

易方达悦盈一年持有期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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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 3 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 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 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合规守信情况的说明 | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 14 |
| 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 | 15 |
| 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 | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 17 |
| §5 托管人报告 | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 17 |
| 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 | 17 |
| 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 | 17 |
| §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 | 19 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 20 |
| 6.4 报表附注 | 21 |
| §7 投资组合报告 | 47 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 47 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 48 |
| 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 | 49 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 51 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 52 |
| 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 | 53 |
| 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 | 53 |
| 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 | 53 |
| 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 | 53 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 53 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 54 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 54 |

| | |
|--|----|
| §8 基金份额持有人信息..... | 57 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 57 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 57 |
| 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..... | 58 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 58 |
| §10 重大事件揭示..... | 58 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 58 |
| 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..... | 59 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 59 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 59 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 59 |
| 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..... | 59 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 59 |
| 10.8 其他重大事件..... | 60 |
| §11 备查文件目录..... | 61 |
| 11.1 备查文件目录..... | 61 |
| 11.2 存放地点..... | 61 |
| 11.3 查阅方式..... | 61 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|------------------|
| 基金名称 | 易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 易方达悦盈一年持有混合 | |
| 基金主代码 | 011302 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 2 月 3 日 | |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,042,907,854.28 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达悦盈一年持有混合 A | 易方达悦盈一年持有混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 011302 | 011303 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,908,173,321.47 份 | 134,734,532.81 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、可交换债券进行投资；本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。3、本基金将在行业分析、公司基本面分析及估值水平分析的基础上，进行股票组合的构建。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。4、本基金将根据风险管理的原则，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等。 |
| 业绩比较基准 | 中债新综合指数（财富）收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率×2% |
| 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 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张南 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 020-85102688 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400 881 8088 | 95568 |
| 传真 | | 020-38798812 | 010-58560798 |
| 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） | 北京市西城区复兴门内大街2 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2 号 |
| 邮政编码 | | 510620 | 100031 |
| 法定代表人 | | 刘晓艳 | 高迎欣 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 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3日(基金合同生效日)至2021 年6月30日) |
|---------------|--|

| | 易方达悦盈一年持有混合 A | 易方达悦盈一年持有混合 C |
|----------------------|-------------------------|----------------|
| 本期已实现收益 | 43,741,996.89 | 1,289,328.65 |
| 本期利润 | 51,282,592.25 | 1,548,266.21 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0131 | 0.0115 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.31% | 1.15% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.31% | 1.15% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日) | |
| | 易方达悦盈一年持有混合 A | 易方达悦盈一年持有混合 C |
| 期末可供分配利润 | 43,741,996.89 | 1,289,328.65 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0112 | 0.0096 |
| 期末基金资产净值 | 3,959,455,913.72 | 136,282,799.02 |
| 期末基金份额净值 | 1.0131 | 1.0115 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2021年6月30日) | |
| | 易方达悦盈一年持有混合 A | 易方达悦盈一年持有混合 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.31% | 1.15% |

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 3 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

易方达悦盈一年持有混合 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 | 0.48% | 0.08% | 0.01% | 0.08% | 0.47% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.65% | 0.07% | 1.42% | 0.09% | 0.23% | -0.02% |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生 | 1.31% | 0.07% | 1.22% | 0.12% | 0.09% | -0.05% |

| 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 | 0.44% | 0.08% | 0.01% | 0.08% | 0.43% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.55% | 0.07% | 1.42% | 0.09% | 0.13% | -0.02% |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 1.15% | 0.08% | 1.22% | 0.12% | -0.07% | -0.04% |

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

易方达悦盈一年持有期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3日至2021年6月30日)

易方达悦盈一年持有混合 A



易方达悦盈一年持有混合 C



注：1.本基金合同于2021年2月3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1.31%，C类基金份额净值增长率为1.15%，同期业绩比较基准收益率为1.22%。

§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 | | |
|----|--|------------|------|------|---|
| 王成 | 本基金的基金经理、易方达悦夏一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达悦信一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达悦弘一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理、多资产养老金投资部副总经理 | 2021-02-03 | - | 13 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任安信证券股份有限公司交易员、投资经理，易方达基金管理有限公司年金投资部总经理助理。 |
| 林虎 | 本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、易方达裕祥回报债券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 | 2021-02-05 | - | 9 年 | 博士研究生，具有基金从业资格。曾任宏源证券研究所固定收益分析师，国信证券研究所宏观分析师。 |
| 杨康 | 本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、易方达鑫转招利混合型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、易方达瑞锦灵活配置混合型发起式证券投资基金的基 | 2021-02-05 | - | 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。 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| <p>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、易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、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、易方达安盈回报混合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、易方达丰华债券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（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）、易方达裕丰回报债券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（自 2019 年 10 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达丰和债券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</p> | | | | |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|----|---|------------|---|-----|--|
| | 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、易方达悦弘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、易方达安心回报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、易方达裕鑫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、易方达富财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)、易方达丰华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、易方达纯债债券型证券投资基金的基 | 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。 |

| | | | | |
|---|--|--|--|--|
| <p>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、易方达瑞智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、易方达新享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、易方达瑞康灵活配置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</p> | | | | |
|---|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| 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 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，债券市场整体以窄幅震荡为主，无风险利率变化不大，但信用利差收窄，结构性机会较多。春节前资金面超预期收紧，叠加节后大宗商品价格上涨引发经济强劲增长预期和通胀加息担忧，债券市场收益率快速上行。随后权益市场调整导致市场风险偏好下降，避险情绪升温，同时银行间流动性持续宽松，推动收益率小幅缓慢下行。进入二季度，债券一级供给节奏不及预期，机构久期和杠杆普遍偏低，“资产荒”使得机构的配置需求较为旺盛。在央行继续释放出较为明确的流动性维稳信号、二季度经济数据开始呈现增长边际动能放缓的背景下，债市情绪较为乐观，配置需求推动收益率缓慢下行至半年末。整体来看，上半年债券收益率先上后下，1 年和 10 年期国债收益率分别较去年底下行 4bp 和 6bp，信用利差和流动性溢价持续压缩。

权益市场方面，在宏观流动性持续宽裕、国内经济稳中趋缓的背景下，市场整体表现较好，指数震荡上行，但市场内部结构显著分化。春节前，以消费等为代表的“核心资产”延续了近几年的强势趋势，节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股票估值都构成了显著压力，市场整体回调，市场的分化有所收敛。进入二季度，在流动性的超预期宽松下，前期调整幅度较大的“核心资产”走出了一轮估值修复行情。5 月初开始，市场关注点逐步从流动性切换到企业盈利和未来成长性，基本面高增长板块取得了显著的超额收益。市场风格开始向成长切换。

报告期内，本基金规模保持稳定。权益方面，随安全垫积累逐步将股票仓位提升至中性水平，行业较为均衡。债券方面，久期和杠杆水平提升至中性，持仓同业存单与高等级信用债以获取票息收益，同时择机参与利率债波段操作。

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 1.0131 元，本报告期份额净值增长率为 1.31%，同期业绩比较基准收益率为 1.22%；C 类基金份额净值为 1.0115 元，本报告期份额净值增长率为 1.15%，同期业绩比较基准收益率为 1.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年下半年经济运行面临较大的不确定性。首先是来自于出口对于经济的支撑能否继续。2020 年三季度开始，海外需求恢复叠加中国产业链优势，中国出口快速回升，这也带动相关产业链条维持较高增速，是支撑经济景气的重要力量。往后看，随着疫情影响的降低，发达国家的经济复苏更

多集中于不可贸易的服务消费上，这对于全球经济外溢效应的影响需要持续观察；同时随着发展中国家供给能力的修复，中国出口份额也会受到挤压，这也会对出口产生不利的影响。其次是政策节奏和力度也会影响下半年经济走势。2021 年上半年地方债发行节奏放缓、融资增速下滑，国内政策支持力度明显退坡对于部分国内需求产生了抑制，这也是导致总量层面出现经济动能放缓的重要原因。下半年如果外需存在压力，国内政策可能会重新转向稳增长。

整体来看，外需的相对强势给经济结构调整带来了空间，我们认为下半年经济大概率仍处于预期调控的区间范围之内，政策会根据内外需情况灵活调整，经济失速风险不大。事实上，如果出口保持稳定，政策对于经济的拖累边际降低以及偏紧的产能下投资需求扩张，经济在下半年还可能面临一定的上行风险。

资产配置上，企业盈利稳定，疫情反复影响下流动性并未大幅收紧，权益市场单边下跌的风险并不大，关注个股及行业的结构性机会。债市方面，短期经济动能放缓有利于债券市场，但是综合考虑当前经济状况和估值水平，趋势性资本利得机会仍需观察，仍以关注票息机会为主。

本基金债券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，优化个股持仓。实际投资中注重平衡组合的风险收益，不做过度极端偏离和操作，努力在控制组合回撤的前提下，以优异的业绩回报基金持有人。

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

易方达悦盈一年持有混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达悦盈一年持有混合 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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、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方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、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：易方达悦盈一年持有期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 | 3,045,482.90 |
| 结算备付金 | | 10,896,818.25 |
| 存出保证金 | | 721,663.15 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 4,931,774,377.23 |
| 其中：股票投资 | | 458,788,583.87 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 4,434,560,793.36 |
| 资产支持证券投资 | | 38,425,000.00 |
| 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 | | 44,864,073.42 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 53,939,022.46 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - |
| 资产总计 | | 5,045,241,437.41 |
| 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 | | 942,500,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 3,877,549.67 |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 2,011,335.49 |
| 应付托管费 | | 502,833.85 |
| 应付销售服务费 | | 44,624.49 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 253,905.16 |
| 应交税费 | | 285,729.45 |
| 应付利息 | | - |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 26,746.56 |
| 负债合计 | | 949,502,724.67 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 4,042,907,854.28 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 52,830,858.46 |
| 所有者权益合计 | | 4,095,738,712.74 |
| 负债和所有者权益总计 | | 5,045,241,437.41 |

注：1.本基金合同生效日为 2021 年 2 月 3 日，2021 年半年度实际报告期间为 2021 年 2 月 3 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 1.0131 元，C 类基金份额净值 1.0115 元；基金份额总额 4,042,907,854.28 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 3,908,173,321.47 份，C 类基金份额总额 134,734,532.81 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 3 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 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 68,324,061.97 |
| 1.利息收入 | | 48,368,353.54 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 420,447.09 |
| 债券利息收入 | | 39,626,884.84 |
| 资产支持证券利息收入 | | 105,845.13 |
| 买入返售金融资产收入 | | 8,215,176.48 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 12,155,819.89 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 9,497,335.35 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 1,177,997.88 |
| 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 | 1,480,486.66 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 7,799,532.92 |
| 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 | 355.62 |
| 减：二、费用 | | 15,493,203.51 |
| 1. 管理人报酬 | | 9,786,057.28 |
| 2. 托管费 | | 2,446,514.29 |
| 3. 销售服务费 | | 217,252.56 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 478,691.23 |

| | | |
|----------------------------|----------|----------------------|
| 5. 利息支出 | | 2,408,288.99 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,408,288.99 |
| 6. 税金及附加 | | 115,406.57 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 40,992.59 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 52,830,858.46 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 52,830,858.46 |

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 3 日，2021 年半年度实际报告期间为 2021 年 2 月 3 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：易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 3 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 3 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） | 4,042,907,854.28 | - | 4,042,907,854.28 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 52,830,858.46 | 52,830,858.46 |
| 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） | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| 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） | 4,042,907,854.28 | 52,830,858.46 | 4,095,738,712.74 |

注：本基金合同生效日为 2021 年 2 月 3 日，2021 年半年度实际报告期间为 2021 年 2 月 3 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

易方达悦盈一年持有期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[2021]29 号《关于准予易方达悦盈一年持有期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《易方达悦盈一年持有期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，《易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 2 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,042,907,854.28 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2021 年 2 月 1 日至 2021 年 2 月 1 日，募集金额总额为人民币 4,042,907,854.28 元，其中：有效净认购金额为人民币 4,042,907,854.28 元，经安永华明（2021）验字第 60468000_G13 号验资报告予以审验。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 3 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

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其

中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动

分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性

金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策

的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 | 3,045,482.90 |
| 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 | 3,045,482.90 |

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 | 454,824,628.58 | 458,788,583.87 | 3,963,955.29 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 1,664,993,197.92 | 1,662,629,793.36 |
| | 银行间市场 | 2,765,733,017.81 | 2,771,931,000.00 |
| | 合计 | 4,430,726,215.73 | 4,434,560,793.36 |
| 资产支持证券 | 38,424,000.00 | 38,425,000.00 | 1,000.00 |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 4,923,974,844.31 | 4,931,774,377.23 | 7,799,532.92 |

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 | 446.08 |
| 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 | 4,949.32 |
| 应收债券利息 | 53,859,004.75 |
| 应收资产支持证券利息 | 74,500.45 |
| 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 | 121.86 |
| 合计 | 53,939,022.46 |

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 | 227,920.82 |
| 银行间市场应付交易费用 | 25,984.34 |
| 合计 | 253,905.16 |

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 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 26,746.56 |
| 合计 | 26,746.56 |

6.4.7.9 实收基金

易方达悦盈一年持有混合 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年2月3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 | 3,908,173,321.47 | 3,908,173,321.47 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 3,908,173,321.47 | 3,908,173,321.47 |

易方达悦盈一年持有混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年2月3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 | 134,734,532.81 | 134,734,532.81 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 134,734,532.81 | 134,734,532.81 |

注：1.本基金合同于 2021 年 2 月 3 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,042,907,854.28 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

易方达悦盈一年持有混合 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 | 43,741,996.89 | 7,540,595.36 | 51,282,592.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 43,741,996.89 | 7,540,595.36 | 51,282,592.25 |

易方达悦盈一年持有混合 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 | 1,289,328.65 | 258,937.56 | 1,548,266.21 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,289,328.65 | 258,937.56 | 1,548,266.21 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30 |
|----|------------------------------------|
| | |

| | 日 |
|-----------|------------|
| 活期存款利息收入 | 177,441.28 |
| 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 | 242,086.40 |
| 其他 | 919.41 |
| 合计 | 420,447.09 |

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3日（基金合同生效日）至2021年6月30日 |
|------------|-------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 14,925,365.86 |
| 减：卖出股票成本总额 | 5,428,030.51 |
| 买卖股票差价收入 | 9,497,335.35 |

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3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 | 705,740,595.43 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 696,965,241.10 |
| 减：应收利息总额 | 7,597,356.45 |
| 买卖债券差价收入 | 1,177,997.88 |

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日 |
|----------------|-------------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 1,603,616.44 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 1,576,000.00 |
| 减：应收利息总额 | 27,616.44 |
| 资产支持证券投资收益 | - |

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3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 | 1,480,486.66 |
| 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 | 1,480,486.66 |

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3日（基金合同生效日）至2021年6月30日 |
| 1.交易性金融资产 | 7,799,532.92 |
| ——股票投资 | 3,963,955.29 |
| ——债券投资 | 3,834,577.63 |
| ——资产支持证券投资 | 1,000.00 |
| ——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 | 7,799,532.92 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------------|
| | 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | - |
| 其他 | 355.62 |
| 合计 | 355.62 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------------|
| | 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 453,191.23 |
| 银行间市场交易费用 | 25,500.00 |
| 合计 | 478,691.23 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|-------------------------------|
| | 2021年2月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日 |
| 审计费用 | 26,746.56 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 10,746.03 |
| 银行间账户维护费 | 3,000.00 |
| 其他 | 500.00 |
| 合计 | 40,992.59 |

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 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 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 |

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3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 | 9,786,057.28 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,883,273.27 |

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：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，以双方协商一致的方式在次月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中进行资金支付。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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3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 | 2,446,514.29 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，以双方协商一致的方式在次月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中进行资金支付。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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3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 | | |
| | 易方达悦盈一年持有混合 A | 易方达悦盈一年持有混合 C | 合计 |
| 易方达基金管理有限 | - | 1,059.04 | 1,059.04 |

| | | | |
|--------|---|------------|------------|
| 公司 | | | |
| 中国民生银行 | - | 216,193.52 | 216,193.52 |
| 合计 | - | 217,252.56 | 217,252.56 |

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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，以双方协商一致的方式在次月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径从基金财产中进行资金支付。

若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

易方达悦盈一年持有混合 A

无。

易方达悦盈一年持有混合 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3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 |
| 中国民生银行-活期存款 | 3,045,482.90 | 177,441.28 |

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国民生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3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

易方达悦盈一年持有混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达悦盈一年持有混合 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 | - |
| 30096 | 通业 | 2021-0 | 2021-0 | 新股 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826. | 5,396. | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 0 | 科技 | 3-22 | 9-29 | 流通受限 | | | | 72 | 04 | |
| 300961 | 深水海纳 | 2021-03-23 | 2021-09-30 | 新股流通受限 | 8.48 | 22.07 | 394 | 3,341.12 | 8,695.58 | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021-03-29 | 2021-10-11 | 新股流通受限 | 3.40 | 16.37 | 576 | 1,958.40 | 9,429.12 | - |
| 300963 | 中洲特材 | 2021-03-30 | 2021-10-11 | 新股流通受限 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |
| 300966 | 共同药业 | 2021-03-31 | 2021-10-11 | 新股流通受限 | 8.24 | 31.54 | 286 | 2,356.64 | 9,020.44 | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021-04-06 | 2021-10-15 | 新股流通受限 | 6.87 | 12.07 | 1,162 | 7,982.94 | 14,025.34 | - |
| 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 | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021-04-08 | 2021-10-15 | 新股流通受限 | 28.28 | 115.71 | 360 | 10,180.80 | 41,655.60 | - |
| 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 | 新股流通受限 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48 | - |
| 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 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股流通受限 | 9.46 | 9.46 | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2022-01-06 | 新股流通 | 9.46 | 9.46 | 290 | 2,743.40 | 2,743.40 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------------|-----------|-------|-------|---------|---------------|---------------|---|
| | | | | 受限 | | | | | | |
| 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 | - |
| 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 | - |
| 688109 | 品茗股份 | 2021-03-22 | 2021-09-30 | 新股流通受限 | 50.05 | 72.10 | 1,301 | 65,115.05 | 93,802.10 | - |
| 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 | - |
| 688345 | 博力威 | 2021-06-03 | 2021-12-13 | 新股流通受限 | 25.91 | 55.53 | 2,332 | 60,422.12 | 129,495.96 | - |
| 688639 | 华恒生物 | 2021-04-14 | 2021-10-22 | 新股流通受限 | 23.16 | 42.28 | 2,302 | 53,314.32 | 97,328.56 | - |
| 002415 | 海康威视 | 2021-03-03 | 2021-09-03 | 大宗交易流通受限 | 55.00 | 62.62 | 580,000 | 31,900,000.00 | 36,319,600.00 | - |
| 600161 | 天坛生物 | 2021-04-26 | 2021-10-25 | 非公开发行流通受限 | 28.13 | 32.87 | 355,492 | 9,999,989.96 | 11,685,022.04 | - |

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 | 8,720 | 871,992.36 | 871,992.36 | - |

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 |
|------|------|-------|------|--------|------|--------|-----------|--------|--------|----|
|------|------|-------|------|--------|------|--------|-----------|--------|--------|----|

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------|----------------|----------------|----------------|--------|--------|-------------|-----------------------|-----------------------|---|
| 13607 7 | 荟享 061A | 2021-0 6-10 | 2021-0 7-16 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 100,00 0 | 10,000 ,000.0 0 | 10,000 ,000.0 0 | - |
| 13613 5 | 荟享 062A | 2021-0 6-16 | 2021-0 7-19 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 100,00 0 | 10,000 ,000.0 0 | 10,000 ,000.0 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 942,500,000.00 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，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、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 106.52%。

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 | 20,318,109.59 |
| A-1 以下 | 0.00 |
| 未评级 | 889,285,216.97 |
| 合计 | 909,603,326.56 |

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 | 2,558,175,296.48 |
| AAA 以下 | 10,012,156.16 |
| 未评级 | 274,382,294.80 |
| 合计 | 2,842,569,747.44 |

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 | 38,499,500.45 |
| AAA 以下 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 |
| 合计 | 38,499,500.45 |

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 | 736,246,724.11 |
| AAA 以下 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 |
| 合计 | 736,246,724.11 |

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(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 | 3,045,482.90 | - | - | - | 3,045,482.90 |
| 结算备付金 | 10,896,818.25 | - | - | - | 10,896,818.25 |
| 存出保证金 | 721,663.15 | - | - | - | 721,663.15 |
| 交易性金融资产 | 2,599,521,500.00 | 1,710,044,000.00 | 163,420,293.36 | 458,788,583.87 | 4,931,774,377.23 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 44,864,073.42 | 44,864,073.42 |
| 应收利息 | - | - | - | 53,939,022.46 | 53,939,022.46 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 2,614,185,464.30 | 1,710,044,000.00 | 163,420,293.36 | 557,591,679.75 | 5,045,241,437.41 |

| | | | | | |
|-----------|------------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| | | | | | 41 |
| 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 | 942,500,000.00 | - | - | - | 942,500,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 3,877,549.67 | 3,877,549.67 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 2,011,335.49 | 2,011,335.49 |
| 应付托管费 | - | - | - | 502,833.85 | 502,833.85 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 44,624.49 | 44,624.49 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 253,905.16 | 253,905.16 |
| 应交税费 | - | - | - | 285,729.45 | 285,729.45 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 26,746.56 | 26,746.56 |
| 负债总计 | 942,500,000.00 | - | - | 7,002,724.67 | 949,502,724.67 |
| 利率敏感度缺口 | 1,671,685,464.30 | 1,710,044,000.00 | 163,420,293.36 | 550,588,955.08 | 4,095,738,712.74 |

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 | 14,718,480.80 |
| | 2.市场利率上升25个基点 | -14,578,175.31 |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | | |
|---------------|-------------------|----------------------|---------------|----------------------|
| | 美元 折合人民币 | 港币 折合人民币 | 其他币种 折合人民币 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 11,372,495.00 | - | 11,372,495.00 |
| 资产合计 | - | 11,372,495.00 | - | 11,372,495.00 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 11,372,495.00 | - | 11,372,495.00 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率外其他因素保持不变 | |
|----|--------------------|---------------------------------|
| 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 |
| | 假设人民币对一揽子货币平均升值 5% | -568,624.75 |
| | 假设人民币对一揽子货币平均贬值 5% | 568,624.75 |

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 | 458,788,583.87 | 11.20 |
| 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 | 458,788,583.87 | 11.20 |

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% | 229,394,284.75 |
| | 2.业绩比较基准下降 5% | -229,394,284.75 |

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 406,234,105.00 元，属于第二层次的余额为 4,525,540,272.23 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 | 458,788,583.87 | 9.09 |
| | 其中：股票 | 458,788,583.87 | 9.09 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,472,985,793.36 | 88.66 |
| | 其中：债券 | 4,434,560,793.36 | 87.90 |
| | 资产支持证券 | 38,425,000.00 | 0.76 |
| 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计 | 13,942,301.15 | 0.28 |
| 8 | 其他各项资产 | 99,524,759.03 | 1.97 |

| | | | |
|---|----|------------------|--------|
| 9 | 合计 | 5,045,241,437.41 | 100.00 |
|---|----|------------------|--------|

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 11,372,495.00 元，占净值比例 0.28%。

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 | - | - |
| C | 制造业 | 340,319,723.97 | 8.31 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,151,678.21 | 0.13 |
| E | 建筑业 | 25,371.37 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 73,523.22 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 106,032.50 | 0.00 |
| J | 金融业 | 46,031,440.10 | 1.12 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 29,636,223.40 | 0.72 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 21,980.60 | 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 | 13,868,036.00 | 0.34 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 12,176,640.00 | 0.30 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 447,416,088.87 | 10.92 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|------|-----------|--------------|
| 能源 | - | - |
| 材料 | - | - |

| | | |
|--------|---------------|------|
| 工业 | - | - |
| 非必需消费品 | 11,372,495.00 | 0.28 |
| 必需消费品 | - | - |
| 保健 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 11,372,495.00 | 0.28 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 601012 | 隆基股份 | 806,922 | 71,686,950.48 | 1.75 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 1,117,100 | 70,962,550.00 | 1.73 |
| 3 | 603259 | 药明康德 | 189,260 | 29,636,223.40 | 0.72 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 82,208 | 24,488,941.12 | 0.60 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 11,400 | 23,446,380.00 | 0.57 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 379,300 | 20,554,267.00 | 0.50 |
| 7 | 600486 | 扬农化工 | 181,900 | 20,330,963.00 | 0.50 |
| 8 | 600309 | 万华化学 | 180,000 | 19,587,600.00 | 0.48 |
| 9 | 603806 | 福斯特 | 153,000 | 16,084,890.00 | 0.39 |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 67,900 | 16,020,326.00 | 0.39 |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 705,600 | 15,960,672.00 | 0.39 |
| 12 | 000333 | 美的集团 | 222,600 | 15,886,962.00 | 0.39 |
| 13 | 000661 | 长春高新 | 39,900 | 15,441,300.00 | 0.38 |
| 14 | 603882 | 金域医学 | 86,800 | 13,868,036.00 | 0.34 |
| 15 | 600426 | 华鲁恒升 | 446,400 | 13,816,080.00 | 0.34 |
| 16 | 300144 | 宋城演艺 | 724,800 | 12,176,640.00 | 0.30 |
| 17 | 600161 | 天坛生物 | 355,492 | 11,685,022.04 | 0.29 |
| 18 | 00175 | 吉利汽车 | 559,000 | 11,372,495.00 | 0.28 |
| 19 | 601398 | 工商银行 | 1,834,000 | 9,481,780.00 | 0.23 |
| 20 | 002078 | 太阳纸业 | 453,200 | 6,050,220.00 | 0.15 |
| 21 | 600905 | 三峡能源 | 907,763 | 5,147,016.21 | 0.13 |
| 22 | 300628 | 亿联网络 | 53,600 | 4,491,680.00 | 0.11 |
| 23 | 002601 | 龙麟佰利 | 100,000 | 3,458,000.00 | 0.08 |
| 24 | 002597 | 金禾实业 | 91,941 | 3,190,352.70 | 0.08 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 25 | 600031 | 三一重工 | 105,000 | 3,052,350.00 | 0.07 |
| 26 | 688345 | 博力威 | 2,332 | 129,495.96 | 0.00 |
| 27 | 688639 | 华恒生物 | 2,302 | 97,328.56 | 0.00 |
| 28 | 688109 | 品茗股份 | 1,301 | 93,802.10 | 0.00 |
| 29 | 300979 | 华利集团 | 925 | 80,937.50 | 0.00 |
| 30 | 688087 | 英科再生 | 2,469 | 54,219.24 | 0.00 |
| 31 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550 | 49,173.00 | 0.00 |
| 32 | 300973 | 立高食品 | 360 | 41,655.60 | 0.00 |
| 33 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230 | 34,721.10 | 0.00 |
| 34 | 301021 | 英诺激光 | 2,899 | 27,424.54 | 0.00 |
| 35 | 001207 | 联科科技 | 682 | 22,581.02 | 0.00 |
| 36 | 301009 | 可靠股份 | 801 | 22,339.89 | 0.00 |
| 37 | 301015 | 百洋医药 | 462 | 17,939.46 | 0.00 |
| 38 | 688226 | 威腾电气 | 2,693 | 17,289.06 | 0.00 |
| 39 | 300982 | 苏文电能 | 317 | 14,356.93 | 0.00 |
| 40 | 300968 | 格林精密 | 1,162 | 14,025.34 | 0.00 |
| 41 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754 | 13,558.42 | 0.00 |
| 42 | 300614 | 百川畅银 | 329 | 13,285.02 | 0.00 |
| 43 | 603171 | 税友股份 | 637 | 12,230.40 | 0.00 |
| 44 | 300997 | 欢乐家 | 928 | 12,110.40 | 0.00 |
| 45 | 301002 | 崧盛股份 | 201 | 11,581.62 | 0.00 |
| 46 | 605287 | 德才股份 | 349 | 11,014.44 | 0.00 |
| 47 | 300962 | 中金辐照 | 576 | 9,429.12 | 0.00 |
| 48 | 301016 | 雷尔伟 | 275 | 9,069.50 | 0.00 |
| 49 | 300966 | 共同药业 | 286 | 9,020.44 | 0.00 |
| 50 | 300961 | 深水海纳 | 394 | 8,695.58 | 0.00 |
| 51 | 300986 | 志特新材 | 264 | 8,070.48 | 0.00 |
| 52 | 300978 | 东箭科技 | 593 | 8,064.80 | 0.00 |
| 53 | 300985 | 致远新能 | 295 | 7,318.95 | 0.00 |
| 54 | 300991 | 创益通 | 254 | 6,733.54 | 0.00 |
| 55 | 300975 | 商络电子 | 492 | 6,410.76 | 0.00 |
| 56 | 300963 | 中洲特材 | 283 | 6,364.67 | 0.00 |
| 57 | 300972 | 万辰生物 | 430 | 5,439.50 | 0.00 |
| 58 | 300960 | 通业科技 | 234 | 5,396.04 | 0.00 |
| 59 | 605011 | 杭州热电 | 525 | 4,662.00 | 0.00 |
| 60 | 300995 | 奇德新材 | 191 | 4,454.12 | 0.00 |
| 61 | 301007 | 德迈仕 | 303 | 4,375.32 | 0.00 |
| 62 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 63 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 64 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 65 | 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 | 601012 | 隆基股份 | 66,429,560.50 | 1.62 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 64,871,674.00 | 1.58 |
| 3 | 603259 | 药明康德 | 28,886,652.80 | 0.71 |
| 4 | 000858 | 五粮液 | 24,720,443.16 | 0.60 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 24,568,533.00 | 0.60 |
| 6 | 600486 | 扬农化工 | 21,642,669.00 | 0.53 |
| 7 | 600036 | 招商银行 | 20,723,504.00 | 0.51 |
| 8 | 600309 | 万华化学 | 20,720,474.00 | 0.51 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 18,254,806.00 | 0.45 |
| 10 | 000661 | 长春高新 | 17,882,722.32 | 0.44 |
| 11 | 000568 | 泸州老窖 | 16,691,896.00 | 0.41 |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 16,670,572.47 | 0.41 |
| 13 | 600426 | 华鲁恒升 | 14,658,981.73 | 0.36 |
| 14 | 603806 | 福斯特 | 12,507,175.40 | 0.31 |
| 15 | 603882 | 金域医学 | 12,246,157.00 | 0.30 |
| 16 | 300144 | 宋城演艺 | 12,237,877.00 | 0.30 |
| 17 | 00175 | 吉利汽车 | 11,899,747.68 | 0.29 |
| 18 | 601398 | 工商银行 | 10,048,983.00 | 0.25 |
| 19 | 600161 | 天坛生物 | 9,999,989.96 | 0.24 |
| 20 | 002078 | 太阳纸业 | 8,469,764.15 | 0.21 |

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 | 600905 | 三峡能源 | 2,578,630.60 | 0.06 |
| 2 | 688538 | 和辉光电 | 1,583,712.63 | 0.04 |
| 3 | 688425 | 铁建重工 | 1,091,941.35 | 0.03 |
| 4 | 300979 | 华利集团 | 789,418.64 | 0.02 |
| 5 | 688660 | 电气风电 | 570,829.04 | 0.01 |
| 6 | 688076 | 诺泰生物 | 388,916.35 | 0.01 |
| 7 | 688276 | 百克生物 | 382,086.84 | 0.01 |
| 8 | 688690 | 纳微科技 | 312,028.60 | 0.01 |
| 9 | 300973 | 立高食品 | 308,619.00 | 0.01 |
| 10 | 300997 | 欢乐家 | 258,427.83 | 0.01 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 11 | 300968 | 格林精密 | 244,951.02 | 0.01 |
| 12 | 688575 | 亚辉龙 | 231,372.09 | 0.01 |
| 13 | 301009 | 可靠股份 | 196,142.31 | 0.00 |
| 14 | 688601 | 力芯微 | 188,785.98 | 0.00 |
| 15 | 301002 | 崧盛股份 | 181,968.00 | 0.00 |
| 16 | 688383 | 新益昌 | 181,520.30 | 0.00 |
| 17 | 688621 | 阳光诺和 | 168,101.85 | 0.00 |
| 18 | 688626 | 翔宇医疗 | 165,770.37 | 0.00 |
| 19 | 301015 | 百洋医药 | 164,709.84 | 0.00 |
| 20 | 605499 | 东鹏饮料 | 162,858.44 | 0.00 |

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 | 460,252,659.09 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 14,925,365.86 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 162,000,000.00 | 3.96 |
| | 其中：政策性金融债 | 162,000,000.00 | 3.96 |
| 4 | 企业债券 | 1,661,209,500.00 | 40.56 |
| 5 | 企业短期融资券 | 902,483,000.00 | 22.03 |
| 6 | 中期票据 | 978,983,000.00 | 23.90 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,420,293.36 | 0.03 |
| 8 | 同业存单 | 728,465,000.00 | 17.79 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,434,560,793.36 | 108.27 |

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 | 210205 | 21 国开 05 | 1,600,000 | 162,000,000.00 | 3.96 |
| 2 | 112110101 | 21 兴业银行 CD101 | 1,500,000 | 145,665,000.00 | 3.56 |
| 3 | 112776 | 18 中海 01 | 1,000,000 | 100,370,000.00 | 2.45 |
| 4 | 012100217 | 21 粤海 SCP001 | 1,000,000 | 100,210,000.00 | 2.45 |
| 5 | 012101251 | 21 招商蛇口 SCP002 | 1,000,000 | 100,200,000.00 | 2.45 |

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 | 136077 | 荟享 061A | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.24 |
| 1 | 136135 | 荟享 062A | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.24 |
| 3 | 179148 | 至远 02A1 | 100,000 | 9,995,000.00 | 0.24 |
| 4 | 189143 | PR 元晟 A1 | 100,000 | 8,430,000.00 | 0.21 |

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 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。

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 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）。2021 年 1 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行的如下违法违规行为罚款 420 万元：（一）发生重要信息系统突发事件未报告；（二）制卡数据违规明文留存；（三）生产网络、分行无线互联网络保护不当；（四）数据安全较粗放，存在数据泄露风险；（五）网络信息系统存在较多漏洞；（六）互联网门户网站泄露敏感信息。

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 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

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。2021 年 4 月 23 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的如下违法违规行为罚款 760 万元人民币：2016 年 5 月至 2019 年 1 月，该行未按规定开展代销业务。2021 年 5 月 7 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的如下违法违规行为罚款 40 万元人民币：信用卡资金流向管控严重违反审慎经营规则。

本基金投资 21 兴业银行 CD101、20 中信银行 CD335、21 农业银行 CD031、21 交通银行 CD059、21 浦发银行 CD070、21 兴业银行 CD119 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 21 兴业银行 CD101、20 中信银行 CD335、21 农业银行 CD031、21 交通银行 CD059、21 浦发银行 CD070、21 兴业银行 CD119 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。

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 | 721,663.15 |
| 2 | 应收证券清算款 | 44,864,073.42 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 53,939,022.46 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|---------------|
| 9 | 合计 | 99,524,759.03 |
|---|----|---------------|

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 | 002415 | 海康威视 | 36,319,600.00 | 0.89 | 大宗交易流通受限 |

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东减持或者特定股东减持，采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%；前款交易的受让方在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

§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 |
| 易方达悦盈一年持有混合 A | 27,563 | 141,790.56 | 0.00 | 0.00% | 3,908,173,321.47 | 100.00% |
| 易方达悦盈一年持有混合 C | 918 | 146,769.64 | 0.00 | 0.00% | 134,734,532.81 | 100.00% |
| 合计 | 28,481 | 141,951.05 | 0.00 | 0.00% | 4,042,907,854.28 | 100.00% |

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 | 易方达悦盈一年持有混合 A | 10,008.99 | 0.0003% |

| | | | |
|--|---------------|-----------|---------|
| | 易方达悦盈一年持有混合 C | 10,000.00 | 0.0074% |
| | 合计 | 20,008.99 | 0.0005% |

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 | 易方达悦盈一年持有混合 A | 0 |
| | 易方达悦盈一年持有混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 易方达悦盈一年持有混合 A | 0 |
| | 易方达悦盈一年持有混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 易方达悦盈一年持有混合 A | 易方达悦盈一年持有混合 C |
|-------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2021 年 2 月 3 日）基金份额总额 | 3,908,173,321.47 | 134,734,532.81 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - | - |
| 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 | 3,908,173,321.47 | 134,734,532.81 |

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 03 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 | |
| 国信证券 | 2 | 456,827,983.28 | 100.00% | 365,462.97 | 100.00% | - |

注：a) 本报告期内新增交易单元的证券公司为国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、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金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 |
| 国信证券 | 1,479,805,602.70 | 100.00% | 40,245,200,000.00 | 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 | 易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-04 |
| 2 | 易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-05 |
| 3 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-02 |
| 4 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金 | 中国证券报、基金管理人 | 2021-04-28 |

| | | | |
|--|----------------------------|------------------|--|
| | 获配天坛生物（600161）非公开发行 A 股的公告 | 网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
|--|----------------------------|------------------|--|

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《易方达悦盈一年持有期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。

11.2 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。

11.3 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