易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：杭州银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 2 月 2 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 17
6.1 资产负债表 17
6.2 利润表 18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 19
6.4 报表附注 20
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
7.3 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 45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49
7.6 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 50
7.7 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 50
7.8 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 50
7.9 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 51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51
7.12 投资组合报告附注 51

§8 基金份额持有人信息 52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 52
§9 开放式基金份额变动 53
§10 重大事件揭示 53
10.1 基金份额持有人大会决议 53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 53
10.4 基金投资策略的改变 53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 54
10.8 其他重大事件 55
§11 影响投资者决策的其他重要信息 56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 56
§12 备查文件目录 56
12.1 备查文件目录 56
12.2 存放地点 56
12.3 查阅方式 57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达瑞康混合	
基金主代码	011086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 2 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	杭州银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	841,885,764.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞康混合 A	易方达瑞康混合 C
下属分级基金的交易代码	011086	011087
报告期末下属分级基金的份额总额	631,956,259.59 份	209,929,504.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	1、本基金将综合考虑宏观经济环境、政策形势、市场估值与流动性等因素，对股票市场、债券市场等证券市场内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，确定组合中股票、债券、货币市场工具的比例。本基金的股票投资比例主要依据股票基准指数整体估值水平在过去十年中的分位值排位进行相应调整，力争控制下行风险。2、在股票投资方面，本基金主要以行业配置策略（通过对行业景气度等因素的分析，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例）和个股投资策略进行投资组合的构建与调整。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。3、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。4、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。5、本基金可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上，选择投资价值较高的资产支持证券进行投资。6、本基金将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货、股票期权合约进行交易，以对冲投资组合的风险。
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率×60%+沪深 300 指数收益率×35%+中证港股通综合指数收益率×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，高于债券型基金和货币市场基金。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投

	资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。

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	杭州银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	陈凯伦
	联系电话	020-85102688	0571-87253683
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	chenkailun@hzbank.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95398
传真		020-38798812	0571-86475525
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室－42891（集中办公区）	杭州市庆春路46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	杭州市庆春路46号杭州银行大厦13楼资产托管部
邮政编码		510620	310003
法定代表人		刘晓艳	陈震山

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日）	
	易方达瑞康混合 A	易方达瑞康混合 C
本期已实现收益	11,700,829.59	4,117,458.17
本期利润	7,975,545.14	1,244,032.06
加权平均基金份额本期利润	0.0141	0.0056
本期加权平均净值利润率	1.43%	0.56%
本期基金份额净值增长率	0.62%	0.54%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2021 年 6 月 30 日)**	
	易方达瑞康混合 A	易方达瑞康混合 C
期末可供分配利润	3,944,465.64	1,143,756.05
期末可供分配基金份额利润	0.0062	0.0054
期末基金资产净值	635,900,725.23	211,073,261.04
期末基金份额净值	1.0062	1.0054
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2021 年 6 月 30 日)**	
	易方达瑞康混合 A	易方达瑞康混合 C
基金份额累计净值增长率	0.62%	0.54%

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.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.本基金合同于 2021 年 2 月 2 日生效，合同生效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

易方达瑞康混合 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

过去一个月	1.28%	0.15%	-0.60%	0.31%	1.88%	-0.16%
过去三个月	2.93%	0.15%	2.05%	0.37%	0.88%	-0.22%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.62%	0.21%	-0.06%	0.50%	0.68%	-0.29%

易方达瑞康混合 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
过去一个月	1.26%	0.15%	-0.60%	0.31%	1.86%	-0.16%
过去三个月	2.88%	0.15%	2.05%	0.37%	0.83%	-0.22%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.54%	0.21%	-0.06%	0.50%	0.60%	-0.29%

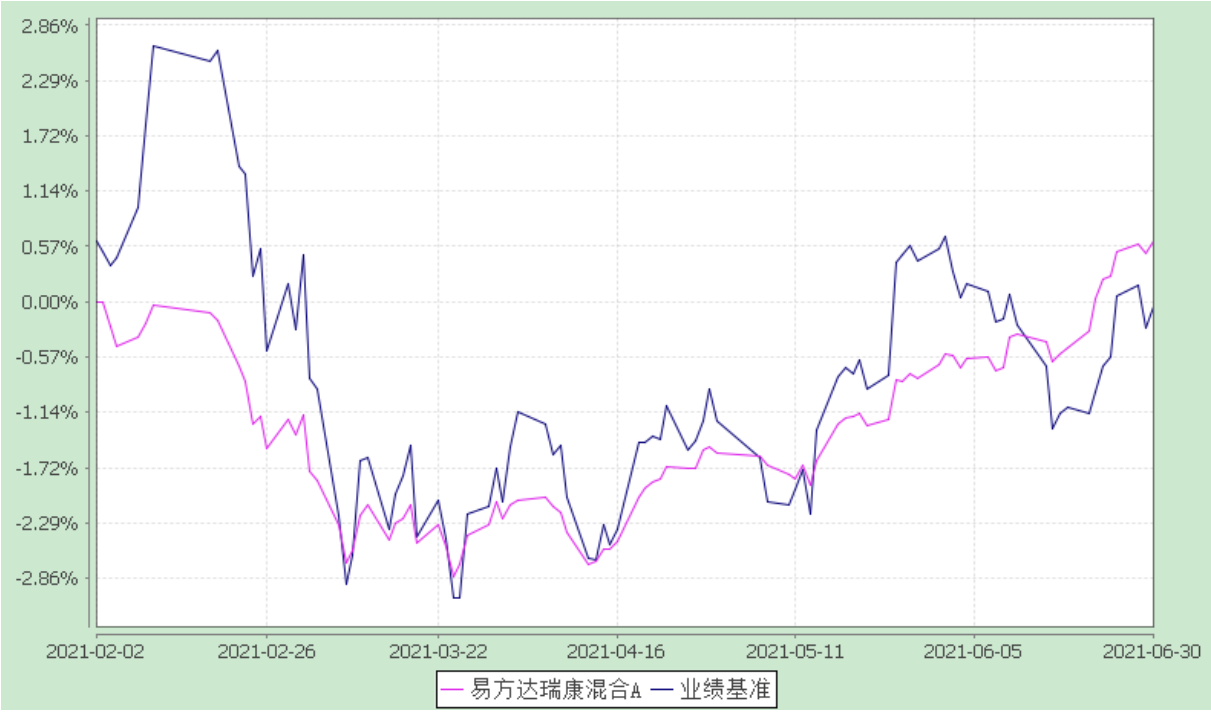
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金

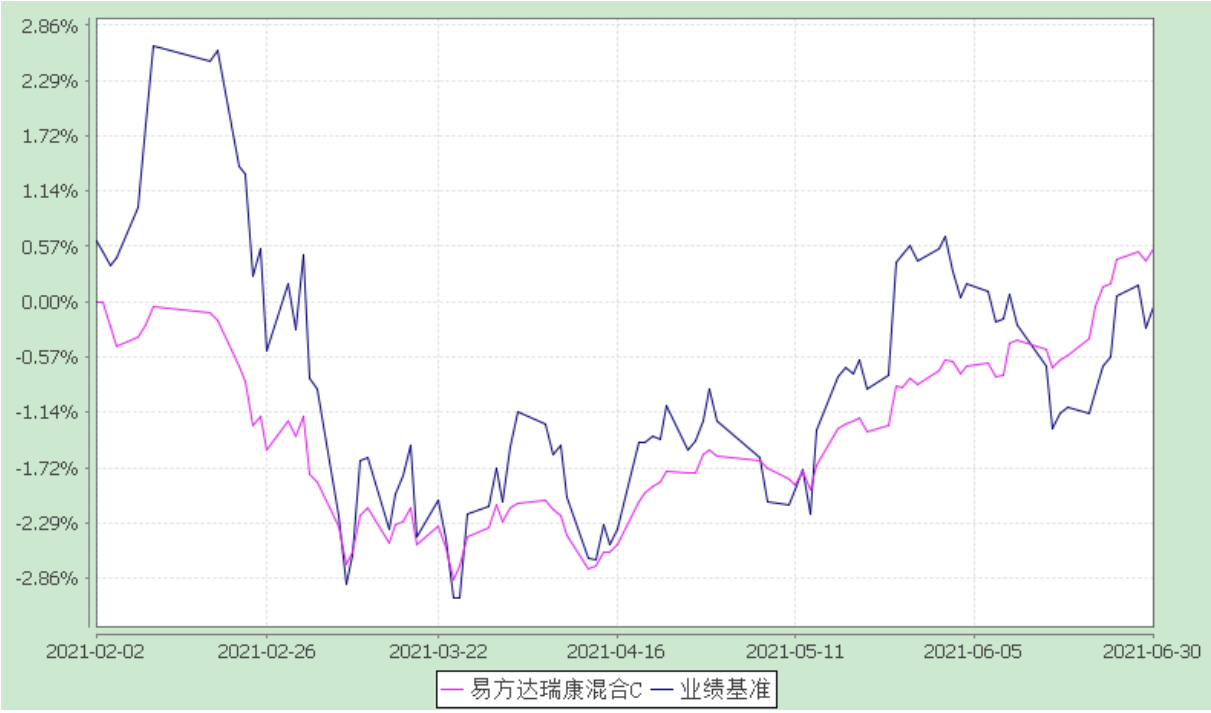
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2021 年 2 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日）

易方达瑞康混合 A



易方达瑞康混合 C



注：1.本基金合同于 2021 年 2 月 2 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 0.62%，C 类基金份额净值增长率为 0.54%，同期业绩比较基准收益率为-0.06%。

§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		
杨康	本基金的基金经理、易方达瑞安灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达瑞锦灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 07 月 31 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 07 月 31 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 10 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达安盈回报混合型证券投资基	2021-02-02	-	6 年	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。

	金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐恒九个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦通一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦弘一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达宁易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理				
周琼	本基金的基金经理助理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达富财	2021-02-05	-	7 年	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。

	纯债债券型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 10 月 11 日至 2021 年 06 月 15 日）、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达丰惠混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞锦灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达磐恒九个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐固六个月持有期混合型证				

	券投资基金的基金经理助理、易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦通一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞安灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦弘一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达宁易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦信一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理				

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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。本基金管理人规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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 15 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 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

2021 年上半年，债券市场先跌后涨，收益率整体大致呈倒“V”型走势。春节前夕，随着央行在节前并未放松流动性，市场一致预期被打乱，叠加春节后大宗商品价格上涨引发的经济强劲预期和通胀加息担忧，债券市场处于熊市格局，收益率逐步上行。随后，权益市场的下跌引发市场对未来经济和通胀持续性的担忧，避险情绪升温，引领利率债走出了一波收益率下行行情。进入二季度，由于央行的货币政策始终未如大家所预期的那般开始收紧，且机构普遍杠杆也相对较低，在美债强势下行和央行继续释放出较为明确的流动性维稳信号的情况下，债市收益率继续持续下行直到半年末。整体来看，债市上半年大部分时间处于震荡下行格局，10 年期国债收益率较去年底有 6BP 左右的下行。

权益市场方面，指数在上半年呈现宽幅波动态势，春节是 A 股市场的重要分水岭。春节前，“核心资产”标的延续了近几年的强势趋势，继续受到资金追捧，市场分化更加极致。而后，以原油为代表的大宗商品价格显著走强引发了较强的通胀预期，由此带来的名义利率上行对全球权益市场整体估值水平都构成了显著压力。美债长端利率的超预期上行，也引发了 A 股机构重仓股的大幅回调，市场风格回归平衡。进入二季度，在流动性的超预期宽松下，核心资产整体迎来了较为显著的估值修复。随后从 5 月初开始，在市场情绪和基本面预期的共同推动下，以新能源、半导体、军工、医美等为代表的基本面高增长板块，取得了显著的超额收益。市场风格出现了由从周期转向成长的切换，并把这一趋势一直持续到了半年末。整体来看，在宏观流动性持续宽裕、国内经济稳中趋缓的背景下，市场整体表现良好，指数持续上行。

上半年本基金大类资产配置基本稳定，在一季度建仓之后，在绝对收益的操作思路下，权益敞口总体来看处于偏低水平，控制组合波动、追求风险调整后的较好收益。债券方面整体以杠杆票息策略的偏绝对收益操作思路为主。权益部分均衡配置高分红、低波动、估值较低的个股和估值合理、

质地较好、成长性上乘的优质个股，仓位维持低位。此外，组合仍积极参与科创板和创业板注册制下的网下询价打新。

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 1.0062 元，本报告期份额净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准收益率为-0.06%；C 类基金份额净值为 1.0054 元，本报告期份额净值增长率为 0.54%，同期业绩比较基准收益率为-0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观策略方面，外需向上和内需向下的格局可能将会主导下半年的经济走势。上半年地方债发行节奏明显放缓，国内财政政策的逐步退出拖累了内需，但考虑到资本开支回升以及库存偏低，国内总体经济维持平稳。海外来看，在疫苗接种推进、财政政策刺激以及房地产市场繁荣的背景下，美国经济未来一段时间将会实现强劲增长，而全球需求恢复大概率将支持中国出口维持高景气。

展望下半年，权益市场机会或大于债券市场，流动性充裕环境下仍利于权益市场的估值修复。在企业盈利还在回升的环境下，考虑到整体估值中性，我们对股票市场并不悲观，但指数级别的行情，可能还要受制于内外部货币环境的扰动所带来的估值压力，关注结构性机会。债市方面，在见到经济周期顶点前，债券市场资本利得的机会仍需观察。现阶段利率水平依然处于偏低水平，未来收益率可能以震荡行情为主，但短端流动性保持平稳，债券市场仍然可以获得票息和杠杆的机会。

本基金纯债部分仍将以中高等级信用债为主，保持一定的杠杆水平，降低信用风险暴露，以获取票息收益和债券结构性机会为主；权益部分将继续根据市场情况，维持偏低仓位，优化个股持仓。同时保持组合的灵活性，根据市场变化及时调仓，控制组合波动、追求风险调整后的较好收益。此外组合仍会积极参与科创板和创业板注册制下的网下询价打新。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达瑞康混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达瑞康混合 C:本报告期内未实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，杭州银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	1,025,584.40
结算备付金		23,049,788.64
存出保证金		312,613.09
交易性金融资产	6.4.7.2	1,057,192,379.99
其中：股票投资		144,383,314.68
基金投资		-
债券投资		882,781,065.31
资产支持证券投资		30,028,000.00
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		1,214,690.60
应收利息	6.4.7.5	15,172,423.05
应收股利		-
应收申购款		2,226.74
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,097,969,706.51
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 6 月 30 日**
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		245,000,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		5,348,002.86
应付管理人报酬		418,256.92
应付托管费		69,709.51
应付销售服务费		35,802.40
应付交易费用	6.4.7.7	18,829.32

应交税费		77,463.41
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	27,655.82
负债合计		250,995,720.24
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	841,885,764.58
未分配利润	6.4.7.10	5,088,221.69
所有者权益合计		846,973,986.27
负债和所有者权益总计		1,097,969,706.51

注：1.本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，2021 年半年度实际报告期间为 2021 年 2 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0062 元，C 类基金份额净值 1.0054 元；基金份额总额 841,885,764.58 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 631,956,259.59 份，C 类基金份额总额 209,929,504.99 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		**12,989,813.58**
1.利息收入		10,900,921.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	137,961.82
债券利息收入		10,573,753.28
资产支持证券利息收入		130,793.86
买入返售金融资产收入		58,412.96
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,637,216.40
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,687,720.00
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-60,598.87
资产支持证券投资收益		-

贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,010,095.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-6,598,710.56
4.汇兑收益（损失以“—”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	50,385.82
减：二、费用		**3,770,236.38**
1．管理人报酬		1,892,885.61
2．托管费		315,481.01
3．销售服务费		178,285.99
4．交易费用	6.4.7.18	164,135.81
5．利息支出		1,154,826.06
其中：卖出回购金融资产支出		1,154,826.06
6．税金及附加		37,375.08
7．其他费用	6.4.7.19	27,246.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**9,219,577.20**
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**9,219,577.20**

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，2021 年半年度实际报告期间为 2021 年 2 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	347,891,330.81	-	347,891,330.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,219,577.20	9,219,577.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	493,994,433.77	-4,131,355.51	489,863,078.26

其中：1.基金申购款	525,269,987.55	-4,523,393.98	520,746,593.57
2.基金赎回款	-31,275,553.78	392,038.47	-30,883,515.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	841,885,764.58	5,088,221.69	846,973,986.27

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 2 日，2021 年半年度实际报告期间为 2021 年 2 月 2 日至 2021 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达瑞康灵活配置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[2020]3489 号《关于准予易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《易方达瑞康灵活配置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，《易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 347,891,330.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 66.24 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，基金托管人为杭州银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2021 年 1 月 26 日至 2021 年 1 月 29 日，募集金额总额为人民币 347,891,330.81 元，其中：有效净认购金额为人民币 347,891,264.57 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 66.24 元，经安永华明（2021）验字第 60468000_G15 号验资报告予以审验。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 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。

6.4.4.1 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，惟本会计年度期间为 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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

持有的其他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。

6.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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，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。

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。

6.4.4.5 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）存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，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将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。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。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。

6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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)。

6.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债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利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除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利息收入。

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确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除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确认为利息收入，将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投资收益。

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也可按直线法计算。

6.4.4.10 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。

其他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按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）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；

（3）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；

（4）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；

（5）在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；

（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018

年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,025,584.40
定期存款	-
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	-
合计	1,025,584.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	150,953,669.62	144,383,314.68	-6,570,354.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	802,626,564.76	802,423,065.31	-203,499.45
	银行间市场	80,210,856.17	80,358,000.00	147,143.83
	合计	882,837,420.93	882,781,065.31	-56,355.62
资产支持证券		30,000,000.00	30,028,000.00	28,000.00
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,063,791,090.55	1,057,192,379.99	-6,598,710.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	506.36
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	9,335.16
应收债券利息	15,027,737.09
应收资产支持证券利息	134,717.81
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	126.63
合计	15,172,423.05

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	18,029.32
银行间市场应付交易费用	800.00

合计	18,829.32

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	809.00
应付证券出借违约金	-
预提费用	26,846.82
合计	27,655.82

6.4.7.9 实收基金

易方达瑞康混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	145,202,763.14	145,202,763.14
本期申购	492,533,829.84	492,533,829.84
本期赎回（以“-”号填列）	-5,780,333.39	-5,780,333.39
本期末	631,956,259.59	631,956,259.59

易方达瑞康混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	202,688,567.67	202,688,567.67
本期申购	32,736,157.71	32,736,157.71
本期赎回（以“-”号填列）	-25,495,220.39	-25,495,220.39
本期末	209,929,504.99	209,929,504.99

注：1.本基金合同于 2021 年 2 月 2 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 347,891,330.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 66.24 份基金份额。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

易方达瑞康混合 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	11,700,829.59	-3,725,284.45	7,975,545.14
本期基金份额交易产生的变动数	511,268.54	-4,542,348.04	-4,031,079.50
其中：基金申购款	527,577.52	-4,647,682.18	-4,120,104.66
基金赎回款	-16,308.98	105,334.14	89,025.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,212,098.13	-8,267,632.49	3,944,465.64

易方达瑞康混合 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,117,458.17	-2,873,426.11	1,244,032.06
本期基金份额交易产生的变动数	-226,272.07	125,996.06	-100,276.01
其中：基金申购款	53,519.10	-456,808.42	-403,289.32
基金赎回款	-279,791.17	582,804.48	303,013.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,891,186.10	-2,747,430.05	1,143,756.05

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	70,162.04
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	66,250.44
其他	1,549.34
合计	137,961.82

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	20,455,558.98
减：卖出股票成本总额	12,767,838.98
买卖股票差价收入	7,687,720.00

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	64,073,690.42
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	63,120,998.87
减：应收利息总额	1,013,290.42
买卖债券差价收入	-60,598.87

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,010,095.27
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	1,010,095.27

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-6,598,710.56
——股票投资	-6,570,354.94
——债券投资	-56,355.62
——资产支持证券投资	28,000.00
——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	-6,598,710.56

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日

基金赎回费收入	39,225.03
其他	11,160.79
合计	50,385.82

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	163,485.81
银行间市场交易费用	650.00
合计	164,135.81

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	26,846.82
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	27,246.82

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
杭州银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,892,885.61
其中：支付销售机构的客户维护费	41,641.61

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	315,481.01

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对

无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞康混合 A	易方达瑞康混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	102,355.03	102,355.03
合计	-	102,355.03	102,355.03

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 0.20%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.20%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	易方达瑞康混合 A	易方达瑞康混合 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 2 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	150,692,184.05	-
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	150,692,184.05	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	23.8454%	-

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 02 日。基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达瑞康混合 A

无。

易方达瑞康混合 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年2月2日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
杭州银行-活期存款	1,025,584.40	70,162.04

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 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	605090	九丰能源	新股网下发行	1,090	37,681.30

注：报告期内本基金参与了九丰能源首次公开发行的申购，此次发行的分销商广发证券股份有

限公司为本基金管理人的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达瑞康混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达瑞康混合 C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

				受限						
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
30102	英诺	2021-0	2021-0	新股	9.46	9.46	2,609	24,681	24,681	-

1	激光	6-28	7-06	流通受限				.14	.14	
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688076	诺泰生物	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688113	联测科技	2021-04-26	2021-11-08	新股流通受限	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688217	睿昂基因	2021-05-07	2021-11-17	新股流通受限	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	2,380	237,997.91	237,997.91	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
136221	荟享064A	2021-06-29	2021-07-22	新发流通	100.00	100.00	100,000	10,000,000.0	10,000,000.0	-

				受限				0	0	

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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 245,000,000.00 元，于 2021 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、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，理论上其风险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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 104.40%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	43,735,772.61
合计	43,735,772.61

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末

	2021年6月30日
AAA	826,335,773.50
AAA 以下	27,737,256.29
未评级	0.00
合计	854,073,029.79

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	30,162,717.81
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	30,162,717.81

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,025,584.40	-	-	-	1,025,584.40
结算备付金	23,049,788.64	-	-	-	23,049,788.64
存出保证金	312,613.09	-	-	-	312,613.09
交易性金融资产	221,144,490.00	691,155,000.00	509,575.31	144,383,314.68	1,057,192,379.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,214,690.60	1,214,690.60
应收利息	-	-	-	15,172,423.05	15,172,423.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,226.74	2,226.74
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	245,532,476.13	691,155,000.00	509,575.31	160,772,655.07	1,097,969,706.51
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	245,000,000.00	-	-	-	245,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,348,002.86	5,348,002.86
应付管理人报酬	-	-	-	418,256.92	418,256.92
应付托管费	-	-	-	69,709.51	69,709.51
应付销售服务费	-	-	-	35,802.40	35,802.40
应付交易费用	-	-	-	18,829.32	18,829.32
应交税费	-	-	-	77,463.41	77,463.41
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	27,655.82	27,655.82
负债总计	245,000,000.00	-	-	5,995,720.24	250,995,720.24
利率敏感度缺口	532,476.13	691,155,000.00	509,575.31	154,776,934.83	846,973,986.27

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2021 年 6 月 30 日
	1.市场利率下降 25 个基点	3,322,511.28
	2.市场利率上升 25 个基点	-3,310,043.63

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	144,383,314.68	17.05
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	144,383,314.68	17.05

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021 年 6 月 30 日
	1.业绩比较基准上升 5%	17,494,979.78
	2.业绩比较基准下降 5%	-17,494,979.78

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为 138,905,356.82 元，属于第二层次的余额为 918,287,023.17 元，无属于第三层次的余额。

(ii)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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	144,383,314.68	13.15
	其中：股票	144,383,314.68	13.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	912,809,065.31	83.14
	其中：债券	882,781,065.31	80.40
	资产支持证券	30,028,000.00	2.73
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	24,075,373.04	2.19

	计		
8	其他各项资产	16,701,953.48	1.52
9	合计	1,097,969,706.51	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	5,439.50	0.00
B	采矿业	3,718,037.00	0.44
C	制造业	87,943,794.66	10.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,965,945.21	1.65
E	建筑业	1,793,766.37	0.21
F	批发和零售业	73,523.22	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,531,203.00	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,931,472.40	0.23
J	金融业	18,775,802.70	2.22
K	房地产业	9,393,694.00	1.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,446,891.60	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	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	1,790,460.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	144,383,314.68	17.05

7.3 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	600900	长江电力	337,500	6,966,000.00	0.82
2	603806	福斯特	59,640	6,269,953.20	0.74
3	601012	隆基股份	67,620	6,007,360.80	0.71
4	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.61
5	601818	光大银行	1,306,600	4,938,948.00	0.58
6	688516	奥特维	33,251	4,921,148.00	0.58
7	002250	联化科技	152,100	4,243,590.00	0.50
8	000651	格力电器	72,900	3,798,090.00	0.45
9	600885	宏发股份	57,900	3,630,330.00	0.43
10	000001	平安银行	147,500	3,336,450.00	0.39
11	600036	招商银行	60,300	3,267,657.00	0.39
12	300558	贝达药业	30,000	3,247,200.00	0.38
13	600486	扬农化工	28,887	3,228,699.99	0.38
14	000002	万科 A	134,800	3,209,588.00	0.38
15	000858	五粮液	10,200	3,038,478.00	0.36
16	300132	青松股份	143,500	3,027,850.00	0.36
17	600426	华鲁恒升	97,370	3,013,601.50	0.36
18	002311	海大集团	35,400	2,888,640.00	0.34
19	002597	金禾实业	81,600	2,831,520.00	0.33
20	600585	海螺水泥	67,000	2,750,350.00	0.32
21	601899	紫金矿业	282,100	2,733,549.00	0.32
22	002142	宁波银行	68,900	2,685,033.00	0.32
23	600309	万华化学	24,000	2,611,680.00	0.31
24	002078	太阳纸业	189,000	2,523,150.00	0.30
25	002080	中材科技	95,200	2,491,384.00	0.29
26	600048	保利地产	202,400	2,436,896.00	0.29
27	002938	鹏鼎控股	63,600	2,281,968.00	0.27
28	300059	东方财富	60,840	1,994,943.60	0.24
29	600104	上汽集团	90,700	1,992,679.00	0.24
30	603416	信捷电气	31,100	1,973,917.00	0.23
31	000961	中南建设	330,000	1,953,600.00	0.23
32	002241	歌尔股份	44,200	1,889,108.00	0.22
33	600674	川投能源	149,900	1,848,267.00	0.22
34	001979	招商蛇口	163,800	1,793,610.00	0.21
35	300413	芒果超媒	26,100	1,790,460.00	0.21
36	601668	中国建筑	380,300	1,768,395.00	0.21
37	002475	立讯精密	38,400	1,766,400.00	0.21
38	002601	龙蟒佰利	49,700	1,718,626.00	0.20
39	000581	威孚高科	78,500	1,635,155.00	0.19
40	001965	招商公路	226,400	1,634,608.00	0.19
41	600919	江苏银行	228,700	1,623,770.00	0.19
42	600741	华域汽车	57,000	1,497,390.00	0.18

43	603259	药明康德	9,240	1,446,891.60	0.17
44	601233	桐昆股份	57,600	1,387,584.00	0.16
45	600588	用友网络	39,200	1,303,792.00	0.15
46	000333	美的集团	17,200	1,227,564.00	0.14
47	002352	顺丰控股	16,100	1,089,970.00	0.13
48	600276	恒瑞医药	15,720	1,068,488.40	0.13
49	000568	泸州老窖	4,500	1,061,730.00	0.13
50	000786	北新建材	26,400	1,036,200.00	0.12
51	600031	三一重工	34,300	997,101.00	0.12
52	600028	中国石化	225,800	984,488.00	0.12
53	601688	华泰证券	56,600	894,280.00	0.11
54	002236	大华股份	40,900	862,990.00	0.10
55	600519	贵州茅台	400	822,680.00	0.10
56	000661	长春高新	2,100	812,700.00	0.10
57	600066	宇通客车	64,800	809,352.00	0.10
58	000429	粤高速 A	112,500	806,625.00	0.10
59	600346	恒力石化	28,900	758,336.00	0.09
60	600570	恒生电子	6,600	615,450.00	0.07
61	000157	中联重科	58,300	538,692.00	0.06
62	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.04
63	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.03
64	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.02
65	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
66	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.01
67	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.01
68	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.01
69	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
70	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
71	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
72	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
73	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
74	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
75	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
76	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
77	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
78	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
79	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
80	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
81	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
82	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
83	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
84	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
85	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
86	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00

87	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
88	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
89	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
90	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
91	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
92	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
93	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
94	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
95	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
96	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
97	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	6,705,604.00	0.79
2	603806	福斯特	5,013,592.00	0.59
3	601818	光大银行	5,002,120.00	0.59
4	601012	隆基股份	4,935,136.00	0.58
5	600486	扬农化工	4,497,740.76	0.53
6	000651	格力电器	4,489,362.00	0.53
7	300558	贝达药业	4,081,691.22	0.48
8	000002	万科 A	4,073,615.00	0.48
9	002597	金禾实业	3,928,429.00	0.46
10	002250	联化科技	3,732,562.00	0.44
11	600885	宏发股份	3,630,441.00	0.43
12	600585	海螺水泥	3,591,717.00	0.42
13	000001	平安银行	3,531,423.00	0.42
14	600426	华鲁恒升	3,508,476.00	0.41
15	002078	太阳纸业	3,479,580.00	0.41
16	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.41
17	601799	星宇股份	3,325,319.00	0.39
18	600036	招商银行	3,305,474.00	0.39
19	000858	五粮液	3,283,990.00	0.39
20	600309	万华化学	3,266,533.00	0.39

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601799	星宇股份	3,302,977.00	0.39
2	600905	三峡能源	2,700,165.61	0.32
3	603035	常熟汽饰	1,605,932.00	0.19
4	688538	和辉光电	1,258,223.19	0.15
5	688608	恒玄科技	1,112,806.80	0.13
6	688425	铁建重工	1,091,932.22	0.13
7	002242	九阳股份	928,668.00	0.11
8	002714	牧原股份	797,053.00	0.09
9	300979	华利集团	778,187.40	0.09
10	688660	电气风电	571,730.42	0.07
11	688690	纳微科技	312,052.90	0.04
12	300997	欢乐家	258,532.31	0.03
13	688575	亚辉龙	231,349.26	0.03
14	301009	可靠股份	195,670.30	0.02
15	688601	力芯微	189,375.00	0.02
16	688345	博力威	188,910.52	0.02
17	301002	崧盛股份	181,852.48	0.02
18	688383	新益昌	179,616.50	0.02
19	688621	阳光诺和	168,111.78	0.02
20	301015	百洋医药	164,677.32	0.02

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。

7.4.3 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	163,721,508.60
卖出股票收入（成交）总额	20,455,558.98

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。

7.5 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	3,502,050.00	0.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,004,000.00	4.72

	其中：政策性金融债	40,004,000.00	4.72
4	企业债券	798,411,440.00	94.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,354,000.00	4.76
7	可转债（可交换债）	509,575.31	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	882,781,065.31	104.23

7.6 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	149283	20 中海 03	400,000	40,048,000.00	4.73
2	210206	21 国开 06	400,000	40,004,000.00	4.72
3	149084	20 海康 01	350,000	34,881,000.00	4.12
4	143520	18 金地 01	300,000	31,074,000.00	3.67
5	143734	18 金隅 02	300,000	31,005,000.00	3.66

7.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	189103	首置 02 优	200,000	20,028,000.00	2.36
2	136221	荟享 064A	100,000	10,000,000.00	1.18

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	312,613.09
2	应收证券清算款	1,214,690.60
3	应收股利	-
4	应收利息	15,172,423.05
5	应收申购款	2,226.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,701,953.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.61	新股流通受限

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
易方达瑞康混合 A	330	1,915,018.97	624,547,284.96	98.83%	7,408,974.63	1.17%
易方达瑞康混合 C	144	1,457,843.78	205,373,595.22	97.83%	4,555,909.77	2.17%
合计	474	1,776,130.31	829,920,880.18	98.58%	11,964,884.40	1.42%

8.2 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	易方达瑞康混合 A	2,030,332.40	0.3213%
	易方达瑞康混合 C	0.00	0.0000%
	合计	2,030,332.40	0.2412%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	易方达瑞康混合 A	0
	易方达瑞康混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	易方达瑞康混合 A	0

放式基金	易方达瑞康混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达瑞康混合 A	易方达瑞康混合 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 2 日）基金份额总额	145,202,763.14	202,688,567.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	492,533,829.84	32,736,157.71
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	5,780,333.39	25,495,220.39
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	631,956,259.59	209,929,504.99

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 02 日。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和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。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	176,382,558.47	100.00%	111,350.29	100.00%	-

注：a) 本报告期内新增交易单元的证券公司为中信证券股份有限公司。

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服务；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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
中信证券	855,390,617.93	100.00%	13,586,100,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-03
2	易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 2 月 9 日至 2 月 10 日暂停申购、赎回及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
3	易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
4	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-05
5	易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 4 月 2 日至 4 月 6 日暂停申购、赎回及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-30
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
7	易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 4 月 29 日至 4 月 30 日暂停申购、赎回及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-26
8	易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 5 月 19 日暂停申购、赎回及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-14
9	易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 7 月 1 日暂停申购、赎回及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-28

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021 年 02 月 08 日~2021 年 03 月 02 日	-	150,692,184.05	-	150,692,184.05	17.90%
	2	2021 年 02 月 02 日~2021 年 02 月 07 日	100,000,000.00	-	-	100,000,000.00	11.88%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续五十个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

§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瑞康灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；

2、《易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《易方达瑞康灵活配置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

二〇二一年八月二十八日