

易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基 金（LOF）

2020 年第 4 季度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十一日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 19 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 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达 3 年封闭战略配售混合（LOF）
场内简称	易基配售
基金主代码	161131
交易代码	161131
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 7 月 5 日
报告期末基金份额总额	24,459,604,026.99 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭运作期内主要采用战略配售和固定收益两种投资策略。1、战略配售股票投资策略本基金主要投资通过战略配售取得的股票。本基金将积极关注、深入分析并论证战略配售股票的投资机

会，通过综合分析行业景气度、行业竞争格局、公司基本面、公司治理状况、公司估值水平、公司业务持续性和盈利确定性等多方面因素，并结合市场未来走势等判断，精选战略配售股票。在战略配售股票锁定期结束后，本基金将根据对证券内在投资价值 and 成长性的判断，结合市场环境分析，选择适当的时机卖出。

2、存托凭证投资策略。本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

3、固定收益证券投资策略

(1) 债券投资策略在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。在券种选择上，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，实施积极主动的债券投资管理。随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁，更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，谋求高于市场平均水平的投资回报。

(2) 银行存款、同业存单投资策略本基金根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平，并据此制定和调整资产配置策略。当银行存款、同业存单投资具有较高投资价值时，本基金将积极关注银行存款、同业存单的投资

	机会并进行合理配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，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。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 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
	(2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	312,448,828.16
2.本期利润	778,457,508.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0318
4.期末基金资产净值	27,797,707,929.84
5.期末基金份额净值	1.1365

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④

		准差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去三个月	2.89%	0.17%	8.57%	0.59%	-5.68%	-0.42%
过去六个月	4.66%	0.29%	14.69%	0.79%	-10.03%	-0.50%
过去一年	4.29%	0.31%	16.26%	0.84%	-11.97%	-0.53%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	13.65%	0.23%	34.50%	0.81%	-20.85%	-0.58%

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

易方达 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 7 月 5 日至 2020 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 13.65%，同期业绩比较基准收益率为 34.50%。

§ 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		
付浩	本基金的基金经理、权益投资管理部总经理、权益投资决策委员会委员	2018-07-05	-	23年	硕士研究生,具有基金从业资格。曾任广东粤财信托投资有限公司国际金融部职员,深圳和君创业研究咨询有限公司管理咨询项目经理,湖南证券投资银行总部项目经理,融通基金管理有限公司研究策划部研究员,易方达基金管理有限公司权益投资总部副总经理、养老金与专户权益投资部副总经理、公募基金投资部总经理、基金经理助理、投资经理、易方达策略成长证券投资基金基金经理、科瑞证券投资基金基金经理、易方达科翔股票型证券投资基金基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
胡剑	本基金的基金经理、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证	2018-07-05	-	14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债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债1年定期开放债券型证券

	券投资基金的基金经理、易方达恒利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、固定收益投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员				投资基金基金经理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达丰惠混合型证券投资基金基金经理。
纪玲云	本基金的基金经理、易方达恒裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒盛 3 个月定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、固定收益分类资产研究管理部负责人	2018-07-05	-	11 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固定收益研究员、投资经理助理、固定收益研究部总经理助理、投资经理。

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,“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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 32 次，均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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

经济基本面在四季度延续了复苏的趋势。工业增加值增速在 9-11 月份进一步上升至 7% 附近，体现出生产端的恢复力度较强。从需求方来看，基建投资表现较为平稳，房地产投资维持了偏高的增速，制造业投资则持续大幅回升，表现出加快复苏的势头。汽车、餐饮、服装等终端需求持续恢复，零售数据在四季度也加速回升，成为拉动经济增长的重要力量。出口数据则继续保持较高水平，体现出旺盛的海外需求与国内快速恢复的供给形成了较好的良性互动。

通胀方面，CPI 和 PPI 数据持续在低位，反映经济虽然快速恢复但仍在潜在产出之下，这使得货币政策迅速收紧的必要性不强。融资方面，社融和信贷规模高位维持，整体收缩较为缓慢，且非金融企业和居民的中长期贷款同比多增保持在较高的水平，显示经济内生增长的融资需求较强。

债券市场方面, 收益率快速上行的动力有所减弱。市场的主要矛盾从经济恢复、央行货币政策收紧切换到永煤违约带来的对国企、城投信用风险的担忧, 信用利差尤其是中低等级级别利差出现快速上行。受此影响, 央行调整了货币政策态度, 从中性偏紧转为宽松, 相应地, 债券市场出现一波明显的陡峭化下行行情。收益率整体表现为先上后下, 10 年国债整体下行 1BP, 3 年 AAA 品种下行 19BP, 但是 3 年 AA 上行 34BP。

权益市场在四季度维持振荡上行走势。整个季度来看, 沪深 300 指数上涨 13.49%, 创业板指上涨 15.72%。行业上基本延续了前期的分化走势, 有色金属、电气设备、食品饮料、家用电器等行业涨幅较高, 达到 20-30%; 商业贸易、传媒、通信、计算机等行业表现较差, 整个季度下跌 7-10%。

操作上, 组合在债券方面维持了中短端、高流动性资产为主的配置思路, 以存单为主的配置, 在给组合提供流动性的同时获取安全的票息收益, 较好地规避了债券市场的久期风险和信用风险。权益投资方面, 报告期内, 我们持续调整组合, 买入受非经营因素影响导致股价低估的个股, 相应减持一些股价已经反应基本面的股票。同时, 我们坚持一直以来的投资理念, 寻找“简单、独特、可持续”的优质股票, 在拥有安全边际的前提下买入, 中长期持有, 争取为持有人获取更大收益。

4.5 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 1.1365 元, 本报告期份额净值增长率为 2.89%, 同期业绩比较基准收益率为 8.57%。

§ 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	6,506,677,603.46	23.40
	其中: 股票	6,506,677,603.46	23.40
2	固定收益投资	20,708,815,400.00	74.49
	其中: 债券	20,708,815,400.00	74.49

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	332,994,819.49	1.20
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,576,518.27	0.01
7	其他资产	251,132,693.24	0.90
8	合计	27,802,197,034.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	2,478,578,025.98	8.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	628,403,637.36	2.26
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,180.84	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	644,945,595.64	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,727,432.23	0.05
J	金融业	2,240,085,047.21	8.06
K	房地产业	142,146,414.16	0.51
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	357,589,158.00	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	124,850.77	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	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	6,506,677,603.46	23.41

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	601658	邮储银行	461,009,000	2,203,623,020.00	7.93
2	601816	京沪高铁	114,754,098	644,918,030.76	2.32
3	000333	美的集团	5,381,116	529,717,059.04	1.91
4	003816	中国广核	175,272,460	494,268,337.20	1.78
5	000651	格力电器	6,322,443	391,612,119.42	1.41
6	600519	贵州茅台	183,538	366,708,924.00	1.32
7	603259	药明康德	2,652,317	357,320,146.24	1.29
8	600887	伊利股份	6,479,994	287,517,333.78	1.03
9	000858	五粮液	714,000	208,380,900.00	0.75
10	000538	云南白药	1,613,444	183,287,238.40	0.66

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,119,250,000.00	4.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,624,582,000.00	13.04
	其中：政策性金融债	3,624,582,000.00	13.04
4	企业债券	1,698,468,400.00	6.11
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,292,510,000.00	8.25
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	11,974,005,000.00	43.08
9	其他	-	-
10	合计	20,708,815,400.00	74.50

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

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	180212	18 国开 12	18,600,000	1,875,996,000.00	6.75
2	112003083	20 农业银行 CD083	10,000,000	986,800,000.00	3.55
3	112008169	20 中信银行 CD169	10,000,000	986,700,000.00	3.55
4	112006065	20 交通银行 CD065	10,000,000	979,900,000.00	3.53
5	112004019	20 中国银行 CD019	10,000,000	979,600,000.00	3.52

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投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2020 年 3 月 9 日, 中国银行保险监督管理委员会对中国邮政储蓄银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 50 万元的行政处罚决定: 可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、未传递或缺失可回溯视频资料、质检不合格业务占比较高。2020 年 4 月 20 日, 中国银行保险监督管理委员会对中国邮政储蓄银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 190 万元的行政处罚决定: 邮储银行监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在 (一) 资金交易

信息漏报严重；（二）贷款核销业务漏报或错报；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）错报总账会计数据；（七）关键且应报字段漏报或填报错误。

2020年1月19日，国家税务总局北京市海淀区税务局对中国农业银行股份有限公司未按照规定期限办理纳税申报和报送纳税资料的违法违规事实，作出罚款50万元的行政处罚决定。2020年3月9日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款50万元的行政处罚决定：可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、部分可回溯视频质检结果未反馈给保险公司、可回溯资料不符合监管规定。2020年4月22日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款230万元的行政处罚决定：农业银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送（一）资金交易信息漏报严重；（二）信贷资产转让业务漏报；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。2020年4月22日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款200万元的行政处罚决定：（一）“两会一层”境外机构管理履职不到位；（二）国别风险管理不满足监管要求；（三）信贷资金被挪用作保证金；（四）未将集团成员纳入集团客户统一授信管理。2020年7月13日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得55.3万元，罚款5260.3万元，罚没合计5315.6万元”的行政处罚决定：（一）向关系人发放信用贷款；（二）批量处置不良资产未公告；（三）批量处置不良资产未向监管部门报告；（四）违规转让正常类贷款；（五）个人住房贷款首付比例违规；（六）流动资金贷款被用于固定资产投资；（七）超过实际需求发放流动资金贷款；（八）贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发；（九）贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；（十）承兑业务贸易背景审查不严；（十一）保理业务授权管理不到位；（十二）贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人；（十三）贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金；（十四）信贷资金用于兑付到期理财产品；（十五）信贷资金用于承接承销债券；（十六）销售非保本理财产品违规出具承诺函；（十七）提供与事实不符的报告；（十八）理财产品相互交易、相互调节

收益；(十九) 面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资；(二十) 将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款；(二十一) 开立同业银行结算账户不合规；(二十二) 个别人员未经核准即履行高管人员职责；(二十三) 对小微企业不当收费；(二十四) 未按规定报送案件。2020 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元”的行政处罚决定：农业银行收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）。2020 年 2 月 20 日，北京银保监局对中信银行股份有限公司的如下违法违规行为，作出“责令中信银行股份有限公司改正，并给予合计 2020 万元罚款”的行政处罚决定：中信银行股份有限公司违规发放土地储备贷款；受托支付不符合监管规定；信托消费贷款业务开展不审慎；流动资金贷款被挪用于股权投资；信贷资金被挪用流入房地产开发公司；个人经营性贷款资金被挪用于购房；非真实转让不良信贷资产；未对融资人交易材料合理性进行必要的审查，资金被用于缴纳土地竞买保证金；违规为房地产开发企业发放流动资金性质融资；签署抽屉协议互投涉房信贷资产腾挪信贷规模；卖出回购信贷资产收益权，实现信贷规模阶段性出表；理财资金违规投向未上市房地产企业股权；理财资金被挪用于支付土地出让价款；违规向资本金不足的房地产开发项目提供融资；并购贷款真实性审核不足，借款人变相用于置换项目公司缴纳的土地出让价款；协助合作机构签署抽屉协议，规避相关监管规定；理财资金实际用于置换项目前期股东支付的土地出让金；违规为房地产企业支付土地购置费用提供融资；违规向四证不全的商业性房地产开发项目提供融资。2020 年 4 月 20 日，中国银行保险监督管理委员会对中信银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 160 万元的行政处罚决定：中信银行监管标准化数据 (EAST) 系统数据质量及数据报送存在 (一) 理财产品数量漏报；(二) 信贷资产转让业务漏报；(三) 贸易融资业务漏报；(四) 分户账明细记录应报未报；(五) 分户账账户数据应报未报；(六) 关键且应报字段漏报或填报错误。

2020 年 4 月 20 日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司如下违法违规行为作出“罚款 260 万元”的行政处罚：交通银行监管标准化数据

（EAST）系统数据质量及数据报送存在（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）信贷业务担保合同漏报；（五）分户账明细记录应报未报；（六）分户账账户数据应报未报；（七）关键且应报字段漏报或填报错误。2020 年 7 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对交通银行股份有限公司太平洋信用卡中心的如下违法违规行作出“责令改正，并处罚款共计 100 万元”的行政处罚：1. 2019 年 6 月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2. 2019 年 5 月、7 月，该中心对部分信用卡催收外包管理严重不审慎。2020 年 8 月 6 日，上海市黄浦区城市管理行政执法局对交通银行太平洋信用卡中心上海分中心占用城市道路的行为罚款 300 元。

2020 年 4 月 20 日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 270 万元的行政处罚决定：中国银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。2020 年 12 月 1 日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司“原油宝”产品风险事件中的如下违法违规行为作出罚款 5050 万元的行政处罚决定：产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。

2020 年 2 月 10 日，中国人民银行对中国光大银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款 1820 万元”的行政处罚决定：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；3. 未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；4. 与身份不明的客户进行交易。2020 年 4 月 20 日，中国银行保险监督管理委员会对中国光大银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款 160 万元”的行政处罚决定：光大银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量

及数据报送（一）分户账明细记录应报未报；（二）关键且应报字段漏报或填报错误；（三）向检查组提供与事实不符的材料；（四）账户设置不能如实反映业务实际。

2020年4月30日，北京市西城区卫生健康委员会对中国农业发展银行违反《北京市生活饮用水卫生监督管理条例》第二十一条第（三）项的行为作出“罚款5000元”的行政处罚决定。

本基金投资邮储银行、20农业银行CD083、20中信银行CD169、20交通银行CD065、20中国银行CD019、20光大银行CD276、18农发09、20农业银行CD093的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除邮储银行、20农业银行CD083、20中信银行CD169、20交通银行CD065、20中国银行CD019、20光大银行CD276、18农发09、20农业银行CD093外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	330,469.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	250,802,224.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	251,132,693.24

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	601816	京沪高铁	644,918,030.76	2.32	新股战略 配售流通 受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	24,459,604,026.99
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	24,459,604,026.99

§ 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持有本基金份额。

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申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）注册的文件；
- 2.《易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托

管协议》;

4.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 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。

8.3 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

二〇二一年一月二十一日