

# 易米远见价值一年定期开放混合型证券投资基金

## 2024年第三季度报告

2024年09月30日

基金管理人:易米基金管理有限公司

基金托管人:东方证券股份有限公司

报告送出日期:2024年10月25日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人东方证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年7月1日起至9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	易米远见价值一年定开混合
基金主代码	020442
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2024年04月30日
报告期末基金份额总额	217,115,635.95份
投资目标	在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并根据各类资产风险收益特征的相对变化和基金资产状况，适时动态调整各类资产的投资比例，在控制风险的基础上提高基金的收益潜力。本基金可运用在封闭期没有流动性需求的优势，抓住一些长期投资的机会，在价值低估或者有折价机会的时候介入，将价值回归转化为投资收益。具体包括大宗交易策略、定向增发投资策略等。
业绩比较基准	中证800指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*10%+中债综合指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及

	预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资港股通标的的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。	
基金管理人	易米基金管理有限公司	
基金托管人	东方证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易米远见价值一年定开混合A	易米远见价值一年定开混合C
下属分级基金的交易代码	020442	020443
报告期末下属分级基金的份额总额	204,639,576.37份	12,476,059.58份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	易米远见价值一年定开混合A	易米远见价值一年定开混合C
1.本期已实现收益	520,444.01	19,292.15
2.本期利润	19,311,447.48	1,162,941.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0944	0.0932
4.期末基金资产净值	222,597,393.74	13,548,214.84
5.期末基金份额净值	1.0878	1.0859

注：1.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；  
2.本报告所列示的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。

#### 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

易米远见价值一年定开混合A净值表现

阶段	净值增长率①	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	①-③	②-④

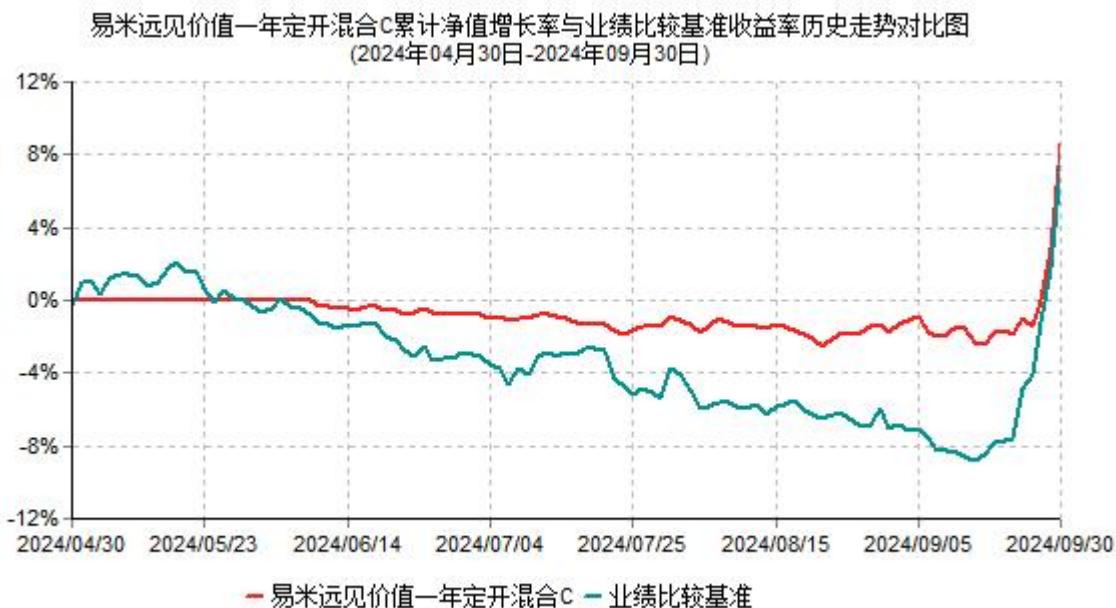
				④		
过去三个月	9.50%	0.86%	11.05%	1.09%	-1.55%	-0.23%
自基金合同生效起至今	8.78%	0.68%	7.54%	0.91%	1.24%	-0.23%

易米远见价值一年定开混合C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.39%	0.86%	11.05%	1.09%	-1.66%	-0.23%
自基金合同生效起至今	8.59%	0.68%	7.54%	0.91%	1.05%	-0.23%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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





## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙会东	本基金基金经理	2024-04-30	-	9	孙会东先生，天津大学硕士，曾任国联证券股份有限公司管理培训生、分析师，国融基金管理有限公司行业研究员、投资经理，易米基金管理有限公司高级研究员、投资经理。现任易米基金管理有限公司基金经理。
魏鑫	本基金基金经理	2024-08-07	-	10	魏鑫先生，兰州大学硕士，曾任海默科技股份有限公司研发中心工程师，东海证券股份有限公司TMT行业组长，海通证券股份有限公司计算机行业高级研究员，

					华泰资产管理有限公司高级投资经理，中国旅游产业基金管理有限公司投资部副总裁，现任易米基金管理有限公司多策略投资部副总经理、基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3.本基金无基金经理助理。

4.本基金本报告期内没有基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《易米远见价值一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定，无违法、违规行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《易米基金管理有限公司公平交易制度》和《易米基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。本基金管理人通过建立科学的公平交易体系，将公平交易理念贯彻投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评价等环节，确保各个投资组合享有公平的投资决策机会。

报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本季度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人旗下管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情形。

报告期内，本基金管理人未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。



#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年三季度，国内宏观经济下行压力加大，虽然三中全会和7月底政治局会议提出了一系列深化改革和宏观政策发力的举措，但政策出台和落地仍需要一定的时间，投资者情绪的弱化不断增加了市场悲观情绪的蔓延，A股市场估值中枢不断回落，投资者的进一步离场也加速了市场的触底，A股投资也到了遍地黄金需要重拾信心的时刻。随着三季度末美联储降息的落地、国内政策组合拳的出台，A股市场走出一轮快速的牛市行情，市场情绪出现反转。

7月至9月中旬市场波动环境下，受上市公司启动、投资者参与意愿均相对较弱的影响，竞价定增发行数量较少，月均项目发行数量为低个位数，投资者参与意愿更低使得平均发行折价率有小幅提升。我们基于对市场的持续跟踪和对风险的谨慎判断，强化约束选股指标，仓位较低。考虑到9月底政策层面出现了我们在中期报告中所期待的超预期积极变化，我们基于产品投资策略以及对市场的持续跟踪和对风险的谨慎判断，优选基本面持续向好、估值处于底部区域的细分行业核心龙头公司，定增孪生标的仓位大幅提升。

展望四季度，美联储降息已经落地，国内宏观调控空间进一步打开，国内经济动能环比有望企稳甚至小幅改善，政策端有望持续发力。随着积极因素的不断积累、催化因素的持续出现，特别是全球断链脱钩大背景下，新质生产力和核心科技是政策发力的重点、国内经济高质量发展的核心，部分行业存在结构性投资机会。我们认为，随着后续市场的逐步企稳、监管政策到位，定增市场启动发行的项目数量、融资规模、折扣水平均会有所恢复。本基金将基于产品投资策略、产品首次开放期流动性管理的既定目标更加审慎地参与定增项目报价，择机在股价存在较大超跌机会时持续布局孪生股票，考虑到目前阶段市场成交活跃、波动加剧，仓位将适时动态调整。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末易米远见价值一年定开混合A基金份额净值为1.0878元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.50%，同期业绩比较基准收益率为11.05%；截至报告期末易米远见价值一年定开混合C基金份额净值为1.0859元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.39%，同期业绩比较基准收益率为11.05%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无应说明的预警信息。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	125,412,475.64	53.03
	其中：股票	125,412,475.64	53.03
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	109,542,000.33	46.32
	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	1,540,206.34	0.65
8	其他资产	-	-
9	合计	236,494,682.31	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	99,266,873.86	42.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,010,450.00	4.66
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,013,826.00	2.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,121,325.78	3.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-



N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	125,412,475.64	53.11

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301358	湖南裕能	409,100	15,341,250.00	6.50
2	603768	常青股份	1,018,675	13,650,245.00	5.78
3	603348	文灿股份	506,756	12,314,170.80	5.21
4	603806	福斯特	680,800	12,022,928.00	5.09
5	000875	吉电股份	2,001,900	11,010,450.00	4.66
6	688521	芯原股份	253,511	9,121,325.78	3.86
7	688789	宏华数科	117,454	9,089,765.06	3.85
8	600587	新华医疗	453,600	8,663,760.00	3.67
9	002452	长高电新	739,300	6,232,299.00	2.64
10	300274	阳光电源	61,000	6,074,380.00	2.57

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.11 投资组合报告附注**

**5.11.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.11.2** 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**5.11.3 其他资产构成**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**5.11.4 报告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。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603768	常青股份	13,650,245.00	5.78	非公开发行限售
2	603348	文灿股份	12,314,170.80	5.21	非公开发行限售

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

	易米远见价值一年定开混合A	易米远见价值一年定开混合C
--	---------------	---------------

报告期期初基金份额总额	204,639,576.37	12,476,059.58
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	204,639,576.37	12,476,059.58

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易米远见价值一年定期开放混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2.《易米远见价值一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易米远见价值一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.法律意见书；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7.中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人及基金托管人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

易米基金管理有限公司

2024年10月25日