

# 易方达亚洲精选股票型证券投资基金

## 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	39
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	41

7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	41
7.11	投资组合报告附注 .....	41
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>42</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	42
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>43</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>43</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4	基金投资策略的改变 .....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8	其他重大事件 .....	51
<b>§ 11</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>52</b>
11.1	备查文件目录 .....	52
11.2	存放地点 .....	53
11.3	查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达亚洲精选股票型证券投资基金
基金简称	易方达亚洲精选股票（QDII）
基金主代码	118001
交易代码	118001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年1月21日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,314,490,786.95 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于亚洲企业，追求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	资产配置方面，本基金将基于对宏观经济因素、各类资产的风险与收益水平的综合分析，进行权益类资产、固定收益类资产和货币市场工具的配置。股票投资方面，本基金主要投资于亚洲企业；本基金坚持价值投资的理念，以自下而上的基本面分析、深入的公司研究、对股票价值的评估作为股票投资的根本依据，辅以自上而下的宏观经济分析、国别/地区因素分析、行业分析。固定收益品种和货币市场工具方面，本基金主要用于回避投资风险、取得稳定回报，同时保持必要的灵活性，及时把握重大的投资机会。
业绩比较基准	MSCI AC 亚洲除日本指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家/地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家/地区投资的风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	王玉	郭明

负责人	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街 55号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼； 广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码		510620； 519031	100140
法定代表人		刘晓艳	廖林

#### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	无	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		无	香港中环德辅道中四至四 A 渣打银行大厦三十二楼
办公地址		无	香港九龙官塘道 388 号渣打中心十八楼
邮政编码		无	无

#### 2.5 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

#### 2.6 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）
本期已实现收益	-687,945,007.67
本期利润	714,170,627.88
加权平均基金份额本期利润	0.1583
本期加权平均净值利润率	16.11%
本期基金份额净值增长率	17.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	-3,493,183,981.18
期末可供分配基金份额利润	-0.8096
期末基金资产净值	4,566,492,968.78
期末基金份额净值	1.058
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.80%

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

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	1.83%	0.79%	4.24%	0.90%	-2.41%	-0.11%
过去三个月	7.19%	1.08%	7.07%	0.95%	0.12%	0.13%
过去六个月	17.56%	1.22%	11.14%	0.90%	6.42%	0.32%
过去一年	5.27%	1.24%	10.67%	0.88%	-5.40%	0.36%
过去三年	-21.34%	1.76%	-11.88%	1.03%	-9.46%	0.73%
自基金合同生效起至今	5.80%	1.58%	51.78%	1.05%	-45.98%	0.53%

## 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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金  
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  
(2010 年 1 月 21 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 5.80%，同期业绩比较基准收益率为 51.78%。

## § 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		



张坤	本基金的基金经理，易方达蓝筹精选混合、易方达优质企业三年持有混合、易方达优质精选混合（QDII）的基金经理，副总经理级高级管理人员、权益投资决策委员会委员	2014-04-08	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、研究部总经理助理，易方达中小盘混合、易方达新丝路混合的基金经理。
----	---	------------	---	------	---

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，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相应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，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

#### 4.4.2 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，香港市场震荡上涨，恒生指数上涨 3.94%，恒生中国企业指数上涨 9.77%。美国市场震荡上涨，标普 500 指数上涨 14.48%，纳斯达克指数上涨 18.13%。

地产方面，1-6 月份，新建商品房销售面积同比下降 19.0%，新建商品房销售额同比下降 25.0%，全国房地产开发投资同比下降 10.1%。在两会的政府工作报告中，提出“优化房地产政策，对不同所有制房地产企业合理融资需求要一视同仁给予支持，促进房地产市场平稳健康发展”。经济方面，政府工作报告指出，2024 年经济增长预期目标为 5% 左右，三中全会也强调坚定不移实现全年经济社会发展目标。5 月份，多个部门推出一系列稳定房地产市场的政策，包括降低全国层面个人住房贷款最低首付比例、取消全国层面个人住房贷款利率下限、下调个人住房公积金贷款利率和设立 3000 亿元保障性住房再贷款等。债券市场方面，国债收益率特别是长期国债收益率继续下行，30 年国债收益率下行至低于 2.5%。股票市场方面，上半年分化明显，能源、原材料等行业表现较好，而医疗保健、必需消费等行业表现相对落后。

本基金在上半年股票仓位基本稳定，并调整了科技和消费等行业的结构。个股方面，我们仍然持有商业模式出色、行业格局清晰、竞争力强的优质公司。

##### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.058 元，本报告期份额净值增长率为 17.56%，同期业绩比较基准收益率为 11.14%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在需求不足的情况下，越来越多的行业出现了竞争加剧和整体盈利能力下降的情况。一些企业面临的困境，正如想要观看一场盛大的沿街演出，就不得不踮起脚尖，而很快，其他人也都逐渐踮

起了脚尖，尽管累得几乎抽筋，却还是很难看到想看的演出。

人们往往倾向于崇尚复杂的东西，不屑于显而易见的东西，认为它们太过简单。事实上，投资与奥运跳水比赛的计分方式并不相同，难度系数并不重要。能正确投资一家有着单一成功要素、简单易懂并且可持久保持下去的公司，与投资一家有着多项竞争变量且复杂难懂的公司相比，即使后者已经经历缜密而深入的分析，两者的回报难言孰优孰劣。

回顾历史上自己所做过的判断，在试图跨“七尺高栏”时比试图跨“一尺高栏”时容易犯错。正如做预测时，始终都不应该忘记“基础比率”是非常强大的预测工具。其实质是，我们自己并不比其他入强多少。如果这件事本身很难，别人做这件事的失败概率很大，那么自己做这件事最有可能出现的结果也是失败。正如芒格所说，钓鱼的两条原则是：第一，在有鱼的地方钓鱼；第二，记住第一条。

在梳理投资逻辑时，如果对一些重要的问题产生迟疑，反复思考仍然难以得出答案时，对自己诚实是十分重要的。正如费曼说的，第一原则是不要骗自己，因为你自己是最容易被骗的人。就投资而言，人们应该注意的不是自己到底知道多少，而是能够清晰地界定出哪些是自己不知道的。作为投资人，只有认识自己、了解自己，才能像旁观者一样冷静地看待自己的一言一行。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	242,838,187.83	230,635,939.58
结算备付金		3,949.11	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,307,571,473.95	3,967,573,476.48
其中：股票投资		4,307,571,473.95	3,967,573,476.48
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		2,445,372.99	-
应收股利		30,889,895.69	13,178,971.86
应收申购款		5,786,810.55	5,687,214.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,589,535,690.12	4,217,075,602.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		173.81	157.27
应付赎回款		15,615,471.10	12,781,225.71
应付管理人报酬		5,693,470.83	5,225,772.35
应付托管费		1,328,476.56	1,219,346.90
应付销售服务费		-	-
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	405,129.04	267,157.65
负债合计		23,042,721.34	19,493,659.88
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.7	4,314,490,786.95	4,661,696,347.07
未分配利润	6.4.7.8	252,002,181.83	-464,114,404.80
净资产合计		4,566,492,968.78	4,197,581,942.27
负债和净资产总计		4,589,535,690.12	4,217,075,602.15

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.058 元，基金份额总额 4,314,490,786.95 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		755,473,921.86	137,828,458.02
1.利息收入		223,151.44	327,402.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	223,151.44	327,402.77
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）		-652,817,883.84	-18,002,582.59
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-698,956,551.24	-51,328,684.56
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	46,138,667.40	33,326,101.97
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,402,115,635.55	151,169,288.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		5,545,314.39	3,416,029.21
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	407,704.32	918,320.09
<b>减：二、营业总支出</b>		41,303,293.98	47,732,024.41
1. 管理人报酬		33,027,041.86	38,564,918.98
2. 托管费		7,706,309.79	8,998,481.01
3. 销售服务费		-	-
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	569,942.33	168,624.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>714,170,627.88</b>	<b>90,096,433.61</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>714,170,627.88</b>	<b>90,096,433.61</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>714,170,627.88</b>	<b>90,096,433.61</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：易方达亚洲精选股票型证券投资基金

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	4,661,696,347.07	-464,114,404.80	4,197,581,942.27
二、本期期初净资产	4,661,696,347.07	-464,114,404.80	4,197,581,942.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-347,205,560.12	716,116,586.63	368,911,026.51
（一）、综合收益总额	-	714,170,627.88	714,170,627.88
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-347,205,560.12	1,945,958.75	-345,259,601.37
其中：1.基金申购款	342,813,426.50	-2,779,062.23	340,034,364.27
2.基金赎回款	-690,018,986.62	4,725,020.98	-685,293,965.64
（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	4,314,490,786.95	252,002,181.83	4,566,492,968.78
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	5,130,201,515.40	-49,652,366.43	5,080,549,148.97
二、本期期初净资产	5,130,201,515.40	-49,652,366.43	5,080,549,148.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-251,946,816.93	76,405,038.28	-175,541,778.65
（一）、综合收益总额	-	90,096,433.61	90,096,433.61
（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）	-251,946,816.93	-13,691,395.33	-265,638,212.26
其中：1.基金申购款	624,262,247.44	26,837,553.57	651,099,801.01
2.基金赎回款	-876,209,064.37	-40,528,948.90	-916,738,013.27
（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	4,878,254,698.47	26,752,671.85	4,905,007,370.32

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

易方达亚洲精选股票型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1064 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的批复》和证监许可[2009]367 号《关于核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的批复》核准，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《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2010 年 1 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 592,067,217.31 份基金份额，其中认购资金利息折合 107,302.70 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为渣打银行（香港）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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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

关境内外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)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4)基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 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	242,838,187.83
等于：本金	242,553,266.44
加：应计利息	284,921.39
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	242,838,187.83

#### 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	3,738,257,753.57	-	4,307,571,473.95	569,313,720.38
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	3,738,257,753.57	-	4,307,571,473.95	569,313,720.38

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

#### 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	24,431.31
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	261,950.01
其中：交易所市场	261,950.01
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	118,747.72
合计	405,129.04

#### 6.4.7.7 实收基金

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	4,661,696,347.07	4,661,696,347.07
本期申购	342,813,426.50	342,813,426.50
本期赎回（以“-”号填列）	-690,018,986.62	-690,018,986.62
本期末	4,314,490,786.95	4,314,490,786.95

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

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	-3,072,851,418.51	2,608,737,013.71	-464,114,404.80
本期期初	-3,072,851,418.51	2,608,737,013.71	-464,114,404.80
本期利润	-687,945,007.67	1,402,115,635.55	714,170,627.88
本期基金份额交易产生的变动数	267,612,445.00	-265,666,486.25	1,945,958.75
其中：基金申购款	-267,217,415.94	264,438,353.71	-2,779,062.23
基金赎回款	534,829,860.94	-530,104,839.96	4,725,020.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,493,183,981.18	3,745,186,163.01	252,002,181.83

**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	174,809.85
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	43,242.72
其他	5,098.87
合计	223,151.44

**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	-698,956,551.24
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	-698,956,551.24

**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	2,420,673,049.92
减：卖出股票成本总额	3,115,207,857.98
减：交易费用	4,421,743.18
买卖股票差价收入	-698,956,551.24

**6.4.7.11 基金投资收益**

本基金本报告期无基金投资收益。

**6.4.7.12 债券投资收益**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13 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。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 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	46,138,667.40
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	46,138,667.40

**6.4.7.16 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	1,402,115,635.55
——股票投资	1,402,115,635.55
——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	1,402,115,635.55

**6.4.7.17 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	407,704.32
合计	407,704.32

**6.4.7.18 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.19 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	59,075.38
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
港股通证券组合费	34,138.28
银行汇划费	8,719.79

其他	408,336.54
合计	569,942.33

注：“其他”主要包含支付给交易所的结算服务费用和存托凭证托管机构的存托服务费用。

#### 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
渣打银行（香港）有限公司	境外托管人

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	33,027,041.86	38,564,918.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,925,543.86	11,830,788.51
应支付基金管理人的净管理费	23,101,498.00	26,734,130.47

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2 基金托管费

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托管费	7,706,309.79	8,998,481.01

注：本基金的托管费（如基金托管人委托境外托管人，包括境外托管费）按前一日基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 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	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
报告期初持有的基金份额	129,415,913.34	129,415,913.34
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	129,415,913.34	129,415,913.34
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.9996%	2.6529%

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

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	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
渣打银行-活期存款	97,186,875.23	63,029.54	145,566,197.31	26,957.26
中国工商银行-活期存款	145,651,312.60	111,780.31	105,627,691.71	284,647.93

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司和渣打银行(香港)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

本基金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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
940 HK	China Animal Healthcare Ltd	2015-03-30	重大事项停牌	0.00	-	-	850,000	3,230,137.15	0.00	-
967 HK	Sound Global Ltd	2016-04-13	重大事项停牌	0.00	-	-	300,000	1,741,184.48	0.00	-

注：1.根据香港联合交易所有限公司于 2020 年 1 月 24 日发布的《关于中国动物保健品有限公司取消上市地位》的通告，由 2020 年 1 月 30 日上午 9 时起，中国动物保健品有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

2.根据香港联合交易所有限公司于 2022 年 9 月 7 日发布的《关于桑德国际有限公司取消上市地位》的通告，由 2022 年 9 月 13 日上午 9 时起，桑德国际有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

##### 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。

本基金为股票型基金，理论上其风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。一方面，本基金投资于境外市场，承担了汇率风险、国家风险、新兴市场风险等境外投资面临的特殊风险；另一方面，本基金对亚洲主要国家/地区进行分散投资，基金整体风险低于对单一国家/地区投资的风险。

### 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。本基金在境内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；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。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。本基金可投资境外市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

#### 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	242,838,187.83	-	-	-	242,838,187.83
结算备付金	3,949.11	-	-	-	3,949.11
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	4,307,571,473.95	4,307,571,473.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,445,372.99	2,445,372.99
应收股利	-	-	-	30,889,895.69	30,889,895.69
应收申购款	-	-	-	5,786,810.55	5,786,810.55
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	242,842,136.94	-	-	4,346,693,553.18	4,589,535,690.12
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	-	-	-	173.81	173.81
应付赎回款	-	-	-	15,615,471.10	15,615,471.10
应付管理人报酬	-	-	-	5,693,470.83	5,693,470.83
应付托管费	-	-	-	1,328,476.56	1,328,476.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	405,129.04	405,129.04
负债总计	-	-	-	23,042,721.34	23,042,721.34
利率敏感度缺口	242,842,136.94	-	-	4,323,650,831.84	4,566,492,968.78
<b>上年度末</b> <b>2023 年 12 月 31</b> <b>日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	230,635,939.58	-	-	-	230,635,939.58
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	3,967,573,476.48	3,967,573,476.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	13,178,971.86	13,178,971.86
应收申购款	-	-	-	5,687,214.23	5,687,214.23
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	230,635,939.58	-	-	3,986,439,662.57	4,217,075,602.15
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	-	-	-	157.27	157.27
应付赎回款	-	-	-	12,781,225.71	12,781,225.71
应付管理人报酬	-	-	-	5,225,772.35	5,225,772.35
应付托管费	-	-	-	1,219,346.90	1,219,346.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	267,157.65	267,157.65
负债总计	-	-	-	19,493,659.88	19,493,659.88
利率敏感度缺口	230,635,939.58	-	-	-3,966,946,002.69	4,197,581,942.27

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

本基金投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	51,938,920.24	45,248,065.01	43.51	97,187,028.76
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,744,626,671.47	2,246,789,807.46	316,154,995.02	4,307,571,473.95
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	2,445,372.99	-	2,445,372.99
应收股利	1,210,456.26	19,865,149.06	-	21,075,605.32



应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>1,797,776,047.97</b>	<b>2,314,348,394.52</b>	<b>316,155,038.53</b>	<b>4,428,279,481.02</b>
<b>以外币计价的负债</b>				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>1,797,776,047.97</b>	<b>2,314,348,394.52</b>	<b>316,155,038.53</b>	<b>4,428,279,481.02</b>
项目	上年度末			
	2023年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
<b>以外币计价的资产</b>				
货币资金	183,490,449.12	798,738.33	46.13	184,289,233.58
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,406,954,982.09	2,560,618,494.39	-	3,967,573,476.48
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	1,518,596.82	11,660,375.04	-	13,178,971.86
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	<b>1,591,964,028.03</b>	<b>2,573,077,607.76</b>	<b>46.13</b>	<b>4,165,041,681.92</b>
<b>以外币计价的负债</b>				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	<b>1,591,964,028.03</b>	<b>2,573,077,607.76</b>	<b>46.13</b>	<b>4,165,041,681.92</b>

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变	
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
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-221,413,974.05	-208,252,084.10
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	221,413,974.05	208,252,084.10

#### 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	4,307,571,473.95	94.33	3,967,573,476.48	94.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	4,307,571,473.95	94.33	3,967,573,476.48	94.52

#### 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	上年度末

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	215,378,573.47	198,378,673.57
	2.业绩比较基准下降 5%	-215,378,573.47	-198,378,673.57

#### 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	4,307,571,473.95
第二层次	-
第三层次	-
合计	4,307,571,473.95

###### 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	4,307,571,473.95	93.86
	其中：普通股	3,161,550,747.30	68.89
	存托凭证	1,146,020,726.65	24.97
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	242,842,136.94	5.29
8	其他各项资产	39,122,079.23	0.85
9	合计	4,589,535,690.12	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 769,023,255.32 元，占净值比例 16.84%。

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	2,246,789,807.46	49.20

美国	1,744,626,671.47	38.20
韩国	316,154,995.02	6.92
合计	4,307,571,473.95	94.33

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	451,813,107.20	9.89
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	1,203,268,915.34	26.35
必需消费品	146,462,323.00	3.21
保健	0.00	0.00
金融	224,425,782.72	4.91
信息技术	1,755,934,506.92	38.45
电信服务	525,666,838.77	11.51
公用事业	0.00	0.00
房地产	-	-
合计	4,307,571,473.95	94.33

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	Taiwan Semicond uctor Manufact uring Co Ltd	台湾积体 电路制造 股份有限 公司	TSM US	纽约证 券交易 所	美国	368,000	455,844,951.74	9.98
2	CNOOC Limited	中国海洋 石油有限 公司	883 HK	香港证 券交易 所	中国香港	22,100,000	451,813,107.20	9.89
3	Tencent	腾讯控股	700 HK	香港证	中国香港	1,310,000	445,245,461.92	9.75

	Holdings Ltd	有限公司		券交易所				
4	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴集团控股有限公司	9988 HK	香港证券交易所	中国香港	6,700,000	431,104,398.00	9.44
5	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML US	纳斯达克证券交易所	美国	35,000	255,107,725.74	5.59
6	PRADA S.p.A.	普拉达	1913 HK	香港证券交易所	中国香港	4,530,000	241,451,319.36	5.29
7	Samsonite International S.A.	新秀丽国际有限公司	1910 HK	香港证券交易所	中国香港	10,860,000	230,942,721.84	5.06
8	H World Group Limited	华住集团有限公司	1179 HK	香港证券交易所	中国香港	9,700,000	230,177,896.00	5.04
9	Futu Holdings Limited	富途控股有限公司	FUTU US	纳斯达克证券交易所	美国	480,000	224,425,782.72	4.91
10	Samsung Electronics Co Ltd	三星电子有限公司	005930 KS	韩国证券交易所	韩国	520,000	219,421,564.26	4.81
11	KLA Corp	-	KLAC US	纳斯达克证券交易所	美国	35,000	205,664,125.38	4.50
12	Applied Materials Inc	应用材料	AMAT US	纳斯达克证券交易所	美国	120,000	201,822,423.84	4.42
13	Microsoft Corp	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	60,000	191,119,395.60	4.19
14	Giant Biogene Holding Co., Ltd	巨子生物控股有限公司	2367 HK	香港证券交易所	中国香港	3,500,000	146,462,323.00	3.21
15	ASE Technology Holding Co Ltd	日月光投资控股股份有限公司	ASX US	纽约证券交易所	美国	1,600,000	130,220,889.60	2.85
16	SK Hynix Inc	-	000660 KS	韩国证券交易所	韩国	79,000	96,733,430.76	2.12

17	Sea Ltd	-	SE US	纽约证 券交易 所	美国	158,000	80,421,376.85	1.76
18	Trip.com Group Limited	携程集团 有限公司	9961 HK	香港证 券交易 所	中国香港	130,000	44,445,690.64	0.97
19	Meituan	美团	3690 HK	香港证 券交易 所	中国香港	248,000	25,146,889.50	0.55
20	China Animal Healthcar e Ltd.	中国动物 保健品有 限公司	940 HK	香港证 券交易 所	中国香港	850,000	0.00	0.00
21	Sound Global Ltd.	桑德国际 有限公司	967 HK	香港证 券交易 所	中国香港	300,000	0.00	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	Samsonite International S.A.	1910 HK	288,484,918.66	6.87
2	Futu Holdings Limited	FUTU US	246,115,494.38	5.86
3	Samsung Electronics Co Ltd	005930 KS	213,844,979.57	5.09
4	ASE Technology Holding Co Ltd	ASX US	213,390,123.98	5.08
5	Applied Materials Inc	AMAT US	194,286,515.95	4.63
6	Trip.com Group Limited	9961 HK	166,385,804.90	3.96
7	Giant Biogene Holding Co., Ltd	2367 HK	122,430,833.92	2.92
8	L'occitane International S.A.	973 HK	112,700,247.49	2.68
9	SK Hynix Inc	000660 KS	92,606,432.14	2.21
10	Tencent Holdings Ltd	700 HK	83,484,208.62	1.99
11	WuXi XDC Cayman Inc.	2268 HK	82,003,177.37	1.95
12	Alibaba Group Holding	9988 HK	70,055,645.04	1.67

	Limited			
13	PRADA S.p.A.	1913 HK	67,884,709.08	1.62
14	Yum China Holdings, Inc.	9987 HK	59,146,082.29	1.41
15	QUALCOMM Inc	QCOM US	29,720,061.05	0.71
16	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	8,038,674.12	0.19
17	H World Group Limited	1179 HK	2,512,311.34	0.06

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Advanced Micro Devices Inc	AMD US	331,087,115.97	7.89
2	JD.com, Inc.	9618 HK	244,728,927.21	5.83
3	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	221,024,382.40	5.27
4	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	189,617,409.51	4.52
5	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM US	185,268,204.07	4.41
6	Sea Ltd	SE US	176,229,036.88	4.20
7	Yum China Holdings, Inc.	9987 HK	114,493,626.14	2.73
		YUMC US	29,267,881.44	0.70
8	Tencent Holdings Ltd	700 HK	132,169,112.36	3.15
9	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	2269 HK	124,496,336.10	2.97
10	Trip.com Group Limited	9961 HK	118,759,065.03	2.83
11	L'occitane International S.A.	973 HK	118,264,648.16	2.82
12	CNOOC Limited	883 HK	110,795,827.15	2.64
13	ASE Technology Holding Co Ltd	ASX US	106,869,625.94	2.55
14	WuXi XDC Cayman Inc.	2268 HK	88,548,705.78	2.11
15	Meituan	3690 HK	63,167,675.76	1.50
16	QUALCOMM Inc	QCOM US	30,837,106.62	0.73
17	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	30,035,160.75	0.72
18	Applied Materials Inc	AMAT US	5,013,202.65	0.12

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,053,090,219.90
卖出收入（成交）总额	2,420,673,049.92

注：“买入成本”或“卖出收入”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。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 7.11 投资组合报告附注

**7.11.1** 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。

**7.11.2** 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。

### 7.11.3 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	-
2	应收清算款	2,445,372.99
3	应收股利	30,889,895.69
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,786,810.55
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,122,079.23

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 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。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金可以将不高于 20% 的股票资产投资于除在亚洲地区（日本除外）证券市场交易的企业以及在其他证券市场交易的亚洲企业（日本除外）之外的其他企业，本报告期末该部分股票的投资比例为 19.82%。

## § 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

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
313,209	13,775.12	601,755,005.98	13.95%	3,712,735,780.97	86.05%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	86,261,900.27	1.9994%

### 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 1 月 21 日）基金份额总额	592,067,217.31
本报告期期初基金份额总额	4,661,696,347.07
本报告期基金总申购份额	342,813,426.50
减：本报告期基金总赎回份额	690,018,986.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,314,490,786.95

## § 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	
JP Morgan Securities Limited	1	16,610,791.05	0.37%	13,288.65	0.94%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	873,985,597.77	19.54%	161,597.11	11.48%	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	51,731,194.07	1.16%	24,871.11	1.77%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	455,333,906.18	10.18%	86,216.71	6.12%	-
CLSA Limited	1	410,573,301.95	9.18%	113,372.24	8.05%	-
Sanford C. Bernstein (H.K.) Limited	1	28,876,645.42	0.65%	23,101.29	1.64%	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	693,743,113.50	15.51%	69,644.85	4.95%	-
Goldman Sachs	1	616,498,489.50	13.78%	123,299.55	8.76%	-
中信建投	1	1,279,988,300.41	28.61%	764,020.93	54.27%	-
UBS Securities Asia Limited	1	46,421,930.01	1.04%	28,292.44	2.01%	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-
China Merchants	1	-	-	-	-	-

Securities (HK) Co Ltd						
国信证券	1	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities HK Ltd	1	-	-	-	-	-
Shin Han Investment Corp.	1	-	-	-	-	-
Hyundai Securities (Asia) Limited	1	-	-	-	-	-
Daishin Securities (Asia) Ltd	1	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG London	1	-	-	-	-	-
Nomura Asset Management HongKong Limited	1	-	-	-	-	-
Mirae Asset Securities Co., Ltd	1	-	-	-	-	-
Knight Capital Europe Limited	1	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
BOCOM International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Daewoo Securities	1	-	-	-	-	-
Woori Investment & Securities	1	-	-	-	-	-
First Shanghai Securities Ltd.	1	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities	1	-	-	-	-	-

(Hong Kong) Limited							
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	-	-	-	-	-	-
KGI Institutional Equities	1	-	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司，无减少交易账户，无新增交易账户。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。本报告期内基金交易账户的开立标准如下：

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

#### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例

				比例				
JP Morgan Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CLS A Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanford C. Bernstein (H.K.)	-	-	-	-	-	-	-	-

) Limit ed									
Chin a Intl Capit al Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Gold man Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Secur ities Asia Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Credi t Suiss e (Hon g Kong ) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Merc hants Secur ities (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Shen yin	-	-	-	-	-	-	-	-	-



Wang uo Secur ities HK Ltd									
Shin Han Inves tment Corp.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Hyun dai Secur ities (Asia ) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Daish in Secur ities (Asia ) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Deuts che Bank AG Lond on	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Nom ura Asset Mana geme nt Hong Kong Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Mira e Asset Secur	-	-	-	-	-	-	-	-	-

ities Co., Ltd								
Knig ht Capit al Euro pe Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB Inter natio nal Secur ities Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
BOC OM Inter natio nal Secur ities Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Daew oo Secur ities	-	-	-	-	-	-	-	-
Woor i Inves tment & Secur ities	-	-	-	-	-	-	-	-
First Shan ghai Secur ities Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
KGI Institutional Equities	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2024 年 1 月 15 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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	2024-01-10
2	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
3	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

4	易方达基金管理有限公司关于终止北京中期时代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	2024-01-20
5	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2024 年 2 月 19 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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	2024-02-06
6	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2024 年 3 月 29 日至 2024 年 4 月 1 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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	2024-03-26
7	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
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告提示性公告	中国证券报	2024-04-20
9	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
10	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2024 年 5 月 15 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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	2024-05-10
11	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2024 年 5 月 27 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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	2024-05-22
12	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2024 年 6 月 19 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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	2024-06-14
13	易方达亚洲精选股票型证券投资基金 2024 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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	2024-06-26

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金募集的文件；
2. 中国证监会核准易方达亚洲精选股票型证券投资基金备案的文件；
3. 《易方达亚洲精选股票型证券投资基金基金合同》；
4. 《易方达亚洲精选股票型证券投资基金托管协议》；
5. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
6. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

## 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

## 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日