

易方达科润混合型证券投资基金（LOF）
（原易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投
资基金（LOF）转型）
2021年第3季度报告

2021年9月30日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

自2021年8月3日起原易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型为易方达科润混合型证券投资基金（LOF）。原易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）本报告期自2021年7月1日至2021年8月2日止，易方达科润混合型证券投资基金（LOF）本报告期自2021年8月3日至2021年9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 易方达科润混合型证券投资基金（LOF）

基金简称	易方达科润混合（LOF）
场内简称	易方达科润LOF
基金主代码	161131
交易代码	161131
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年8月3日
报告期末基金份额总额	2,830,802,574.68份
投资目标	在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

<p>投资策略</p>	<p>本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，综合考虑国内外宏观经济环境、政策形势、市场估值与流动性等因素，对国内外证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期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、货币市场工具及其他金融工具的比例。股票投资方面，本基金将通过对行业景气度、行业竞争格局的分析，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。在行业配置的基础上，本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。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。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>沪深300指数收益率×45%+中证港股通综合指数收益率×35%+中债总指数收益率×20%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。</p> <p>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，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率</p>

	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。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

2.2 易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

基金简称	易方达3年封闭战略配售混合（LOF）
场内简称	易基配售
基金主代码	161131
交易代码	161131
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年7月5日
报告期末基金份额总额	4,045,015,729.30份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在封闭运作期内主要采用战略配售和固定收益两种投资策略。1、战略配售股票投资策略本基金主要投资通过战略配售取得的股票。本基金将积极关注、深入分析并论证战略配售股票的投资机会，通过综合分析行业景气度、行业竞争格局、公司基本面、公司治理状况、公司估值水平、公司业务持续性和盈利确定性等多方面因素，并结合市场未来走势等判断，精选战略配售股票。在战略配售股票锁定期结束后，本基金将根据对证券内在投资价值和成长性的判断，结合市场环境分析，选择适当的时机卖出。2、存托凭

	<p>证投资策略。本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。3、固定收益证券投资策略（1）债券投资策略在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。在券种选择上，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，实施积极主动的债券投资管理。随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁，更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，谋求高于市场平均水平的投资回报。（2）银行存款、同业存单投资策略本基金根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平，并据此制定和调整资产配置策略。当银行存款、同业存单投资具有较高投资价值时，本基金将积极关注银行存款、同业存单的投资机会并进行合理配置。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司

基金托管人	中国建设银行股份有限公司
-------	--------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2021年8月3日(基金合同生效日)-2021年9月30日)	报告期 (2021年7月1日-2021年8月2日)
1.本期已实现收益	-7,303,320.48	11,492,530.74
2.本期利润	-33,866,734.98	10,725,219.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0105	0.0011
4.期末基金资产净值	3,271,516,753.68	4,720,642,782.25
5.期末基金份额净值	1.1557	1.1670

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.自2021年8月3日起原易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型为易方达科润混合型证券投资基金（LOF）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 易方达科润混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2021年8月3日-2021年9月30日）

3.2.1.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增	净值增	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

	长率①	长率标准差②	较基准收益率③	较基准收益率标准差④		
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-0.97%	0.35%	-1.96%	0.83%	0.99%	-0.48%

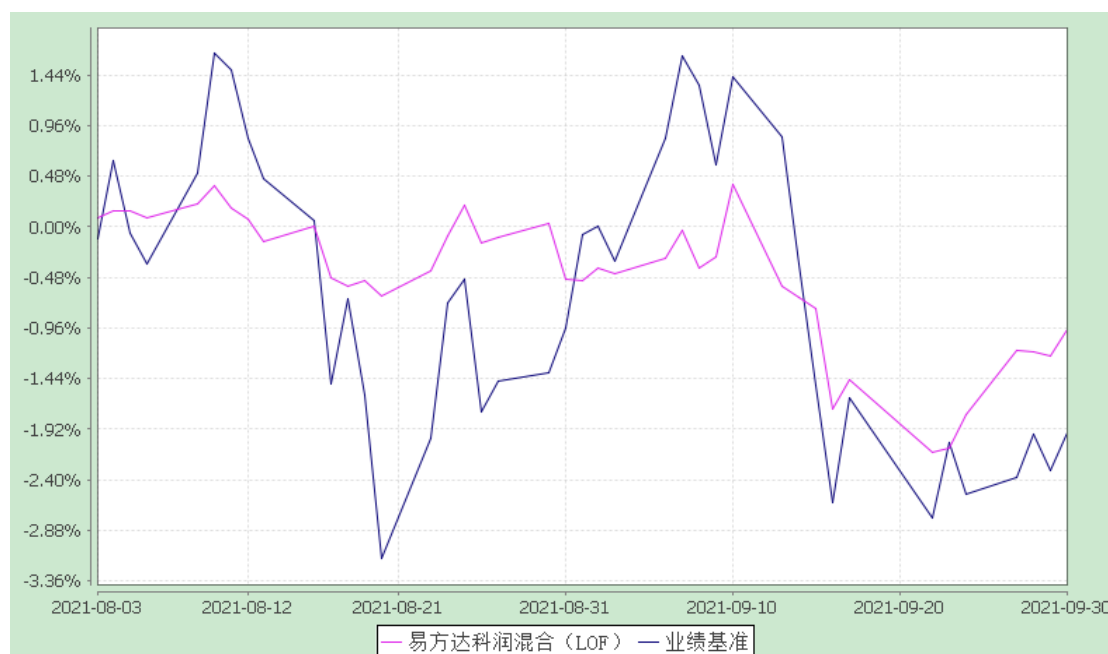
注：自2021年8月3日起，本基金业绩比较基准为“沪深300指数收益率×45%+中证港股通综合指数收益率×35%+中债总指数收益率×20%”。

3.2.1.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达科润混合型证券投资基金（LOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年8月3日至2021年9月30日)



注：1.本基金由原易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）于2021年8月3日转型而来，截至报告期末，本基金合同生效未满足一年。

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2021年8月3日起，本基金业绩比较基准为“沪深300指数收益率×45%+中证港股通综合指数收益率×35%+中债总指数收益率×20%”。

4.自基金转型至报告期末，基金份额净值增长率为-0.97%，同期业绩比较基准收益率为-1.96%。

3.2.2 易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF） （报告期：2021年7月1日-2021年8月2日）

3.2.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.09%	0.01%	-2.74%	0.92%	2.83%	-0.91%
过去六个月	0.52%	0.13%	-0.58%	0.69%	1.10%	-0.56%
过去一年	5.65%	0.22%	5.64%	0.76%	0.01%	-0.54%
过去三年	15.69%	0.24%	28.35%	0.81%	-12.66%	-0.57%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.70%	0.23%	30.28%	0.81%	-13.58%	-0.58%

注：过去三个月：2021年7月1日-2021年8月2日；

过去六个月：2021年4月1日-2021年8月2日；

过去一年：2020年10月1日-2021年8月2日；

过去三年：2018年10月1日-2021年8月2日；

自基金合同生效起至今：2018年7月5日-2021年8月2日。

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

易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018年7月5日至2021年8月2日)



注：自基金合同生效至2021年8月2日，基金份额净值增长率为16.70%，同期业绩比较基准收益率为30.28%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.1.1 易方达科润混合型证券投资基金（LOF）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
付浩	本基金的基金经理、权益投资管理部总经理、权益投资决策委员会委员	2021-08-03	-	24年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任广东粤财信托投资有限公司国际金融部职员，深圳和君创业研究咨询有限公司管理咨询项目经理，湖南证券投资银行总部项目经理，融通基金管理有限公司研究策划部研究员，易方达基金管理有限公司权益投资总部副总经理、养老金与专户权益投资部副总经理、公募基金投资部总经理、基金经理助理、投资经理、易方达策略成长证券投资

					资基金基金经理、科瑞证券投资基金基金经理、易方达科翔股票型证券投资基金基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。
胡剑	本基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、固定收益投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员	2021-08-03	2021-09-11	15年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理、易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达裕景添利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达丰惠混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。
纪玲云	本基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达	2021-08-03	2021-09-11	12年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员、投资经理助

	瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达恒利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、固定收益分类资产研究管理部负责人				理、固定收益研究部总经理助理、投资经理、易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1.上表报告期：2021年8月3日（基金合同生效日）-2021年9月30日。

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

3.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
付浩	本基金的基金经理、权益投资管理部总经理、权益投资决策委员会委员	2018-07-05	2021-08-03	24年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任广东粤财信托投资有限公司国际金融部职员，深圳和君创业研究咨询有限公司管理咨询项目经理，湖南证券投资银行总部项目经理，融通基金管理有限公司研究策划部研究员，易方达基金管理有限公司权益投资总部副总经理、养老金与专户权益投资部副总经理、公募基金投资部总经理、基金经理助理、投资经理、易方达策略成长证券投资基金基金经理、科瑞证券投资

					基金基金经理、易方达科翔股票型证券投资基金基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
胡剑	本基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理、易方达恒利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理、易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理、易方达恒惠定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒信定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、固定收益投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员	2018-07-05	2021-08-03	15年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、固定收益研究部总经理、固定收益投资部总经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理、易方达裕惠回报债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达裕景添利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达丰惠混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
纪玲云	本基金的基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达恒利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒盛3个月定期开放混合型发起式证券投资基金	2018-07-05	2021-08-03	12年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员、投资经理助理、固定收益研究部总经理助理、投资经理。

	的基金经理、易方达恒裕一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、固定收益分类资产研究管理部负责人				
--	---	--	--	--	--

注：1.上表报告期：2021年7月1日-2021年8月2日。

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

3.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共5次，其中3次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，2次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年三季度A股市场表现较弱，上证指数下跌0.64%，沪深300指数下跌6.85%，创业板指数下跌6.69%。煤炭、有色金属、钢铁、电力及公共事业、基础化工等行业涨幅居前，而消费者服务、医药、食品饮料、家电、纺织服装等行业跌幅较大。

经济基本面看，三季度宏观经济环比二季度走弱，供需两端的经济指标都出现了一定回落。生产端受到能耗双控、钢铁限产、芯片短缺及上游原材料价格高企等因素影响，PMI和工业增加值延续回落趋势。需求方面，疫情反复对消费修复形成制约。投资方面，随着下游需求转弱，制造业投资增速见顶放缓；地产调控延续，地产销售数据明显下降，地产投资受限；基建投资7月受洪涝灾害影响，下行幅度较大，8、9月略有修复，但在专项债前期发行进度偏慢、城投平台公司融资监管强化的政策环境下，投资数据未明显改善。进出口数据同比增速仍保持较高水平，不过回落后要重新突破二季度高点可能性较低。

同时，决策层对于地产债务风险和经济下行风险给予了重视，强调跨周期调节。财政支出上半年非常克制，下半年将成为主要的托底工具，三季度政府消费开始加码，基建也开始逐步发力。货币政策维持偏宽松，逐渐向“稳信用”过渡，社融增速下行探底。

国际经济方面，虽然疫情仍然反复，但主要经济体复苏势头不减，特别是美国经济在各种政策刺激下复苏强劲。

本基金转型于易方达三年封闭战略配售基金，之前鉴于7月初封闭期结束，本基金提前降低仓位，应对可能的赎回。之后因为转开放后赎回量较大，本基金采取了低仓位运作的方式，以避免净值的大幅波动。

本基金立足于选择具备“简单、独特、可持续”的商业模式的标的，兼顾企业的质量和成长，并在市场变化中不断平衡，力争获取中长期超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021年9月30日，易方达科润混合型证券投资基金（LOF）份额净值为1.1557元，本报告期(2021年8月3日—2021年9月30日)份额净值增长率为-0.97%，同期业绩比较基准收益率为-1.96%。

2021年8月2日，原易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）份额净值为1.1670元，本报告期(2021年7月1日—2021年8月2日)份额净值增长率为0.09%，同期业绩比较基准收益率为-2.74%。

§5 投资组合报告

5.1 易方达科润混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2021年8月3日-2021年9月30日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,126,968,338.70	34.15
	其中：股票	1,126,968,338.70	34.15
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,003,553,520.33	30.41
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,167,905,318.12	35.39
7	其他资产	1,376,603.99	0.04
8	合计	3,299,803,781.14	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81,978,918.76元，占净值比例2.51%。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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	5,766.30	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	908,933,243.29	27.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,299,875.22	0.19
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	162,923.36	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,032.00	0.00
J	金融业	129,119,940.00	3.95
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	354,469.44	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	36,753.50	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,044,989,419.94	31.94

5.1.2.2 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	-	-
必需消费品	-	-
保健	-	-

金融	81,978,918.76	2.51
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	81,978,918.76	2.51

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.1.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	603806	福斯特	1,050,870	133,250,316.00	4.07
2	601012	隆基股份	1,485,920	122,558,681.60	3.75
3	600519	贵州茅台	52,699	96,439,170.00	2.95
4	00388	香港交易所	205,100	81,978,918.76	2.51
5	000333	美的集团	1,138,178	79,217,188.80	2.42
6	600036	招商银行	1,384,400	69,842,980.00	2.13
7	000858	五粮液	316,320	69,397,444.80	2.12
8	600438	通威股份	1,255,117	63,935,659.98	1.95
9	002371	北方华创	171,500	62,715,835.00	1.92
10	002142	宁波银行	1,686,400	59,276,960.00	1.81

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局、中国人民银行宁波市中心支行、国家外汇管理局宁波市分局处罚，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、国家外汇管理局深圳市分局处罚。

本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.1.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,187,489.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	189,114.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,376,603.99
---	----	--------------

5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2 易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2021年7月1日-2021年8月2日）

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,987,501.76	0.17
	其中：股票	7,987,501.76	0.17
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,810,972,993.50	99.68
7	其他资产	7,264,434.75	0.15
8	合计	4,826,224,930.01	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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	6,342.50	0.00

B	采矿业	-	-
C	制造业	2,771,056.57	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,920,075.46	0.10
E	建筑业	19,761.78	0.00
F	批发和零售业	17,518.44	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	18,024.00	0.00
J	金融业	-	-
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	201,358.86	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	33,364.15	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,987,501.76	0.17

5.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.2.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600905	三峡能源	907,763	4,920,075.46	0.10
2	300957	贝泰妮	8,523	1,729,350.95	0.04
3	688315	诺禾致源	3,711	201,358.86	0.00
4	688076	诺泰生物	4,984	196,220.08	0.00
5	688639	华恒生物	2,302	132,203.86	0.00

6	605499	东鹏饮料	632	127,284.80	0.00
7	300919	中伟股份	610	96,373.90	0.00
8	300979	华利集团	925	82,325.00	0.00
9	688217	睿昂基因	1,040	56,284.80	0.00
10	688395	正弦电气	1,627	47,622.29	0.00

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,506,551.56

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,757,883.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,264,434.75

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	4,920,075.46	0.10	新股流通受限
2	688315	诺禾致源	201,358.86	0.00	新股流通受限
3	688076	诺泰生物	196,220.08	0.00	新股流通受限
4	300957	贝泰妮	163,903.95	0.00	新股流通受限
5	300979	华利集团	82,325.00	0.00	新股流通受限
6	688217	睿昂基因	56,284.80	0.00	新股流通受限
7	688395	正弦电气	47,622.29	0.00	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

6.1 易方达科润混合型证券投资基金（LOF）

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	4,045,015,729.30
----------------	------------------

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,441,861.14
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,221,655,015.76
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,830,802,574.68

注：本基金由易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）转型而来，基金合同于2021年08月03日起生效，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

6.2 易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

单位：份

报告期期初基金份额总额	24,459,867,362.51
报告期基金总申购份额	-
减：报告期基金总赎回份额	20,414,851,633.21
报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	4,045,015,729.30

注：自2021年8月3日起，“易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”变更为“易方达科润混合型证券投资基金（LOF）”。本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 易方达科润混合型证券投资基金（LOF）

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

7.2 易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

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

2、《易方达科润混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《易方达科润混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年十月二十七日