

# 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）

## 2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 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：二〇二一年四月十九日

## § 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 4 月 16 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 2021 年 1 月 1 日起至 3 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	24,459,867,362.51 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
	(2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	324,928,974.02
2.本期利润	600,523,035.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0246
4.期末基金资产净值	28,398,532,391.39
5.期末基金份额净值	1.1610

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	2.16%	0.34%	-1.96%	0.96%	4.12%	-0.62%
过去六个月	5.11%	0.26%	6.35%	0.80%	-1.24%	-0.54%
过去一年	8.33%	0.28%	21.02%	0.79%	-12.69%	-0.51%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.10%	0.24%	31.51%	0.82%	-15.41%	-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2021年3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 16.10%，同期业绩比较基准收益率为 31.51%。

## § 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	-	24 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	-	15 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、易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金经理、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	-	12 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 3 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 1-2 月份延续了 2020 年底的复苏势头。工业增加值高速增长，制造业是主要动力。需求面，基建投资小幅回落，房地产销售和投资均保持较高水平，零售端受到就地过年影响而有所走弱。出口拉动作用较为明显。通胀方面保持平稳，但是消费端受服务业影响依然偏弱，中上游价格保持强劲增长，价格分化较大。社融数据 2 月份表现较好，降低了央行过度紧缩的担忧。

从政策面来看，虽然中国央行转向相对较早，但是目前尚未有进一步收紧的动作。体现在资金面上表现为资金利率波动加大，但中枢稳定；在信用层面上，社融数据收缩相对平稳。总量紧缩政策相对温和，但是针对房地产和地方政府债务的结构性政策相对偏紧。这两方面收缩力度如果较大，可能对经济上行的幅度构成一些负面影响。

债券市场方面，基本面走势对收益率的影响不大，收益率变化主要跟随资金面的变化。资金利率水平变化较大。2020 年 12 月中旬至 2021 年 1 月中旬央行保持了偏低的利率水平带动市场收益率下行，1 月下旬之后跟随央行态度变化，资金面极度收紧，带动曲线出现明显的熊平行行情，这波调整直至 2 月份春节前，资金面持续保持宽松，收益率重新下行。信用债券方面，2 年以内品种表现相对较好，信用债券级别利差有所收窄。

权益市场在一季度先扬后抑，波动较大。年初至 2 月中旬，沪深 300 指数一度上涨超过 10%，后续逐步下跌，最终一季度下跌 3.13%，创业板指下跌 7%。行业钢铁、公用事业、银行、休闲服务等行业涨幅靠前，上涨 10-15%；国防军工、非银金融、通信、计算机等行业表现较差，跌幅达到 10-20%。中证转债指数下跌 0.4%，结构上偏债型和平衡型个券品种表现相对较好。

操作上，组合保持了偏短的久期和偏低的仓位，积极改善组合持仓流动性，为后续封闭期结束做好准备。权益投资方面，随着基金三年封闭期临近，我们不断调整组合的仓位和结构，买入一些中长期看好，短期股价回撤较大的个股，减持一些近期因为市场波动，股价快速反应基本面的股票。我们坚持一直的投资理念，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 1.1610 元，本报告期份额净值增长率为 2.16%，同期业绩比较基准收益率为-1.96%。

## § 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	4,944,199,828.45	17.41
	其中：股票	4,944,199,828.45	17.41
2	固定收益投资	20,314,438,869.44	71.52
	其中：债券	20,314,438,869.44	71.52

	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	2,853,985,091.97	10.05
	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	4,388,056.25	0.02
7	其他资产	286,708,475.14	1.01
8	合计	28,403,720,321.25	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	20,453,534.22	0.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,391,894,540.69	8.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,290,052.76	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,254.06	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	466,012,098.30	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,113,421.77	0.00
J	金融业	1,669,066,090.93	5.88
K	房地产业	10,200.30	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	372,181,406.60	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	158,228.82	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	4,944,199,828.45	17.41

### 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	283,124,500	1,661,940,815.00	5.85
2	000333	美的集团	6,396,516	525,985,510.68	1.85
3	601816	京沪高铁	79,659,198	466,006,308.30	1.64
4	000651	格力电器	6,322,443	396,417,176.10	1.40
5	603259	药明康德	2,652,317	371,854,843.40	1.31
6	600519	贵州茅台	183,538	368,727,842.00	1.30
7	600887	伊利股份	6,479,994	259,394,159.82	0.91
8	000858	五粮液	829,800	222,369,804.00	0.78
9	002415	海康威视	3,426,100	191,518,990.00	0.67
10	000538	云南白药	1,532,744	184,710,979.44	0.65

### 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	1,119,902,000.00	3.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,614,425,000.00	12.73
	其中：政策性金融债	3,614,425,000.00	12.73
4	企业债券	1,366,611,869.44	4.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,241,935,000.00	7.89
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	11,971,565,000.00	42.16
9	其他	-	-
10	合计	20,314,438,869.44	71.53

**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	1,869,858,000.00	6.58
2	11200606 5	20 交通银 行 CD065	10,000,000	982,200,000.00	3.46
3	11200401 9	20 中国银 行 CD019	10,000,000	981,600,000.00	3.46
4	11210908 1	21 浦发银 行 CD081	10,000,000	978,400,000.00	3.45
5	11201727 6	20 光大银 行 CD276	10,000,000	977,900,000.00	3.44

**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 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 12 月 25 日, 中国银行保险监

督管理委员会针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 4550 万元的行政处罚决定：1、同业投资业务接受第三方金融机构信用担保；2、买入返售项下的金融资产不符合监管规定；3、信贷资产收益权转让业务接受交易对手兜底承诺；4、同业投资按照穿透原则对应至最终债务人未纳入统一授信管理；5、个别产业基金同业投资业务违规投向股权；6、同业投资投前调查不尽职；7、资金违规支付股票定向增发款；8、同业投资资金（通过置换方式）违规投向“四证”不全的房地产项目；9、债务性资金用作固定资产投资项目资本金；10、资金违规通过融资平台公司为地方政府融资；11、未进行资金投向风险审查和合规性审查；12、理财投资收益未及时确认为收入；13、部分分行为非保本理财产品出具保本承诺；14、出具与事实不符的理财投资清单；15、投资权益类资产的理财产品违规面向一般个人客户销售；16、理财投资接受第三方银行信用担保；17、代客理财资金用于本行自营业，未实现风险隔离；18、理财产品相互交易，未实现风险隔离；19、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易人为调节收益；20、理财风险准备金用于期限错配引发的应收未收利息垫款；21、使用非代客资金为理财产品垫款；22、未在理财产品存续期内披露非标资产风险状况发生实质性变化的信息；23、未按照《保险兼业代理协议》约定收取代销手续费；24、债券承销与投资业务未建立“防火墙”制度；25、部分重要岗位人员未按照规定期限轮岗；26、未按规定披露代销产品信息。

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为作出“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8月10日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款共计2100万元”的行政处罚：1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款；4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6. 个人消费贷款贷后管理未尽职；7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模；8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；9. 办理无真实贸易背景的贴现业务；10. 委托贷款资金来源审查未尽职；11. 未按权限和程序办理委托贷款业务；12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务。2020年11月26日，国家外汇管理局上海市分局对上海浦东发展银行股份有限公司如下违法违规行为罚款140万元人民币：1、违反公正、公平、诚信原则，违规开展外汇市场交易。2、违反银行交易记录管理规定。

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 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违反银行交易记录管理规定的行为，处 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。2020 年 10 月 20 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中国光大银行股份有限公司违规开展外汇交易的行为，处 60 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

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 8 月 25 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中信银行的如下违法违规行为作出“给予警告，没收违法所得 14857527.66 元人民币，并处 1177.04 万元人民币罚款”的行政处罚决定：违规办理内保外贷业务；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金收付；违反规定办理售汇业务；违反外汇账户管理规定。2020 年 11 月 26 日，国家外汇管理局北京外汇管理部对中信银行违反规定办理售汇业务的行为，没收违法所得 661782.53 元人民币，并处 40 万元人民币罚款。2021 年 2 月 5 日，中国人民银行对中信银行的如下违法违规行为罚款 2890 万元：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。2021 年 3 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对中信银行的如下违法违规行为罚款 450 万元：一、客户信息保护体制机制不健全；柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务操作流程与必要的内部控制措施，乱象整治自查不力；二、客户信息收集环节管理不规范；客户数据访问控制管理不符合业务“必须知道”和“最小授权”原则；查询客户账户明细事由不真实；未经客户本人授权查询并向第三方提供其个人银行账户交易信息；三、对客户敏感信息管理不善，致其流出至互联网；违规存储客户敏感信息；四、系统权限管理存在漏洞，重要岗位及外包机构管理

存在缺陷。

2020 年 8 月 21 日, 中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司资金营运中心的如下违法违规行为作出“责令改正, 并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定: 2017 年 7 月至 2019 年 6 月, 该中心黄金租赁业务严重违反审慎经营规则。2020 年 8 月 31 日, 中国银保监会福建监管局对兴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 6,361,807.97 元, 并合计处以罚款 15,961,807.97 元”的行政处罚决定: 同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。2020 年 9 月 4 日, 中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“给予警告, 没收违法所得 10,875,088.15 元, 并处 13,824,431.23 元罚款”的行政处罚决定: 1. 为无证机构提供转接清算服务, 且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定; 2. 为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务, 且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性; 3. 违规连通上、下游支付机构, 提供转接清算服务, 且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性; 4. 违反银行卡收单外包管理规定; 5. 未按规定履行客户身份识别义务。2020 年 10 月 22 日, 中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正, 并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定: 信用卡授信审批严重违反审慎经营规则。

本基金投资邮储银行、20 交通银行 CD065、20 中国银行 CD019、21 浦发银行 CD081、20 光大银行 CD276、21 中信银行 CD062、21 兴业银行 CD136、21 光大银行 CD066 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除邮储银行、20 交通银行 CD065、20 中国银行 CD019、21 浦发银行 CD081、20 光大银行 CD276、21 中信银行 CD062、21 兴业银行 CD136、21 光大银行 CD066 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	670,198.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	286,038,277.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	286,708,475.14

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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	263,335.52
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	24,459,867,362.51

## § 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

二〇二一年四月十九日