

# 易方达安盈回报混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	20
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计意见	21
6.2 形成审计意见的基础	21
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	21
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	21
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 净资产变动表	26
7.4 报表附注	27
§ 8 投资组合报告	63
8.1 期末基金资产组合情况	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	63
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	68
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	69
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	69
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	69
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	69
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	69
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	69
8.12	投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>72</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	73
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>73</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>73</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	73
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	73
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
11.4	基金投资策略的改变 .....	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	74
11.8	其他重大事件 .....	76
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>78</b>
12.1	备查文件目录 .....	78
12.2	存放地点 .....	78
12.3	查阅方式 .....	78

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达安盈回报混合型证券投资基金	
基金简称	易方达安盈回报混合	
基金主代码	001603	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 2 月 16 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,009,811,941.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C
下属分级基金的交易代码	001603	017414
报告期末下属分级基金的份额总额	1,008,485,087.87 份	1,326,853.85 份

注：自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日。

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。2、本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。3、本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。4、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	任航
	联系电话	020-85102688	010-66060069
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95599
传真		020-38798812	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路 30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街28号 凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		510620	100031
法定代表人		刘晓艳	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特 殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中 心 42 楼
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广 州银行大厦 40-43 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指 标	2023 年		2022 年		2021 年	
	易方达安盈 回报混合 A	易方达安盈 回报混合 C	易方达安盈 回报混合 A	易方达安盈 回报混合 C	易方达安盈 回报混合 A	易方达安盈回 报混合 C
本期已 实现收 益	-54,002,732 .93	-24,171.80	-152,029,610. 25	-	171,058,363. 15	-
本期利 润	-130,689,62 7.87	-298,354.52	-551,503,128. 49	-	347,707,652. 97	-
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.1201	-0.1932	-0.4245	-	0.3719	-
本期加 权平均 净值利 润率	-5.58%	-9.09%	-19.11%	-	14.89%	-
本期基 金份额 净值增 长率	-5.77%	-8.50%	-15.00%	-	19.53%	-
3.1.2 期末 数据和指 标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	易方达安盈回 报混合 A	易方达安盈回 报混合 C	易方达安盈回 报混合 A	易方达安盈回 报混合 C	易方达安盈回 报混合 A	易方达安盈回 报混合 C
期末可 供分配 利润	456,260,826 .88	591,519.82	587,135,712. 96	-	888,724,560. 94	-
期末可 供分配 基金份 额利润	0.4524	0.4458	0.4994	-	0.6157	-
期末基 金资产 净值	2,057,613,4 87.67	2,698,925.8 5	2,545,306,66 8.24	-	3,676,629,56 8.95	-
期末基 金份额 净值	2.040	2.034	2.165	-	2.547	-
3.1.3 累计 期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	易方达安盈	易方达安盈	易方达安盈	易方达安盈	易方达安盈	易方达安盈回

	回报混合 A	回报混合 C	回报混合 A	回报混合 C	回报混合 A	报混合 C
基金份额累计净值增长率	120.68%	-8.50%	134.20%	-	175.52%	-

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4.自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 易方达安盈回报混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.16%	0.47%	-0.80%	0.20%	-4.36%	0.27%
过去六个月	-3.04%	0.50%	-1.28%	0.21%	-1.76%	0.29%
过去一年	-5.77%	0.53%	0.43%	0.21%	-6.20%	0.32%
过去三年	-4.26%	0.82%	-0.52%	0.28%	-3.74%	0.54%
过去五年	115.08%	0.96%	21.26%	0.30%	93.82%	0.66%
自基金合同生效起至今	120.68%	0.95%	25.60%	0.29%	95.08%	0.66%

##### 易方达安盈回报混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.22%	0.47%	-0.80%	0.20%	-4.42%	0.27%
过去六个月	-3.24%	0.50%	-1.28%	0.21%	-1.96%	0.29%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-8.50%	0.52%	-1.10%	0.20%	-7.40%	0.32%



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

易方达安盈回报混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

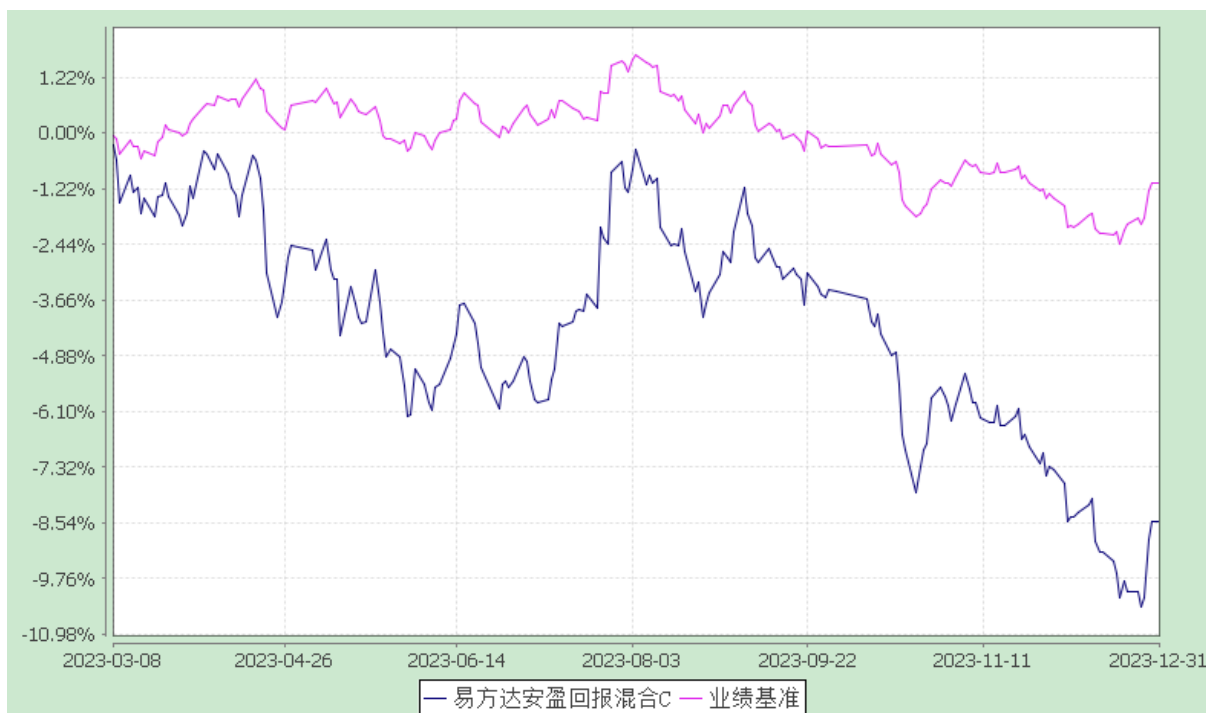
易方达安盈回报混合 A

(2017 年 2 月 16 日至 2023 年 12 月 31 日)



易方达安盈回报混合 C

(2023 年 3 月 8 日至 2023 年 12 月 31 日)



注：1.自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

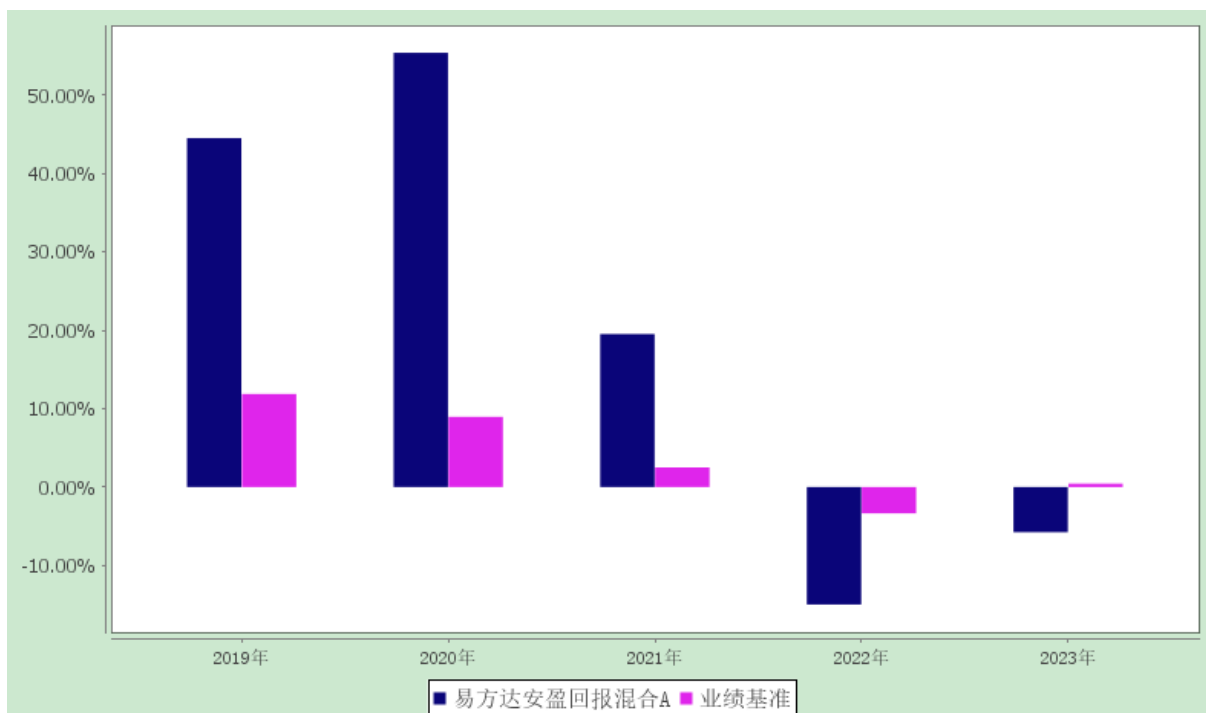
2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 120.68%，同期业绩比较基准收益率为 25.60%；C 类基金份额净值增长率为-8.50%，同期业绩比较基准收益率为-1.10%。

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

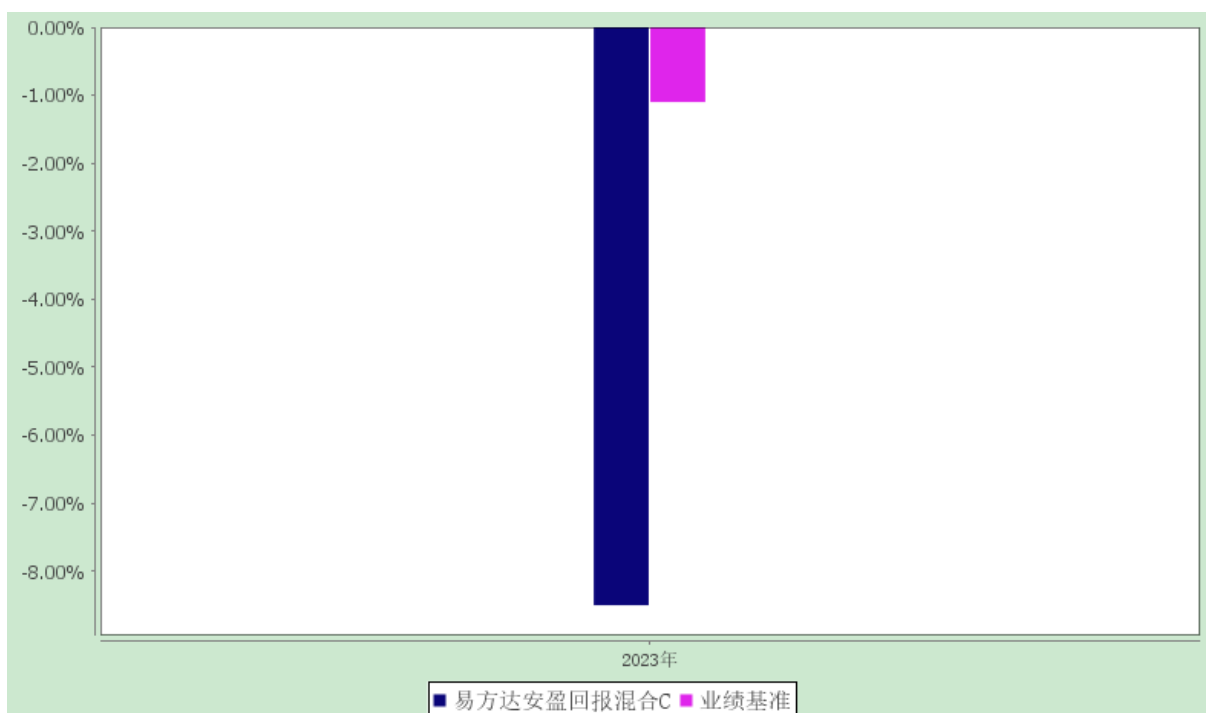
易方达安盈回报混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达安盈回报混合 A



### 易方达安盈回报混合 C



注：自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

易方达安盈回报混合 A

单位：人民币元

年度	每10份基金	现金形式发放总	再投资形式发放总	年度利润分配合	备注

	份额分红数	额	额	计	
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	1.980	171,656,631.84	65,643,708.12	237,300,339.96	-
合计	1.980	171,656,631.84	65,643,708.12	237,300,339.96	-

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
张清华	本基金的基金经理，易方达安心回报债券、易方达裕丰回报债券、易方达丰和债券、易方达新收益混合、易方达悦兴一年持有混合、易方达全球配置混合（QDII）的基金经理，副总经理级高级管理人员、固定收益投资决策委员会委员	2017-02-16	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经理、固定收益基金投资部总经理、混合资产投资部总经理、多资产投资业务总部总经理，易方达裕如混合、易方达新收益混合、易方达安心回馈混合、易方达瑞选混合、易方达裕祥回报债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达裕鑫债券、易方达瑞通混合、易方达瑞程混合、易方达瑞弘混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达鑫转添利混合、易方达鑫转增利混合、易方达鑫转招利混合、易方达丰华债券、易方达磐固六

					个月持有混合的基金经理。
杨康	<p>本基金的基金经理助理，易方达鑫转增利混合、易方达鑫转招利混合（自 2020 年 03 月 07 日至 2023 年 06 月 27 日）、易方达瑞安混合发起式（自 2021 年 01 月 08 日至 2023 年 06 月 27 日）、易方达瑞康混合（自 2021 年 02 月 02 日至 2023 年 06 月 27 日）、易方达裕富债券、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新益混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞信混合、易方达瑞选混合、易方达瑞和混合、易方达瑞富混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2023 年 09 月 12 日）、易方达瑞祺混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合（自 2022 年 08 月 06 日至 2023 年 09 月 12 日）、易方达丰惠混合、易方达裕鑫债券（自 2022 年 08 月 06 日至 2023 年 11 月 03 日）、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达鑫转添利混合、易方达瑞川混合发起式、易方达瑞锦混合发起式的基金经理，易方达丰华债券（自 2019 年 06 月 19 日至 2023 年 03 月 02 日）、易方达安心回报债券、易方达裕丰回报债券（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 02 月 23 日）、易方达丰和债券（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 02 月 23 日）、易方达磐恒九个月持有混合（自 2022 年 07 月 09 日至 2023 年 06 月 19 日）、易方达招易一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达悦安一年持有债券（自 2022 年 07 月 09 日至 2023 年 06 月 19 日）、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合、易方达悦浦一年持有混合的基金经理助理</p>	2019-06-10	-	8 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部研究员、投资经理助理，易方达基金管理有限公司投资经理，易方达瑞川混合发起式、易方达瑞锦混合发起式的基金经理。</p>
周琼	<p>本基金的基金经理助理，易方达鑫转添利混合、易方达鑫转招利混合（自 2019 年 08 月 31 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达裕丰回报债券、易方达丰华债券、易方达新收益混</p>	2019-10-11	-	9 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任凯仁投资咨询（上海）有限公司客户经理，易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员。</p>

<p>合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达丰和债券、易方达裕鑫债券（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达鑫转增利混合（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达安心回报债券、易方达纯债债券（自 2019 年 10 月 11 日至 2023 年 11 月 20 日）、易方达新利混合、易方达新鑫混合、易方达新益混合（自 2019 年 10 月 30 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞选混合（自 2019 年 10 月 30 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞祥混合、易方达瑞祺混合（自 2019 年 11 月 14 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达裕富债券（自 2020 年 04 月 09 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达瑞川混合发起式（自 2020 年 05 月 01 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达丰惠混合、易方达招易一年持有混合、易方达瑞锦混合发起式、易方达磐恒九个月持有混合、易方达磐泰一年持有混合、易方达磐固六个月持有混合（自 2020 年 09 月 15 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达悦享一年持有混合、易方达悦兴一年持有混合、易方达悦通一年持有混合、易方达瑞安混合发起式（自 2021 年 01 月 15 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达瑞康混合（自 2021 年 02 月 05 日至 2023 年 10 月 11 日）、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦安一年持有债券、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合、易方达悦信一年持有混合、易方达瑞富混合、易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦浦一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦稳一年持有混合、易方达安心回馈混合、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达悦鑫一年持</p>				
--	--	--	--	--

有混合、易方达全球配置混合(QDII)的基金经理助理				
----------------------------	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利

益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 47 次，其中 40 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年中国实际 GDP（国内生产总值，下同）增速 5.2%，名义 GDP 增速 4.6%，实际增速和名义增速的剪刀差，展现出微观主体压力始终存在，价格指数的大幅走弱对企业盈利和私人部门中长期信心产生压制，这也表明后续稳增长需求仍是稳增长的关键。单季 GDP 两年复合增速分别为 4.7%、3.3%、4.4%、4.0%，经济延续温和修复，但节奏上一波三折。一季度在服务业重启、出口份额回补等疫后补偿性修复因素的拉动下经济快速回升，二季度随着短期拉动因素的消退，叠加财政退坡、外需承压，经济的年内低点出现，三季度财政政策再度发力、地产放松等政策陆续出台，经济环比有所企稳，但居民信心不足、地产链条持续走弱等问题始终突出，政策的力度难以对冲经济内生动能的持续疲弱，四季度经济增速略有回落。海外方面，即使经历了高通胀与高利率环境，美国经济增长仍展现出了超预期的韧性，美联储在全年的大部分时间里保持鹰派，美债利率持续创新高；直至年末形势有所逆转，11 月初增长和通胀等重点经济数据均走弱，市场对经济衰退的担忧升温，美联储态度迅速转鸽、金融条件扩张，就业市场略承压但仍保持稳定，美国经济整体仍维持软着陆前景。

在经济内生动能不足和海外利率高企的背景下，A 股全年震荡走弱。年初对经济增长抱有较高预期，市场迅速冲高后盘整，但随着 4 月经济数据全面下滑，股指震荡调整。8 月以后市场期待的



稳增长政策没有落地，需求未见好转、价格持续下行，叠加美债利率的快速攀升压制全球风险资产表现，权益市场经历了几轮下跌。

转债方面，年初经历估值快速提升后维持在高位震荡，二、三季度在权益市场调整的过程中表现出了较好的防御属性，主要基于债市上涨和流动性环境宽松的提振。9 月以后受到股债调整的影响，估值水平有所压缩，随着权益预期的持续下降，转债释放了一部分高估值压力，年末债性价值已经接近历史极值附近。

2023 年传统的宏观分析范式被打破，国内政策对经济的响应函数呈现出与以往周期不一样的特征，资产价格走势受到国内外多重因素的影响，预判难度大大提高，这对资产配置的对调整也提出了较高的要求。全年来看，财政政策并未在经济体现下行压力大的时候就大举发力，市场对政策的期待屡屡落空；下半年地产放松政策陆续出台，累计放松的幅度也较大，但地产销售和投资始终呈现疲弱态势，这使得经济内生动能始终偏弱。

回顾组合全年操作，在大类资产配置上有所失误，对净值造成了一定拖累。年初基于对疫后经济修复的乐观预期，组合高配了股票和转债，二季度观察到经济指标下滑幅度和速度均超出此前预期，组合适当降低了股票的配置并调整了个股持仓。在市场快速下行后，担忧预期释放较为充分，很多优质公司的估值水平已经具备较好的长期配置价值，只要经济不持续大幅下滑，未来至少能分享企业盈利的增长，基于上述判断，从赔率角度出发组合在全年整体维持了较高的权益仓位，通过优化持仓结构的方式来降低波动性、应对市场变化，在反弹过程中适当减持 TMT（数字新媒体产业）等成长行业，加仓医药、银行、机械等偏低估值的行业，提高组合的灵活性。债券部分仍以配置可转债为主，考虑到年初估值偏贵，组合在上半年一方面降低仓位，同时在结构上做出了调整，提升了低期权估值、低评级和高波动转债的占比；下半年转债仓位基本稳定，组合着重配置了下修后弹性有所恢复的低价券和赎回线附近低溢价率个券，用估值偏低的新券替换组合中因正股下跌已经失去弹性的老券，组合在整体绝对价格下降的同时维持了弹性和不对称性。纯债仓位仍以短久期信用债为主获取票息和骑乘收益，同时保持较好的流动性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 2.040 元，本报告期份额净值增长率为-5.77%，同期业绩比较基准收益率为 0.43%；C 类基金份额净值为 2.034 元，本报告期份额净值增长率为-8.50%，同期业绩比较基准收益率为-1.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，预计中国经济将延续弱复苏格局。从当前的政策基调及各省陆续公布的全年经济增长目标来看，政策对增长仍有诉求，2023 年末已出台的财政政策、2024 年初新增 PSL（抵押补充

贷款) 资金投放将对实物工程量形成拉动, 不过根据测算, 实现全年目标仍需特别国债等财政政策的持续发力。同时我们也意识到, 在经济转型过程中, 很多中长期结构性问题仍待解决, 居民部门账户进一步恶化、缩表行为继续扩散, 企业产能过剩尚未扭转、盈利回落对内生资本开支形成压制, 地产链条持续走弱、缺乏新的经济增长动能以对冲传统部门的下滑。内生动能偏弱, 有效需求不足, 制约了经济向上恢复的高度, 增长仍是一波三折的过程。

当前很多优质公司的估值水平已经降到历史最低水平附近, 市场对企业盈利的负面预期定价已经较为充分, 只要经济不进一步的回落, 估值进一步压缩的风险较小, 未来至少能够分享企业盈利的增长, 很多优质公司的分红收益率也已经超过国债收益率。2024 年海外环境最大的变化可能在于全球流动性拐点的出现、中美周期从错位走向收敛, 人民币汇率压力的缓解将进一步打开国内政策的操作空间。站在一个中长期的角度, 组合仍将保持一个中性偏高的权益配置。

短期来看, 价格数据是经济的“体温计”, 我们将密切关注 CPI (消费者物价指数) 和 PPI (生产者物价指数) 的走势, 在价格回升前, 适度控制仓位, 并调整组合结构, 降低组合对于宏观经济的暴露度, 自上而下加强资产配置的作用, 提高组合的灵活性。组合将自下而上更多关注供给格局相对清晰的行业, 优选商业模式清晰、资产负债表健康的公司跨越周期。转债投资上, 经过两年的市场调整绝对价格已经较低, 偏债个券的 YTM (到期收益率) 相较于信用债已经有较强的吸引力, 后续组合将积极关注其中的结构性机会。纯债仓位仍将以流动性管理为主, 保证组合大类资产配置调整的灵活性, 力争以长期稳健的业绩回报基金持有人。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期, 基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要, 继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控, 持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查, 有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期, 基金管理人主要监察稽核工作及措施如下:

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

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

(3) 持续督促优化基金募集申请材料质量内控机制和工具手段, 提升产品合规审查质效; 坚持

以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险，切实保护投资者合法权益。

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达安盈回报混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达安盈回报混合 C:本报告期内未实施利润分配。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—易方达基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为,易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,易方达基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 24444 号

易方达安盈回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人:

## 6.1 审计意见

### (一)我们审计的内容

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

### (二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达安盈回报混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

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

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

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

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

基金管理人治理层负责监督易方达安盈回报混合型证券投资基金的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

执行以下工作：

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

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

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

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

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵珏 成磊

中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：易方达安盈回报混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	1,819,551.84	4,886,034.42
结算备付金		5,255,626.56	15,715,844.20
存出保证金		87,943.46	179,022.10
交易性金融资产	7.4.7.2	2,005,795,799.38	2,538,616,386.91
其中：股票投资		805,610,183.40	1,089,131,699.69
基金投资		-	-
债券投资		1,200,185,615.98	1,449,484,687.22
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	50,995,376.72	-
应收清算款		3,510,839.38	145,019.34
应收股利		-	-
应收申购款		728,820.94	2,348,183.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,068,193,958.28</b>	<b>2,561,890,490.80</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-1,184.66
应付清算款		-	3,927,940.34
应付赎回款		5,362,050.68	9,376,631.56

应付管理人报酬		1,599,822.28	1,962,820.29
应付托管费		355,516.06	545,227.87
应付销售服务费		951.25	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		21,507.06	11,800.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	541,697.43	760,587.05
<b>负债合计</b>		<b>7,881,544.76</b>	<b>16,583,822.56</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,009,811,941.72	1,175,731,739.54
未分配利润	7.4.7.8	1,050,500,471.80	1,369,574,928.70
<b>净资产合计</b>		<b>2,060,312,413.52</b>	<b>2,545,306,668.24</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>2,068,193,958.28</b>	<b>2,561,890,490.80</b>

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 2.040 元，C 类基金份额净值 2.034 元；基金份额总额 1,009,811,941.72 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,008,485,087.87 份，C 类基金份额总额 1,326,853.85 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达安盈回报混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-102,916,250.07</b>	<b>-517,077,183.36</b>
1.利息收入		325,010.89	2,076,465.90
其中：存款利息收入	7.4.7.9	151,278.14	273,263.95
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		173,732.75	1,803,201.95



其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-26,694,856.23	-121,535,654.30
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-73,081,567.05	-210,293,967.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	22,033,324.86	78,675,779.24
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	24,353,385.96	10,082,534.03
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-76,961,077.66	-399,473,518.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	414,672.93	1,855,523.28
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>28,071,732.32</b>	<b>34,425,945.13</b>
1. 管理人报酬		21,154,530.98	26,052,758.16
2. 托管费		5,343,808.48	7,236,877.16
3. 销售服务费		10,861.67	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,257,210.34	814,418.21
其中：卖出回购金融资产支出		1,257,210.34	814,418.21
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		16,124.58	20,183.82
8. 其他费用	7.4.7.18	289,196.27	301,707.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-130,987,982.39</b>	<b>-551,503,128.49</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-130,987,982.39</b>	<b>-551,503,128.49</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-130,987,982.39</b>	<b>-551,503,128.49</b>

## 7.3 净资产变动表

会计主体：易方达安盈回报混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,175,731,739.54	1,369,574,928.70	2,545,306,668.24
二、本期期初净资产	1,175,731,739.54	1,369,574,928.70	2,545,306,668.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-165,919,797.82	-319,074,456.90	-484,994,254.72
（一）、综合收益总额	-	-130,987,982.39	-130,987,982.39
（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）	-165,919,797.82	-188,086,474.51	-354,006,272.33
其中：1.基金申购款	143,974,111.60	168,027,830.14	312,001,941.74
2.基金赎回款	-309,893,909.42	-356,114,304.65	-666,008,214.07
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,009,811,941.72	1,050,500,471.80	2,060,312,413.52
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,443,320,482.38	2,233,309,086.57	3,676,629,568.95
二、本期期初净资产	1,443,320,482.38	2,233,309,086.57	3,676,629,568.95
三、本期增减变动	-267,588,742.84	-863,734,157.87	-1,131,322,900.71

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	-551,503,128.49	-551,503,128.49
（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）	-267,588,742.84	-312,231,029.38	-579,819,772.22
其中：1.基金申购款	443,359,813.37	564,894,000.69	1,008,253,814.06
2.基金赎回款	-710,948,556.21	-877,125,030.07	-1,588,073,586.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,175,731,739.54	1,369,574,928.70	2,545,306,668.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

易方达安盈回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1333号《关于准予易方达安盈回报混合型证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2016]2955号《关于易方达安盈回报混合型证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达安盈回报混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达安盈回报混合型证券投资基金基金合同》于2017年2月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为604,172,113.67份基金份额，其中认购资金利息折合184,238.52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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

自2023年3月7日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2023年3月8日。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、

各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产

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

###### 债务工具

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

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7实收基金

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

#### 7.4.4.8损益平准金

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

#### 7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有

权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

(4) 在遵守法律法规及监管部门规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号



《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再

缴纳；已缴纳增值的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	1,819,551.84	4,886,034.42
等于：本金	1,818,693.92	4,884,949.65
加：应计利息	857.92	1,084.77
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	1,819,551.84	4,886,034.42

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		967,232,651.06	-	805,610,183.40	-161,622,467.66
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,099,160,369.37	3,744,779.16	1,093,826,984.83	-9,078,163.70
	银行间市场	104,812,260.00	1,379,631.15	106,358,631.15	166,740.00
	合计	1,203,972,629.37	5,124,410.31	1,200,185,615.98	-8,911,423.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,171,205,280.43	5,124,410.31	2,005,795,799.38	-170,533,891.36
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,164,001,586.20	-	1,089,131,699.69	-74,869,886.51
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-

债券	交易所市场	1,330,815,768.8 2	6,209,494.56	1,318,546,761.19	-18,478,502.19
	银行间市场	130,097,425.00	1,064,926.03	130,937,926.03	-224,425.00
	合计	1,460,913,193.8 2	7,274,420.59	1,449,484,687.22	-18,702,927.19
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,624,914,780.0 2	7,274,420.59	2,538,616,386.91	-93,572,813.70

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,995,376.72	-
银行间市场	-	-
合计	50,995,376.72	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,278.92	5,800.70
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	75,418.51	294,786.35
其中：交易所市场	74,181.01	290,243.34
银行间市场	1,237.50	4,543.01
应付利息	-	-
预提费用	460,000.00	460,000.00
合计	541,697.43	760,587.05

## 7.4.7.7 实收基金

易方达安盈回报混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,175,731,739.54	1,175,731,739.54
本期申购	139,862,166.24	139,862,166.24
本期赎回（以“-”号填列）	-307,108,817.91	-307,108,817.91
本期末	1,008,485,087.87	1,008,485,087.87

易方达安盈回报混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	4,111,945.36	4,111,945.36

本期赎回（以“-”号填列）	-2,785,091.51	-2,785,091.51
本期末	1,326,853.85	1,326,853.85

注：1.自 2023 年 3 月 7 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 3 月 8 日。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

易方达安盈回报混合 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	587,135,712.96	782,439,215.74	1,369,574,928.70
本期期初	587,135,712.96	782,439,215.74	1,369,574,928.70
本期利润	-54,002,732.93	-76,686,894.94	-130,689,627.87
本期基金份额交易产生的变动数	-76,872,153.15	-112,884,747.88	-189,756,901.03
其中：基金申购款	65,275,765.17	97,904,581.22	163,180,346.39
基金赎回款	-142,147,918.32	-210,789,329.10	-352,937,247.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	456,260,826.88	592,867,572.92	1,049,128,399.80

易方达安盈回报混合 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-24,171.80	-274,182.72	-298,354.52
本期基金份额交易产生的变动数	615,691.62	1,054,734.90	1,670,426.52
其中：基金申购款	1,874,972.75	2,972,511.00	4,847,483.75
基金赎回款	-1,259,281.13	-1,917,776.10	-3,177,057.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	591,519.82	780,552.18	1,372,072.00

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	22,942.20	54,789.11
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	125,586.53	214,595.67
其他	2,749.41	3,879.17
合计	151,278.14	273,263.95

## 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-73,081,567.05	-210,293,967.57
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	-73,081,567.05	-210,293,967.57

## 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	545,848,915.65	1,079,469,298.36
减：卖出股票成本总额	617,672,465.48	1,287,042,460.87
减：交易费用	1,258,017.22	2,720,805.06
买卖股票差价收入	-73,081,567.05	-210,293,967.57

## 7.4.7.11 债券投资收益

## 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月 31日	2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利息收入	18,869,642.69	17,218,261.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,163,682.17	61,457,517.59
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	22,033,324.86	78,675,779.24

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31 日	2022年1月1日至2022年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,492,747,278.53	2,028,202,395.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,476,860,518.41	1,954,526,021.90
减：应计利息总额	12,665,347.80	12,159,167.41
减：交易费用	57,730.15	59,688.33
买卖债券差价收入	3,163,682.17	61,457,517.59

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	24,353,385.96	10,082,534.03
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	24,353,385.96	10,082,534.03

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益



单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-76,961,077.66	-399,473,518.24
——股票投资	-86,752,581.15	-205,998,491.18
——债券投资	9,791,503.49	-193,475,027.06
——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	-76,961,077.66	-399,473,518.24

## 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	414,672.93	1,855,523.28
合计	414,672.93	1,855,523.28

## 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

## 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行汇划费	31,996.27	44,507.78
其他	1,200.00	1,200.00
合计	289,196.27	301,707.78

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

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。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,154,530.98	26,052,758.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,173,631.41	6,161,477.02
应支付基金管理人的净管理费	15,980,899.57	19,891,281.14

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.90% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,343,808.48	7,236,877.16

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	5,446.53	5,446.53
合计	-	5,446.53	5,446.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C	合计
合计	-	-	-

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

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	易方达安盈回报混 合A	易方达安盈回报混 合C	易方达安盈回报混 合A	易方达安盈回报混 合C
报告期初持有的基金份额	97,617,727.45	-	97,617,727.45	-
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	97,617,727.45	-	97,617,727.45	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.6796%	-	8.3027%	-

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。

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

易方达安盈回报混合 A

无。

易方达安盈回报混合 C

无。

##### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期存款	1,819,551.84	22,942.20	4,886,034.42	54,789.11

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

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301181	标榜股份	新股网下发行	2,564	103,201.00
广发证券股份有限公司	301220	亚香股份	新股网下发行	2,849	102,507.02
广发证券股份有限公司	603057	紫燕食品	新股网下发行	549	8,317.35
广发证券股份有限公司	603255	鼎际得	新股网下发行	488	10,677.44
广发证券股份有限公司	688496	清越科技	新股网下发行	12,000	109,920.00

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

易方达安盈回报混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达安盈回报混合 C

本报告期内未发生利润分配。

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

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001326	联域股份	2023-11-01	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6 个月	新股流通受限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023-08-30	6 个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023-07-06	6 个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭	2023-08-01	6 个月	新股	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-

	电子			流通受限						
301370	国科恒泰	2023-07-03	6 个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6 个月	新股流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301372	科净源	2023-08-03	6 个月	新股流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301413	安培龙	2023-12-11	6 个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6 个月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6 个月	新股流通受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6 个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股流通受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6 个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-



301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301499	维科精密	2023-07-13	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301511	德福科技	2023-08-08	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	新股流通受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023-12-01	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023-07-26	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	新股流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	新股流通	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-

				受限							
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-	
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	新股 流通 受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-	
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	新股 流通 受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	新股 流通 受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	新股 流通 受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	
301550	斯菱股份	2023-09-06	6 个月	新股 流通 受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	新股 流通 受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
301558	三态股份	2023-09-21	6 个月	新股 流通 受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-	
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新股 流通 受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-	
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股 流通 受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-	
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新股 流通 受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-	
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	新股 流通 受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-	
601083	锦江航运	2023-11-28	6 个月	新股 流通 受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-	
601096	宏盛华源	2023-12-15	6 个月	新股 流通 受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-	
603004	鼎龙	2023-12-20	6 个月	新股	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-	

	科技			流通受限						
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023-10-09	6 个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688347	华虹公司	2023-07-27	6 个月	新股流通受限	52.00	42.06	57,825	3,006,900.00	2,432,119.50	-
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新股流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-

688549	中巨芯	2023-08-30	6 个月	新股 流通 受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月	新股 流通 受限	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688573	信宇人	2023-08-09	6 个月	新股 流通 受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股 流通 受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6 个月	新股 流通 受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688592	司南导航	2023-08-07	6 个月	新股 流通 受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	新股 流通 受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新股 流通 受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023-07-11	6 个月	新股 流通 受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6 个月	新股 流通 受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新股 流通 受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	新股 流通 受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股 流通 受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	新股 流通 受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新股 流通	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-

				受限						
688693	锆威特	2023-08-10	6 个月	新股 流通 受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新股 流通 受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月	新股 流通 受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	新股 流通 受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月	新股 流通 受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

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

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交

易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 52.94%(2022 年 12 月 31 日：51.80%)。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	109,375,581.83	130,937,926.03
合计	109,375,581.83	130,937,926.03

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
--------	--------------------	---------------------

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

## 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

## 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	679,502,734.23	1,029,391,396.33
AAA 以下	411,307,299.92	289,155,364.86
未评级	0.00	0.00
合计	1,090,810,034.15	1,318,546,761.19

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

## 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

## 7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2023 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

## 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,819,551.84	-	-	-	1,819,551.84
结算备付金	5,255,626.56	-	-	-	5,255,626.56
存出保证金	87,943.46	-	-	-	87,943.46
交易性金融资产	191,872,959.12	914,234,953.14	94,077,703.72	805,610,183.40	2,005,795,799.38
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	50,995,376.72	-	-	-	50,995,376.72
应收清算款	-	-	-	3,510,839.38	3,510,839.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	728,820.94	728,820.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	250,031,457.70	914,234,953.14	94,077,703.72	809,849,843.72	2,068,193,958.28
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	-	-	-	5,362,050.68	5,362,050.68
应付管理人报酬	-	-	-	1,599,822.28	1,599,822.28
应付托管费	-	-	-	355,516.06	355,516.06
应付销售服务费	-	-	-	951.25	951.25
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	21,507.06	21,507.06
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	541,697.43	541,697.43
负债总计	-	-	-	7,881,544.76	7,881,544.76
利率敏感度缺口	250,031,457.70	914,234,953.14	94,077,703.72	801,968,298.96	2,060,312,413.52
<b>上年度末</b>					
<b>2022 年 12 月 31 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	4,886,034.42	-	-	-	4,886,034.42
结算备付金	15,715,844.20	-	-	-	15,715,844.20
存出保证金	179,022.10	-	-	-	179,022.10
交易性金融资产	394,186,436.71	959,802,555.43	95,495,695.08	1,089,131,699.69	2,538,616,386.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	145,019.34	145,019.34
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,348,183.83	2,348,183.83
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>414,967,337.43</b>	<b>959,802,555.43</b>	<b>95,495,695.08</b>	<b>1,091,624,902.86</b>	<b>2,561,890,490.80</b>
<b>负债</b>					

短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-1,184.66	-	-	-	-1,184.66
应付清算款	-	-	-	3,927,940.34	3,927,940.34
应付赎回款	-	-	-	9,376,631.56	9,376,631.56
应付管理人报酬	-	-	-	1,962,820.29	1,962,820.29
应付托管费	-	-	-	545,227.87	545,227.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	11,800.11	11,800.11
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	760,587.05	760,587.05
负债总计	-1,184.66	-	-	16,585,007.22	16,583,822.56
利率敏感度缺口	414,968,522.09	959,802,555.43	95,495,695.08	1,075,039,895.64	2,545,306,668.24

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	1,095,649.42	982,622.51
2.市场利率上升25个基点	-1,091,963.01	-978,830.16	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	805,610,183.40	39.10	1,089,131,699.69	42.79
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	805,610,183.40	39.10	1,089,131,699.69	42.79

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	245,295,019.66	371,804,668.51
2.业绩比较基准下降 5%	-245,295,019.66	-371,804,668.51	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,611,777,927.68	1,987,590,734.53
第二层次	390,319,689.96	550,138,257.77
第三层次	3,698,181.74	887,394.61
合计	2,005,795,799.38	2,538,616,386.91

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	887,394.61	887,394.61
当期购买	-	5,509,593.06	5,509,593.06
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,574,851.75	2,574,851.75
当期利得或损失总额	-	-123,954.18	-123,954.18
其中：计入损益的利得或损失	-	-123,954.18	-123,954.18
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	3,698,181.74	3,698,181.74
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损	-	-428,745.75	-428,745.75

失的变动——公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	42,571,574.54	42,571,574.54
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	47,394,277.18	47,394,277.18
当期利得或损失总额	-	5,710,097.25	5,710,097.25
其中：计入损益的利得或损失	-	5,710,097.25	5,710,097.25
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	887,394.61	887,394.61
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	156,583.85	156,583.85

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	3,698,181.74	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962—2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	887,394.61	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2063—2.4756	负相关

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

## 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

## 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	805,610,183.40	38.95
	其中：股票	805,610,183.40	38.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,200,185,615.98	58.03
	其中：债券	1,200,185,615.98	58.03
	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	50,995,376.72	2.47
	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	7,075,178.40	0.34
8	其他各项资产	4,327,603.78	0.21
9	合计	2,068,193,958.28	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	505,050,605.78	24.51

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	55,971,025.09	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,068,188.13	1.85
J	金融业	206,466,691.24	10.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069.29	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	805,610,183.40	39.10

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600486	扬农化工	1,652,906	104,331,426.72	5.06
2	601658	邮储银行	19,416,702	84,462,653.70	4.10
3	002304	洋河股份	693,200	76,182,680.00	3.70
4	600309	万华化学	950,600	73,025,092.00	3.54
5	600036	招商银行	2,165,419	60,241,956.58	2.92
6	000568	泸州老窖	328,400	58,921,528.00	2.86
7	600976	健民集团	856,930	55,914,682.50	2.71
8	000858	五粮液	382,300	53,640,513.00	2.60
9	300059	东方财富	3,113,974	43,720,194.96	2.12
10	688188	柏楚电子	150,200	38,017,122.00	1.85
11	603915	国茂股份	1,622,900	26,745,392.00	1.30
12	300408	三环集团	867,896	25,559,537.20	1.24



13	000425	徐工机械	4,515,200	24,652,992.00	1.20
14	000423	东阿阿胶	473,600	23,357,952.00	1.13
15	600079	人福医药	864,100	21,481,526.00	1.04
16	601601	中国太保	758,700	18,041,886.00	0.88
17	300628	亿联网络	460,740	13,614,867.00	0.66
18	688347	华虹公司	57,825	2,432,119.50	0.12
19	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
20	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
21	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
22	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
23	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
24	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
25	301291	明阳电气	1,206	34,202.16	0.00
26	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
27	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
28	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
29	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
30	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
31	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
32	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
33	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
34	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
35	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
36	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
37	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
38	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
39	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
40	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
41	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
42	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
43	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
44	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
45	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
46	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
47	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
48	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
49	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
50	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
51	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
52	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
53	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
54	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
55	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
56	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00

57	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
58	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
59	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
60	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
61	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
62	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
63	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
64	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
65	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
66	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
67	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
68	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
69	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
70	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
71	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
72	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
73	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
74	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
75	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
76	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
77	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
78	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
79	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
80	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
81	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
82	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
83	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
84	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
85	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
86	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
87	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
88	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
89	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
90	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
91	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
92	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
93	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
94	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
95	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
96	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
97	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
98	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
99	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
100	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00

101	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
102	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
103	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
104	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
105	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
106	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
107	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600976	健民集团	59,378,110.78	2.33
2	601658	邮储银行	49,894,494.00	1.96
3	600036	招商银行	49,834,350.87	1.96
4	000425	徐工机械	26,163,553.00	1.03
5	300014	亿纬锂能	26,086,256.97	1.02
6	301039	中集车辆	25,853,512.53	1.02
7	000568	泸州老窖	25,048,266.00	0.98
8	603806	福斯特	24,310,130.40	0.96
9	600079	人福医药	23,171,065.00	0.91
10	000423	东阿阿胶	23,020,923.00	0.90
11	300059	东方财富	22,924,142.80	0.90
12	601601	中国太保	21,633,478.00	0.85
13	002304	洋河股份	13,037,021.78	0.51
14	688347	华虹公司	4,295,512.00	0.17
15	688249	晶合集成	1,470,454.26	0.06
16	688563	航材股份	1,185,639.90	0.05
17	688443	智翔金泰	1,148,862.52	0.05
18	688469	芯联集成	785,185.86	0.03
19	688472	阿特斯	694,882.20	0.03
20	688531	日联科技	527,234.80	0.02

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

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	002415	海康威视	126,002,879.77	4.95
2	688188	柏楚电子	94,444,359.03	3.71
3	688200	华峰测控	49,135,173.22	1.93
4	002756	永兴材料	41,014,203.66	1.61
5	300059	东方财富	38,327,711.64	1.51
6	603806	福斯特	32,766,031.95	1.29
7	301039	中集车辆	27,775,615.06	1.09
8	600309	万华化学	25,946,656.00	1.02
9	300408	三环集团	21,751,558.00	0.85
10	300014	亿纬锂能	19,829,655.21	0.78
11	300919	中伟股份	19,590,568.38	0.77
12	601012	隆基绿能	12,058,255.18	0.47
13	688249	晶合集成	1,452,991.23	0.06
14	688347	华虹公司	1,336,106.76	0.05
15	688443	智翔金泰	1,088,816.93	0.04
16	688472	阿特斯	1,049,042.29	0.04
17	688469	芯联集成	816,435.25	0.03
18	688563	航材股份	811,585.60	0.03
19	301358	湖南裕能	655,040.20	0.03
20	688531	日联科技	641,311.81	0.03

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	420,903,530.34
卖出股票收入（成交）总额	545,848,915.65

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,016,950.68	0.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	328,616,944.58	15.95

	其中：政策性金融债	106,358,631.15	5.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	868,551,720.72	42.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,200,185,615.98	58.25

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	230206	23 国开 06	1,050,000	106,358,631.15	5.16
2	113044	大秦转债	779,040	90,626,512.91	4.40
3	137814	22 华泰 G5	700,000	70,253,917.81	3.41
4	132018	G 三峡 EB1	311,000	48,068,969.45	2.33
5	110059	浦发转债	400,000	43,066,356.16	2.09

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,大秦铁路股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到西安铁路监督管理局的处罚。华泰证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局江苏省分局、中国人民银行江苏省分行的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	87,943.46
2	应收清算款	3,510,839.38
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	728,820.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,327,603.78

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	113044	大秦转债	90,626,512.91	4.40
2	132018	G 三峡 EB1	48,068,969.45	2.33
3	110059	浦发转债	43,066,356.16	2.09

4	127049	希望转 2	35,765,841.73	1.74
5	110083	苏租转债	34,067,500.01	1.65
6	128081	海亮转债	33,911,881.14	1.65
7	113052	兴业转债	32,823,481.64	1.59
8	113050	南银转债	31,560,155.87	1.53
9	127040	国泰转债	30,219,848.29	1.47
10	110073	国投转债	30,049,621.54	1.46
11	113037	紫银转债	29,000,259.57	1.41
12	123107	温氏转债	28,878,944.15	1.40
13	110045	海澜转债	26,822,976.79	1.30
14	110079	杭银转债	18,255,454.14	0.89
15	128130	景兴转债	16,890,453.04	0.82
16	113647	禾丰转债	16,793,974.85	0.82
17	128141	旺能转债	15,350,606.65	0.75
18	127050	麒麟转债	15,042,857.64	0.73
19	127035	濮耐转债	13,896,322.82	0.67
20	123190	道氏转 02	13,819,469.35	0.67
21	110061	川投转债	13,631,939.97	0.66
22	127063	贵轮转债	13,622,370.12	0.66
23	127033	中装转 2	11,560,686.07	0.56
24	123085	万顺转 2	10,708,614.01	0.52
25	132026	G 三峡 EB2	10,616,825.25	0.52
26	127027	能化转债	9,999,602.59	0.49
27	127032	苏行转债	9,835,201.20	0.48
28	123178	花园转债	9,560,327.54	0.46
29	118028	会通转债	9,504,932.10	0.46
30	128119	龙大转债	8,468,346.30	0.41
31	111005	富春转债	7,900,397.76	0.38
32	113063	赛轮转债	7,532,113.76	0.37
33	113056	重银转债	7,497,492.71	0.36
34	128129	青农转债	6,339,774.83	0.31
35	110077	洪城转债	5,813,528.78	0.28
36	118031	天 23 转债	5,749,424.94	0.28
37	127045	牧原转债	5,521,381.63	0.27
38	113060	浙 22 转债	5,482,154.52	0.27
39	123187	超达转债	5,401,091.96	0.26
40	110043	无锡转债	5,381,272.26	0.26
41	113048	晶科转债	4,788,394.47	0.23
42	110090	爱迪转债	4,536,706.34	0.22
43	113065	齐鲁转债	4,478,126.51	0.22
44	127015	希望转债	2,719,915.25	0.13
45	123194	百洋转债	2,395,009.18	0.12
46	111007	永和转债	2,241,627.80	0.11
47	127005	长证转债	2,224,158.79	0.11

48	113648	巨星转债	1,841,056.70	0.09
49	113664	大元转债	1,752,442.44	0.09
50	110084	贵燃转债	1,733,533.41	0.08
51	111012	福新转债	1,495,887.23	0.07
52	111000	起帆转债	1,379,247.99	0.07
53	110068	龙净转债	1,304,163.90	0.06
54	113066	平煤转债	1,255,994.17	0.06
55	111011	冠盛转债	1,169,965.13	0.06
56	118030	睿创转债	1,141,313.63	0.06
57	127082	亚科转债	1,076,826.98	0.05
58	110074	精达转债	1,055,178.87	0.05
59	127058	科伦转债	800,476.89	0.04
60	113628	晨丰转债	787,444.16	0.04
61	118022	锂科转债	752,551.86	0.04
62	123188	水羊转债	749,108.11	0.04
63	123191	智尚转债	720,498.13	0.03
64	127054	双箭转债	304,280.37	0.01
65	113549	白电转债	124,745.37	0.01

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达安盈回报混合 A	100,549	10,029.79	300,919,783.55	29.84%	707,565,304.32	70.16%
易方达安盈回报混合 C	86	15,428.53	593.70	0.04%	1,326,260.15	99.96%
合计	100,635	10,034.40	300,920,377.25	29.80%	708,891,564.47	70.20%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------



基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达安盈回报混合 A	3,087,952.21	0.3062%
	易方达安盈回报混合 C	4,498.43	0.3390%
	合计	3,092,450.64	0.3062%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达安盈回报混合 A	>100
	易方达安盈回报混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达安盈回报混合 A	>100
	易方达安盈回报混合 C	0
	合计	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达安盈回报混合 A	易方达安盈回报混合 C
基金合同生效日（2017 年 2 月 16 日）基金份额总额	604,172,113.67	-
本报告期期初基金份额总额	1,175,731,739.54	-
本报告期基金总申购份额	139,862,166.24	4,111,945.36
减：本报告期基金总赎回份额	307,108,817.91	2,785,091.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,008,485,087.87	1,326,853.85

注：本基金 A 类基金份额由原基金份额变更而来，并于 2023 年 3 月 7 日起增设 C 类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起王骏先生担任公司副总经

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 7 年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为 100,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
渤海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	11,454,489.12	1.22%	9,163.58	1.29%	-
东方财富	1	98,288,052.56	10.50%	78,630.45	11.06%	-
方正证券	2	38,211,320.04	4.08%	30,568.54	4.30%	-
国泰君安	1	67,507,198.61	7.21%	54,006.57	7.59%	-
国投证券	1	503,488.05	0.05%	302.09	0.04%	-
国信证券	1	767,793.02	0.08%	614.23	0.09%	-
海通证券	1	12,435,201.18	1.33%	9,948.16	1.40%	-
华泰证券	1	148,086,376.77	15.82%	88,852.57	12.50%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	23,595,455.10	2.52%	18,876.94	2.65%	-
申万宏源	2	108,929,568.91	11.64%	87,143.82	12.26%	-
兴业证券	1	618,462.53	0.07%	494.77	0.07%	-
银河证券	2	32,119,570.46	3.43%	25,695.66	3.61%	-
招商证券	2	176,365,243.57	18.84%	141,092.19	19.84%	-
中信建投	1	150,989,179.29	16.13%	120,791.78	16.99%	-
中信证券	2	66,332,821.57	7.09%	44,901.95	6.31%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。安信证券股份有限公司更名为国投证券股份有限公司。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	260,036,986.00	13.08%	924,000,000.00	5.68%	-	-
东方财富	412,476,316.45	20.75%	2,647,000,000.00	16.26%	-	-
方正证券	46,021,078.81	2.32%	1,714,000,000.00	10.53%	-	-
国泰君安	73,368,086.51	3.69%	124,000,000.00	0.76%	-	-
国投证券	26,917,924.36	1.35%	-	-	-	-
国信证券	47,393,125.40	2.38%	235,000,000.00	1.44%	-	-
海通证券	5,803,144.08	0.29%	499,000,000.00	3.07%	-	-
华泰证券	192,223,031.75	9.67%	413,000,000.00	2.54%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	20,563,569.96	1.03%	40,000,000.00	0.25%	-	-
申万宏源	387,060,884.39	19.47%	2,890,000,000.00	17.76%	-	-
兴业证券	40,157,732.67	2.02%	2,654,000,000.00	16.31%	-	-
银河证券	195,871,616.91	9.85%	1,688,000,000.00	10.37%	-	-
招商证券	66,119,597.75	3.33%	1,006,000,000.00	6.18%	-	-
中信建投	31,674,307.15	1.59%	160,000,000.00	0.98%	-	-
中信证券	182,013,453.23	9.16%	1,282,400,000.00	7.88%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2023-01-20
2	易方达安盈回报混合型证券投资基金恢复大额申购及大额转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-21
3	易方达安盈回报混合型证券投资基金之 C 类份额开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
4	易方达基金管理有限公司关于易方达安盈回报混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同、托管协议的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	证券时报	2023-03-30
6	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2023-04-21
8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
9	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
10	易方达基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-08
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	证券时报	2023-07-20
12	易方达基金管理有限公司董事长（联席）任职公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-23
13	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-23
14	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	证券时报	2023-08-30
15	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	证券时报	2023-10-25

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日