123,664.00	0.22
319	000632	三木集团	45,800	123,660.00	0.22
320	002075	沙钢股份	32,800	123,656.00	0.22
321	300378	鼎捷软件	7,600	123,652.00	0.22
322	688002	睿创微纳	4,420	123,627.40	0.22
323	000932	华菱钢铁	27,900	123,597.00	0.22
324	300626	华瑞股份	16,500	123,585.00	0.22
325	603330	天洋新材	25,800	123,582.00	0.22
326	300798	锦鸡股份	19,900	123,579.00	0.22
327	002277	友阿股份	57,200	123,552.00	0.22
328	000931	中关村	35,000	123,550.00	0.22
329	002020	京新药业	11,800	123,546.00	0.22
330	688038	中科通达	12,977	123,541.04	0.22
331	300082	奥克股份	29,000	123,540.00	0.22
331	603803	瑞斯康达	17,400	123,540.00	0.22
333	000639	西王食品	51,900	123,522.00	0.22
334	002225	濮耐股份	30,200	123,518.00	0.22
335	002637	赞宇科技	14,600	123,516.00	0.22
336	688026	洁特生物	12,396	123,464.16	0.22
337	300375	鹏翎股份	31,900	123,453.00	0.22
337	603999	读者传媒	26,100	123,453.00	0.22
339	300170	汉得信息	20,100	123,414.00	0.22
340	002820	桂发祥	16,700	123,413.00	0.22
341	603676	卫信康	15,400	123,354.00	0.22
341	605208	永茂泰	19,800	123,354.00	0.22
343	002082	万邦德	29,300	123,353.00	0.22
344	001330	博纳影业	22,800	123,348.00	0.22
345	688609	九联科技	13,983	123,330.06	0.22
346	300253	卫宁健康	20,900	123,310.00	0.22
347	002467	二六三	36,900	123,246.00	0.22
348	301065	本立科技	7,750	123,225.00	0.22
349	601666	平煤股份	11,000	123,200.00	0.22
350	000965	天保基建	47,000	123,140.00	0.22
351	300130	新国都	7,400	123,136.00	0.22
352	300055	万邦达	30,400	123,120.00	0.22
353	600222	太龙药业	29,300	123,060.00	0.22
354	002330	得利斯	33,700	123,005.00	0.22
355	300432	富临精工	19,100	123,004.00	0.22
356	002830	名雕股份	12,500	123,000.00	0.22

357	002928	华夏航空	19,400	122,996.00	0.22
358	002084	海鸥住工	50,200	122,990.00	0.22
359	688369	致远互联	7,818	122,977.14	0.22
360	688550	瑞联新材	5,299	122,883.81	0.22
361	002984	森麒麟	5,100	122,859.00	0.22
362	600189	泉阳泉	18,500	122,840.00	0.22
363	300289	利德曼	31,900	122,815.00	0.22
364	688401	路维光电	4,687	122,799.40	0.22
365	688222	成都先导	10,818	122,784.30	0.22
366	000710	贝瑞基因	17,100	122,778.00	0.22
367	600828	茂业商业	51,800	122,766.00	0.22
368	601615	明阳智能	13,000	122,720.00	0.22
369	002961	瑞达期货	11,200	122,640.00	0.22
370	301098	金埔园林	16,200	122,634.00	0.22
371	002942	新农股份	10,400	122,616.00	0.22
371	301102	兆讯传媒	10,400	122,616.00	0.22
373	001260	坤泰股份	8,800	122,584.00	0.22
374	301260	格力博	9,000	122,580.00	0.22
375	600872	中炬高新	5,400	122,526.00	0.22
376	300559	佳发教育	12,800	122,496.00	0.22
377	002329	皇氏集团	45,200	122,492.00	0.22
378	300451	创业慧康	35,400	122,484.00	0.22
379	688533	上声电子	4,733	122,442.71	0.22
380	688779	长远锂科	26,440	122,417.20	0.22
381	688246	嘉和美康	6,008	122,322.88	0.22
382	301066	万事利	15,100	122,310.00	0.22
383	603906	龙蟠科技	15,700	122,303.00	0.22
384	300188	国投智能	11,000	122,210.00	0.22
385	688148	芳源股份	29,023	122,186.83	0.22
386	300021	大禹节水	37,000	122,100.00	0.22
386	300840	酷特智能	13,200	122,100.00	0.22
388	688176	亚虹医药	23,888	122,067.68	0.22
389	600690	海尔智家	4,300	122,034.00	0.22
390	688292	浩瀚深度	7,890	121,979.40	0.22
391	601279	英利汽车	32,700	121,971.00	0.22
392	300251	光线传媒	14,500	121,945.00	0.22
393	002878	元隆雅图	9,700	121,929.00	0.22
394	300920	润阳科技	8,100	121,824.00	0.22
395	688310	迈得医疗	9,271	121,820.94	0.22
396	003000	劲仔食品	10,100	121,705.00	0.22
397	002858	力盛体育	11,700	121,680.00	0.22
398	000786	北新建材	4,100	121,606.00	0.22
399	300380	安硕信息	7,900	121,344.00	0.22
400	002557	洽洽食品	4,300	121,217.00	0.22

401	688520	神州细胞	3,074	120,961.90	0.22
402	002946	新乳业	13,800	120,888.00	0.22
402	600048	保利发展	13,800	120,888.00	0.22
404	300049	福瑞股份	2,400	120,816.00	0.22
405	300973	立高食品	4,300	120,787.00	0.22
406	601865	福莱特	6,000	120,600.00	0.22
407	300369	绿盟科技	23,600	120,596.00	0.22
408	002028	思源电气	1,800	120,420.00	0.22
409	688365	光云科技	19,903	119,816.06	0.22
410	000633	合金投资	30,300	119,382.00	0.21
411	603501	韦尔股份	1,200	119,244.00	0.21
412	002823	凯中精密	9,500	115,900.00	0.21

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	300213	佳讯飞鸿	822,838.00	1.23
2	601058	赛轮轮胎	811,897.00	1.22
3	000708	中信特钢	788,956.00	1.18
4	300099	尤洛卡	777,101.00	1.17
5	300797	钢研纳克	775,323.00	1.16
6	000725	京东方 A	761,017.00	1.14
7	688373	盟科药业	744,012.47	1.12
8	601666	平煤股份	735,521.00	1.10
9	600219	南山铝业	728,145.00	1.09
10	300066	三川智慧	727,073.00	1.09
11	601717	郑煤机	726,098.77	1.09
12	300194	福安药业	699,647.00	1.05
13	688620	安凯微	694,640.00	1.04
14	300448	浩云科技	691,009.37	1.04
15	003816	中国广核	675,993.93	1.01
16	000738	航发控制	674,857.00	1.01
17	600795	国电电力	665,523.00	1.00
18	301359	东南电子	660,396.00	0.99
19	300767	震安科技	657,014.00	0.99
20	002284	亚太股份	654,838.00	0.98

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	300099	尤洛卡	812,416.00	1.22
2	000708	中信特钢	786,893.00	1.18
3	300115	长盈精密	774,958.00	1.16
4	300002	神州泰岳	765,163.00	1.15
5	300066	三川智慧	744,272.00	1.12
6	601717	郑煤机	731,935.38	1.10
7	300448	浩云科技	702,023.00	1.05
8	300308	中际旭创	686,787.43	1.03
9	300213	佳讯飞鸿	686,283.00	1.03
10	688620	安凯微	682,950.76	1.02
11	601058	赛轮轮胎	680,881.00	1.02
12	300787	海能实业	661,941.40	0.99
13	300502	新易盛	657,011.00	0.99
14	301359	东南电子	656,913.00	0.99
15	300797	钢研纳克	654,723.00	0.98
16	300394	天孚通信	650,253.00	0.98
17	002016	世荣兆业	650,018.00	0.98
18	002483	润邦股份	644,818.00	0.97
19	300767	震安科技	644,513.00	0.97
20	000030	富奥股份	641,320.00	0.96

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	388,140,943.97
卖出股票收入（成交）总额	391,345,948.09

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,华能国际电力股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到济宁市市场监管局、山东省市场监督管理局、上海市宝山区生态环境局的处罚。中国船舶重工股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会北京证监局的处罚。

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	13,651.31
2	应收清算款	380,158.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,256.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	396,065.95

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
易方达易百智能量化策略混合 A	974	57,927.13	23,782,305.37	42.15%	32,638,715.27	57.85%
易方达易百智能量化策略混合 C	615	18,908.02	0.00	0.00%	11,628,431.34	100.00%
合计	1,589	42,825.33	23,782,305.37	34.95%	44,267,146.61	65.05%

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	易方达易百智能量化策略混合 A	717,429.35	1.2716%
	易方达易百智能量化策略混合 C	24,096.67	0.2072%
	合计	741,526.02	1.0897%

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	易方达易百智能量化策略混合 A	0
	易方达易百智能量化策略混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达易百智能量化策略混合 A	50~100
	易方达易百智能量化策略混合 C	0
	合计	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
基金合同生效日（2018 年 1 月 24 日）基金份额总额	785,605,733.86	9,148,962.61
本报告期期初基金份额总额	60,286,131.36	11,155,609.63
本报告期基金总申购份额	2,651,500.82	7,333,601.56
减：本报告期基金总赎回份额	6,516,611.54	6,860,779.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	56,421,020.64	11,628,431.34

§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，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	779,486,892.06	100.00%	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为中信建投证券股份有限公司，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。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

的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-01-19
2	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
3	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
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	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	23,782,305.37	0.00	0.00	23,782,305.37	34.95%
产品特有风险							
<p>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</p>							

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易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达易百智能量化策略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