

易方达安盈回报混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十日

§ 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。本年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	5
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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	16
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
§ 5	托管人报告	20
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	20
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	20
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	21
§ 6	审计报告	21
6.1	审计意见	21
6.2	形成审计意见的基础	21
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任	21
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任	22
§ 7	年度财务报表	23
7.1	资产负债表	23
7.2	利润表	25
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4	报表附注	27
§ 8	投资组合报告	59
8.1	期末基金资产组合情况	59
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3	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	60
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	65

8.6	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	65
8.7	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	65
8.8	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	65
8.9	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	65
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12	投资组合报告附注	66
§ 9	基金份额持有人信息	69
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3	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情况	69
§ 10	开放式基金份额变动	70
§ 11	重大事件揭示	70
11.1	基金份额持有人大会决议	70
11.2	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	70
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4	基金投资策略的改变	70
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8	其他重大事件	73
§ 12	备查文件目录	75
12.1	备查文件目录	75
12.2	存放地点	75
12.3	查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达安盈回报混合型证券投资基金
基金简称	易方达安盈回报混合
基金主代码	001603
交易代码	001603
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 16 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,443,320,482.38 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。3、本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。4、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×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。

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	中国农业银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	张南	秦一楠
	联系电话	020-85102688	010-66060069
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400 881 8088	95599	
传真	020-38798812	010-68121816	
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市东城区建国门内大街69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28号凯 晨世贸中心东座F9	
邮政编码	510620	100031	
法定代表人	刘晓艳	谷澍	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊 普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	171,058,363.15	71,071,949.10	22,540,617.61

本期利润	347,707,652.97	169,415,096.41	58,692,524.49
加权平均基金份额本期利润	0.3719	0.7475	0.5171
本期加权平均净值利润率	14.89%	40.64%	40.27%
本期基金份额净值增长率	19.53%	55.43%	44.54%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	888,724,560.94	246,920,207.15	57,235,027.82
期末可供分配基金份额利润	0.6157	0.6475	0.3193
期末基金资产净值	3,676,629,568.95	879,016,924.17	265,924,092.45
期末基金份额净值	2.547	2.305	1.483
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	175.52%	130.50%	48.30%

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。

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

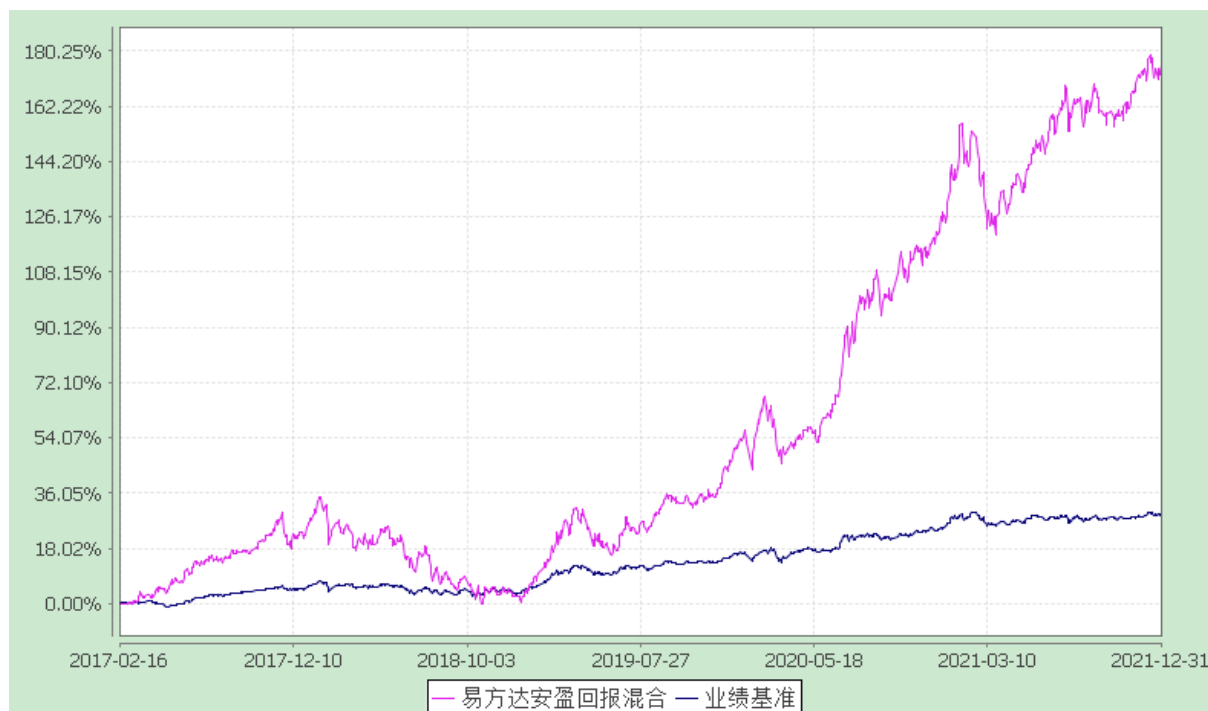
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.19%	0.70%	1.27%	0.20%	4.92%	0.50%
过去六个月	6.17%	0.87%	0.73%	0.26%	5.44%	0.61%
过去一年	19.53%	0.99%	2.50%	0.30%	17.03%	0.69%
过去三年	168.54%	1.08%	24.95%	0.31%	143.59%	0.77%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	175.52%	1.03%	29.41%	0.30%	146.11%	0.73%

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

易方达安盈回报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

(2017年2月16日至2021年12月31日)

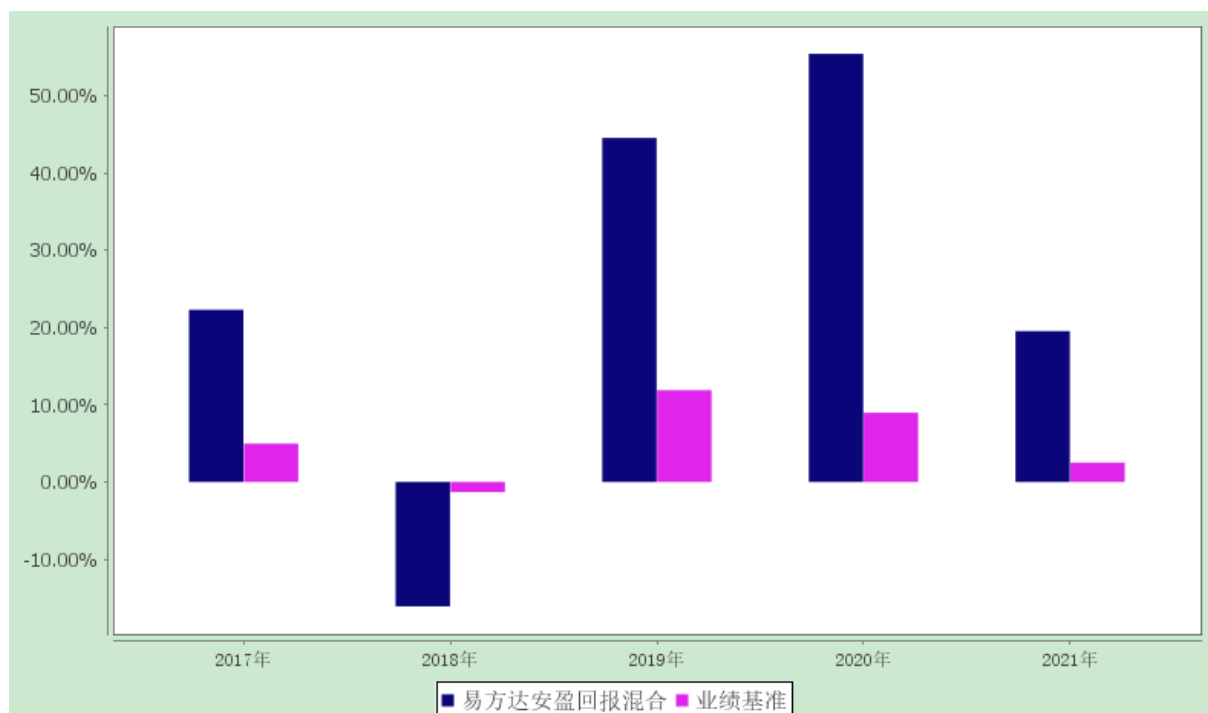


注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 175.52%，同期业绩比较基准收益率为 29.41%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达安盈回报混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2017 年 2 月 16 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续

期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	1.980	171,656,631.84	65,643,708.12	237,300,339.96	-
合计	1.980	171,656,631.84	65,643,708.12	237,300,339.96	-

§ 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		
张清华	本基金的基金经理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理（自2015年05月29日至2021年09月07日）、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理（自2016年01月22日至2021年09月07日）、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基	2017-02-16	-	14年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经理、固定收益基金投资部总经理、混合资产投资部总经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活

	<p>金经理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、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 （自 2020 年 09 月 03 日至 2021 年 09 月 17 日）、副总经理级高级管理人员、多资产投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员</p>				<p>配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金基金经理</p>
胡文伯	<p>本基金的基金经理助理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 11 月 15 日至 2021 年 02 月 10 日）、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（自 2018 年 11 月 23 日至 2021 年 02 月 10 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（自 2018 年 11 月 23 日至 2021 年 02 月 10 日）、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助理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资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（自 2018 年 07 月 31 日至 2021 年 06 月 09 日）、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达年年恒秋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达纯债 1 年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</p>	2018-11-23	2021-02-11	7 年	<p>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</p>

	用债债券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、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理助理、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助理、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助理、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助理、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助理、易方达年年恒夏纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达安源中短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理助理、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助理				
张雅君	本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、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达富财纯债债券型证券投资基金的基金经理（自 2018 年 10 月 26 日至 2021 年 06 月 11 日）、易方达悦通一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、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、易方达稳泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金的基金经理、易方	2019-04-04	2021-02-11	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任海通证券股份有限公司项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员、固定收益研究员、固定收益基金投资部总经理助理、混合资产投资部总经理助理、多资产公募投资部负责人、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金基金经理、易方达中债 7-10 年期国开债指数证券投资基金基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理、易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理

	达宁易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、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(自 2018 年 11 月 15 日至 2021 年 01 月 29 日)、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理(自 2018 年 11 月 15 日至 2021 年 02 月 10 日)、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理助理(自 2019 年 01 月 31 日至 2021 年 01 月 29 日)、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理(自 2019 年 03 月 06 日至 2021 年 01 月 29 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、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、多资产公募投资部总经理				
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、易方达裕富债券型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	2019-06-10	-	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>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、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理助理(自2020年07月09日至2021年11月30日)、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、易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金的基金</p>				
---	--	--	--	--

	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、易方达裕丰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、易方达丰和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)、易方达鑫转增利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、易方达纯债债券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、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利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、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理	2019-10-11	-	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>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、易方达悦浦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、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、易方达悦夏一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦丰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理</p>				
--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认

方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 30 次，其中 27 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 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。

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

大类资产配置上，相对看好权益市场，因此组合仍然维持偏高的权益仓位，债券部分以配置可转债为主，组合整体维持了较高的弹性。

股票市场在 2021 年呈现了极大的分化，行业轮动迅速，景气度和宏观政策是主要的拐点驱动力，市场更多关注短期的盈利动量。全年中证 500 显著跑赢沪深 300，市场相对偏好中小市值的个股。这给组合管理带来了不小的挑战。回顾全年，投资策略上，上半年还能相对适应市场，进入下半年，随着能耗双控持续加码，上游原材料价格大幅上涨，供给紧张对以制造业为主的高成长板块形成了较大的成本和需求冲击，同时医疗政策的调整对于医药行业带来了较大的冲击。组合坚持自下而上精选个股长期持有的思路，组合持仓以光伏、医疗、电子和化工四大行业为主。

转债市场方面，正股与估值双重驱动，全年表现亮眼。年初受到小盘股表现较差和信用风险拖累，低价转债遭遇双杀；春节后市场风格反转，受益于正股成分股中证 2000 占比较高，转债迎来平价和估值双击，叠加普遍的不赎回现象，估值从历史低位拉升至历史极高水平。行业层面，转债正股成分股中周期、成长和泛新能源占比较高，较好地契合了贯穿全年的强势板块。

组合深度参与转债市场，对优质个券进行重点持仓，高配估值合理、弹性较好的转债。行业层面，相对低配金融等权重个券，高配景气、成长行业个券。纯债仓位较低，主要提供流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.547 元，本报告期份额净值增长率为 19.53%，同期业绩比

较基准收益率为 2.50%。

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 年宏观经济展现出外需强、内需弱的格局。展望 2022 年，外需对经济的贡献会出现一定程度的下滑，主要源于全球经济复苏的高点可能已经过去，中国出口的份额也难以进一步提升，这会导致出口增速相比 2021 年下降。但同时国内需求可能会出现一定程度的修复：一方面国内信贷条件和财政支持均出现好转，稳增长政策持续发力，在房住不炒背景下地产政策也出现了边际缓和，明确支持合理的住房需求，这对于内需有较为明显的托底作用；另一方面很多供给方面的限制政策有所放松，大宗商品价格出现一定回落，企业利润从上游向中下游转移，这有利于下游企业预期的修复和整体生产状况的改善。在内需回升支持下，对于 2022 年的宏观经济并不悲观。

在资本市场层面，经济处于企稳回升的前期，盈利预期修复的背景下，权益市场整体仍有支撑。考虑到流动性以及盈利增速差异的变化，权益市场的极端分化行情会出现较为明显的收敛。2022 年内需回升会带来相关行业的盈利出现修复，出现结构性的机会。在经济企稳的背景下，债券市场利率继续大幅下行的空间较为有限，需要密切关注经济如果出现趋势性回升后债券市场可能存在的风险，在此之前在流动性宽松支持下利率仍然会保持震荡格局。

风险层面，一方面需要关注海外持续的通胀压力下造成货币政策超预期的退出风险，从历史上来看，这对全球资本市场都会产生压力，考虑到国内政策储备充足，人民币汇率弹性也较大，预计国内资本市场运行的趋势不会改变，但是需要关注阶段性冲击的出现。另一方面需要关注政策的变量，经历了过去两年的变化，很多行业的长期预期都发生了较大的变化，股票价值某种程度体现为企业未来长期现金流的折现，随着市场的变化，对于企业的定价我们需要不断地审视变与不变。

考虑到宏观环境的变化，本基金将在自下而上精选个股和个券的基础上，适度提高自上而下大类资产配置的重要性，维持更好的股债配置比例。转债由于整体估值较高、吸引力有所下降，考虑用纯债替代部分转债仓位，力争以长期稳健的业绩回报基金持有人。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务创新发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 培育合规文化、严守合规底线、防控违法违规行为是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，秉持“客户利益至上、实事求是、坚守长期”的核心价值观，树立弘扬“合规、诚信、专业、

稳健”的行业文化，促进公司合规文化建设。加大力度持续开展员工合规风控教育培训、强化合规监督考评机制，不断提高员工合规风控意识，深入践行“受人之托、为人理财”的信义义务。

(2) 坚持“守底线、保合规、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示；认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示；持续完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

(3) 参与新产品设计、新业务拓展工作，持续督促健全公募基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，严格进行合规审查，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券基金期货经营机构投资者投诉处理工作指引（试行）》等法律法规和监管政策、自律准则，进一步完善基金销售相关业务规范，加强投资者权益保护、促进长期理性投资。持续优化投资者适当性管理和客户投诉纠纷处理机制，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”职责义务，保障投资者合法权益。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，进一步健全信息披露管理工作机制流程，不断推进信息披露文件制作审核的系统化，持续做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 全面落实《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》等最新反洗钱法规与监管要求，下大力气完善提升洗钱风险管理体系和内控机制：进一步修订制度流程、充实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，健全洗钱风险自评估工作机制方法，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，不断提高反洗钱合规和风险管理水平，推动反洗钱工作以风险为本向纵深发展。

(7) 深入贯彻落实《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》《公开募集证券投资基金管理人及从业人员职业操守和道德规范指南》等规定，不断完善业务过程中的廉洁从业管理机制，加强对员工廉洁从业、职业操守和道德规范等方面的教育宣导和培训，努力将廉洁从业、职业操守和道德规范要求渗透落实到业务活动和日常经营的各个环节。

(8) 以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、产品运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，坚持不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司内控及合规管理有效性的提升。

(9) 不断检讨回顾合规管控框架和机制, 促进监察稽核自身制度流程和工具手段的完善, 持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

(10) 继续顺利通过 GIPS (全球投资业绩标准) 鉴证, 获得 GIPS 鉴证报告, 鉴证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 努力防范和控制重大风险, 充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 237,300,339.96 元。

§ 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

在托管本基金的过程中, 本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定, 对本基金基金管理人—易方达基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作, 进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督, 认真履行了托管人的义务, 没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、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问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，易方达基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 25243 号

易方达安盈回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了易方达安盈回报混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了易方达安盈回报混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达安盈回报混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金

行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达安盈回报混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达安盈回报混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达安盈回报混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达安盈回报混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达安盈回报混合型证券投资基金不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

陈熹 陈轶杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2022 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达安盈回报混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,680,496.12	18,172,388.29
结算备付金		7,340,325.31	2,352,884.32
存出保证金		205,708.63	77,783.00
交易性金融资产	7.4.7.2	3,601,737,969.47	888,977,802.78
其中：股票投资		1,712,167,610.54	436,298,028.26
基金投资		-	-
债券投资		1,889,570,358.93	452,679,774.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	64,000,152.00	-
应收证券清算款		5,412,732.59	575,205.41
应收利息	7.4.7.5	8,167,270.47	1,310,791.55
应收股利		-	-
应收申购款		17,466,658.12	6,995,225.82
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,706,011,312.71	918,462,081.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		12,000,000.00	9,000,000.00
应付证券清算款		4,201,267.96	17,513,528.09
应付赎回款		8,988,730.21	11,707,806.86
应付管理人报酬		2,668,246.31	578,430.76
应付托管费		741,179.54	160,675.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	405,853.73	182,233.75
应交税费		21,447.01	3,364.87
应付利息		-	-8,120.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	355,019.00	307,237.86
负债合计		29,381,743.76	39,445,157.00
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,443,320,482.38	381,337,442.74
未分配利润	7.4.7.10	2,233,309,086.57	497,679,481.43
所有者权益合计		3,676,629,568.95	879,016,924.17
负债和所有者权益总计		3,706,011,312.71	918,462,081.17

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.547 元，基金份额总额 1,443,320,482.38 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达安盈回报混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		377,186,790.25	175,652,960.20
1.利息收入		11,096,851.33	1,655,863.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	267,011.04	93,301.31
债券利息收入		9,919,774.98	1,504,307.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		910,065.31	58,254.69
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		183,814,132.34	73,639,580.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	70,534,317.69	38,877,973.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	109,090,139.21	33,449,574.16
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	4,189,675.44	1,312,033.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	176,649,289.82	98,343,147.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,626,516.76	2,014,368.66
减：二、费用		29,479,137.28	6,237,863.79
1. 管理人报酬		20,861,088.22	3,720,793.03

2. 托管费		5,794,746.74	1,033,553.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,874,282.05	856,255.04
5. 利息支出		621,262.57	381,940.44
其中：卖出回购金融资产支出		621,262.57	381,940.44
6. 税金及附加		18,448.04	2,444.06
7. 其他费用	7.4.7.19	309,309.66	242,877.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		347,707,652.97	169,415,096.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		347,707,652.97	169,415,096.41

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达安盈回报混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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）	381,337,442.74	497,679,481.43	879,016,924.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	347,707,652.97	347,707,652.97
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）	1,061,983,039.64	1,625,222,292.13	2,687,205,331.77
其中：1.基金申购款	1,801,027,826.54	2,718,389,781.71	4,519,417,608.25
2.基金赎回款	-739,044,786.90	-1,093,167,489.58	-1,832,212,276.48
四、本期向基金份额持	-	-237,300,339.96	-237,300,339.96

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）	1,443,320,482.38	2,233,309,086.57	3,676,629,568.95
项目	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年12月31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）	179,278,509.63	86,645,582.82	265,924,092.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	169,415,096.41	169,415,096.41
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）	202,058,933.11	241,618,802.20	443,677,735.31
其中：1.基金申购款	488,530,924.97	462,691,721.43	951,222,646.40
2.基金赎回款	-286,471,991.86	-221,072,919.23	-507,544,911.09
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）	381,337,442.74	497,679,481.43	879,016,924.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达安盈回报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[2015]1333号《关于准予易方达安盈回报混合型证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2016]2955号《关于易方达安盈回报混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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《易方达安盈回报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,《易方达安盈回报混合型证券投资基金基金合同》于2017年2月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为604,172,113.67份基金份额,其中认购资金利息折合184,238.52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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

7.4.2 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》、《易方达安盈回报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。

7.4.3 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。

7.4.4 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。

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交

易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)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；

(2)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。

(3)每一基金份额享有同等分配权；

(4)在遵守法律法规及监管部门规定且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，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	1,680,496.12	18,172,388.29
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	1,680,496.12	18,172,388.29

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,581,039,005.87	1,712,167,610.54	131,128,604.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,484,870,763.24	1,659,439,358.93	174,568,595.69
	银行间市场	229,927,495.82	230,131,000.00	203,504.18
	合计	1,714,798,259.06	1,889,570,358.93	174,772,099.87
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,295,837,264.93	3,601,737,969.47	305,900,704.54
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		314,289,387.91	436,298,028.26	122,008,640.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	445,437,000.15	452,679,774.52	7,242,774.37
	银行间市场	-	-	-
	合计	445,437,000.15	452,679,774.52	7,242,774.37
资产支持证券		-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	759,726,388.06	888,977,802.78	129,251,414.72

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	64,000,152.00	-
合计	64,000,152.00	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,463.43	1,931.51
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	3,303.10	1,058.80
应收债券利息	8,155,539.75	1,307,766.24

应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	4,871.59	-
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	92.60	35.00
合计	8,167,270.47	1,310,791.55

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	404,567.30	182,233.75
银行间市场应付交易费用	1,286.43	-
合计	405,853.73	182,233.75

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	15,019.00	7,237.86
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	340,000.00	300,000.00
合计	355,019.00	307,237.86

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	381,337,442.74	381,337,442.74
本期申购	1,801,027,826.54	1,801,027,826.54
本期赎回（以“-”号填列）	-739,044,786.90	-739,044,786.90
本期末	1,443,320,482.38	1,443,320,482.38

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

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
上年度末	246,920,207.15	250,759,274.28	497,679,481.43
本期利润	171,058,363.15	176,649,289.82	347,707,652.97
本期基金份额交易产生的变动数	708,046,330.60	917,175,961.53	1,625,222,292.13
其中：基金申购款	1,202,254,018.45	1,516,135,763.26	2,718,389,781.71
基金赎回款	-494,207,687.85	-598,959,801.73	-1,093,167,489.58
本期已分配利润	-237,300,339.96	-	-237,300,339.96
本期末	888,724,560.94	1,344,584,525.63	2,233,309,086.57

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	139,653.64	53,316.58
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	124,291.09	38,865.52
其他	3,066.31	1,119.21
合计	267,011.04	93,301.31

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	294,131,677.70	226,349,509.60
减：卖出股票成本总额	223,597,360.01	187,471,536.51
买卖股票差价收入	70,534,317.69	38,877,973.09

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,621,436,304.71	455,924,766.63
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,505,827,473.75	421,128,214.06
减：应收利息总额	6,518,691.75	1,346,978.41
买卖债券差价收入	109,090,139.21	33,449,574.16

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,189,675.44	1,312,033.02
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	4,189,675.44	1,312,033.02

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	176,649,289.82	98,343,147.31
——股票投资	9,119,964.32	103,173,285.02

——债券投资	167,529,325.50	-4,830,137.71
——资产支持证券投资	-	-
——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	176,649,289.82	98,343,147.31

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	5,626,516.76	2,014,368.66
其他	-	-
合计	5,626,516.76	2,014,368.66

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,869,957.05	854,837.54
银行间市场交易费用	4,325.00	1,417.50
合计	1,874,282.05	856,255.04

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

审计费用	100,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	52,109.66	25,677.53
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	309,309.66	242,877.53

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2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。

7.4.9关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司	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、基金销售机构
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

注：1.广东省广晟资产经营有限公司自 2021 年 3 月 12 日起将名称变更为广东省广晟控股集团有限公司；盈峰控股集团有限公司自 2021 年 7 月 26 日起将名称变更为盈峰集团有限公司。2.以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	20,861,088.22	3,720,793.03
其中：支付销售机构的客户维护费	3,918,230.43	521,523.54

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.90% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,794,746.74	1,033,553.69

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	97,617,727.45	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	97,617,727.45	-
报告期末持有的基金份额占基金总 份额比例	6.7634%	-

注：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。

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 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1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期存款	1,680,496.12	139,653.64	18,172,388.29	53,316.58

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

7.4.10.7 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1月1日至2021年12月31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	301038	深水规院	新股网下发行	2,660	17,768.80
广发证券	605033	美邦股份	新股网下发行	423	5,367.87
广发证券	605090	九丰能源	新股网下发行	1,090	37,681.30
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021-09-02	-	2021-09-02	1.020	88,979,958.15	28,684,331.32	117,664,289.47	-
2	2021-11-10	-	2021-11-10	0.960	82,676,673.69	36,959,376.80	119,636,050.49	-
合计				1.980	171,656,631.84	65,643,708.12	237,300,339.96	-

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客	2021-07-06	2022-01-24	新股	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-

	文化			流通受限						
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-

301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股 流通 受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股 流通 受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股 流通 受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	新股 流通 受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股 流通 受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股 流通 受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股 流通 受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股 流通 受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新股 流通 受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股 流通 受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股 流通 受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股 流通 受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股 流通 受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股 流通 受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股 流通	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

				受限						
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股流通受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股流通受限	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股流通受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新股流通受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	新股流通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	新股流通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉	2021-11-30	2022-06-07	新股	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-

	维康			流通受限						
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新股流通受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股流通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新股流通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	新股流通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-

301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股 流通 受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股 流通 受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-01-05	新股 流通 受限	57.58	57.58	37,440	2,155,795.20	2,155,795.20	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-07-05	新股 流通 受限	57.58	57.58	87,363	5,030,361.54	5,030,361.54	-
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	新股 流通 受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688211	中科微至	2021-10-18	2022-04-26	新股 流通 受限	90.20	71.32	4,501	405,990.20	321,011.32	-
688235	百济神州	2021-12-06	2022-06-15	新股 流通 受限	192.60	136.46	19,217	3,701,194.20	2,622,351.82	-
688236	春立医疗	2021-12-23	2022-06-30	新股 流通 受限	29.81	26.43	4,052	120,790.12	107,094.36	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-07-06	新股 流通 受限	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688553	汇宇制药	2021-10-14	2022-04-26	新股 流通 受限	38.87	32.11	8,928	347,031.36	286,678.08	-
871245	威博液压	2021-12-24	2022-01-06	新股 流通 受限	9.68	9.68	200	1,936.00	1,936.00	-
300855	图南股份	2021-08-31	2022-03-01	大宗 交易 流通 受限	58.68	67.71	270,000	15,843,600.00	18,281,700.00	-
688128	中国电研	2021-12-15	2022-06-15	大宗 交易 流通 受限	30.12	26.30	475,000	14,307,000.00	12,492,500.00	-
688518	联赢激光	2021-08-26	2022-02-28	大宗 交易 流通 受限	33.00	46.43	300,000	9,900,000.00	13,929,000.00	-

000596	古井贡酒	2021-07-21	2022-01-24	非公开发行流通受限	200.00	238.13	220,000	44,000,000.00	52,388,600.00	-
300850	新强联	2021-08-12	2022-02-24	非公开发行流通受限	106.21	171.21	3,785	402,004.85	648,029.85	-
688390	固德威	2021-09-22	2022-03-17	询价转让流通受限	300.02	426.01	43,061	12,919,161.22	18,344,416.61	-
7.4.12.1.2 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
113052	兴业转债	2021-12-29	2022-01-14	新发流通受限	100.00	100.00	34,800	3,479,969.49	3,479,969.49	-

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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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 12,000,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、集中交易部门、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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，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 12 月 31 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 46.38%(2020 年 12 月 31 日：46.45%)。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	233,169,139.72	45,664,565.50
合计	233,169,139.72	45,664,565.50

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。

7.4.13.2.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.3 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	692,222,186.00	148,472,964.83
AAA 以下	972,334,572.96	259,850,010.43
未评级	0.00	0.00
合计	1,664,556,758.96	408,322,975.26

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。

7.4.13.2.5 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.6 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2021 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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场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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,680,496.12	-	-	-	1,680,496.12
结算备付金	7,340,325.31	-	-	-	7,340,325.31
存出保证金	205,708.63	-	-	-	205,708.63
交易性金融资产	315,612,891.20	921,655,714.38	652,301,753.35	1,712,167,610.54	3,601,737,969.47
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	64,000,152.00	-	-	-	64,000,152.00
应收证券清算款	-	-	-	5,412,732.59	5,412,732.59

应收利息	-	-	-	8,167,270.47	8,167,270.47
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	17,466,658.12	17,466,658.12
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	388,839,573.26	921,655,714.38	652,301,753.35	1,743,214,271.72	3,706,011,312.71
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	12,000,000.00	-	-	-	12,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	4,201,267.96	4,201,267.96
应付赎回款	-	-	-	8,988,730.21	8,988,730.21
应付管理人报酬	-	-	-	2,668,246.31	2,668,246.31
应付托管费	-	-	-	741,179.54	741,179.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	405,853.73	405,853.73
应交税费	-	-	-	21,447.01	21,447.01
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	355,019.00	355,019.00
负债总计	12,000,000.00	-	-	17,381,743.76	29,381,743.76
利率敏感度缺口	376,839,573.26	921,655,714.38	652,301,753.35	1,725,832,527.96	3,676,629,568.95
上年度末					
2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,172,388.29	-	-	-	18,172,388.29
结算备付金	2,352,884.32	-	-	-	2,352,884.32
存出保证金	77,783.00	-	-	-	77,783.00
交易性金融资产	45,584,481.80	187,210,179.45	219,885,113.27	436,298,028.26	888,977,802.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	575,205.41	575,205.41
应收利息	-	-	-	1,310,791.55	1,310,791.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	6,995,225.82	6,995,225.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	66,187,537.41	187,210,179.45	219,885,113.27	445,179,251.04	918,462,081.17
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	9,000,000.00	-	-	-	9,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	17,513,528.09	17,513,528.09
应付赎回款	-	-	-	11,707,806.86	11,707,806.86
应付管理人报酬	-	-	-	578,430.76	578,430.76
应付托管费	-	-	-	160,675.24	160,675.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	182,233.75	182,233.75
应交税费	-	-	-	3,364.87	3,364.87
应付利息	-	-	-	-8,120.43	-8,120.43
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	307,237.86	307,237.86
负债总计	9,000,000.00	-	-	30,445,157.00	39,445,157.00
利率敏感度缺口	57,187,537.41	187,210,179.45	219,885,113.27	414,734,094.04	879,016,924.17

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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日

1.市场利率下降 25 个基点	411,192.12	47,163.38
2.市场利率上升 25 个基点	-410,202.97	-47,069.83

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,712,167,610.54	46.57	436,298,028.26	49.63
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	1,712,167,610.54	46.57	436,298,028.26	49.63

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	604,672,686.72	164,595,772.83
	2.业绩比较基准下降 5%	-604,672,686.72	-164,595,772.83

7.4.14 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 12 月 31 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 2,978,920,056.44 元，属于第二层次的余额为 622,817,913.03 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 791,937,733.95 元，第二层次 97,040,068.83 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具

列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公开募集证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,712,167,610.54	46.20
	其中:股票	1,712,167,610.54	46.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,889,570,358.93	50.99
	其中:债券	1,889,570,358.93	50.99
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	64,000,152.00	1.73
	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	9,020,821.43	0.24
8	其他各项资产	31,252,369.81	0.84
9	合计	3,706,011,312.71	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,285,227,032.57	34.96

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	168,328.64	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	160,199,979.72	4.36
J	金融业	33,755,256.00	0.92
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	68,669,370.30	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	44,659.04	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	164,048,949.84	4.46
R	文化、体育和娱乐业	37,906.44	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,712,167,610.54	46.57

8.3 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	2,296,690	197,974,678.00	5.38
2	002415	海康威视	3,518,300	184,077,456.00	5.01
3	000661	长春高新	591,400	160,505,960.00	4.37
4	600486	扬农化工	1,092,687	143,360,534.40	3.90
5	603882	金城医学	1,087,691	121,136,146.67	3.29
6	688188	柏楚电子	262,964	101,362,103.44	2.76
7	000333	美的集团	1,031,400	76,127,634.00	2.07
8	603259	药明康德	572,836	67,926,892.88	1.85
9	600426	华鲁恒升	1,858,300	58,164,790.00	1.58
10	603806	福斯特	442,311	57,743,701.05	1.57
11	000596	古井贡酒	224,700	53,535,400.00	1.46
12	688536	思瑞浦	64,655	49,655,040.00	1.35

13	300558	贝达药业	600,656	47,950,368.48	1.30
14	603986	兆易创新	260,240	45,763,204.00	1.24
15	300059	东方财富	909,600	33,755,256.00	0.92
16	300782	卓胜微	96,611	31,572,474.80	0.86
17	000516	国际医学	2,737,948	30,199,566.44	0.82
18	000858	五粮液	130,600	29,079,396.00	0.79
19	300628	亿联网络	329,100	26,805,195.00	0.73
20	000860	顺鑫农业	601,800	22,976,724.00	0.62
21	002859	洁美科技	565,580	21,039,576.00	0.57
22	688390	固德威	43,061	18,344,416.61	0.50
23	300855	图南股份	270,000	18,281,700.00	0.50
24	002250	联化科技	986,597	17,729,148.09	0.48
25	002304	洋河股份	100,900	16,621,257.00	0.45
26	688518	联赢激光	300,000	13,929,000.00	0.38
27	002044	美年健康	1,617,207	12,695,074.95	0.35
28	688128	中国电研	475,000	12,492,500.00	0.34
29	300132	青松股份	963,900	10,882,431.00	0.30
30	000568	泸州老窖	41,000	10,408,670.00	0.28
31	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	0.20
32	688235	百济神州	19,217	2,622,351.82	0.07
33	688200	华峰测控	4,549	2,328,633.10	0.06
34	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.05
35	688798	艾为电子	3,592	775,872.00	0.02
36	688728	格科微	23,033	694,905.61	0.02
37	688105	诺唯赞	6,180	655,080.00	0.02
38	300850	新强联	3,785	648,029.85	0.02
39	688385	复旦微电	8,986	452,355.24	0.01
40	301029	怡合达	4,617	424,278.54	0.01
41	688211	中科微至	4,501	321,011.32	0.01
42	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
43	688553	汇宇制药	8,928	286,678.08	0.01
44	688276	百克生物	3,486	239,139.60	0.01
45	605499	东鹏饮料	632	114,922.88	0.00
46	688236	春立医疗	4,052	107,094.36	0.00
47	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
48	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
49	688683	莱尔科技	3,296	80,982.72	0.00
50	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
51	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
52	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
53	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
54	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
55	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
56	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00

57	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
58	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
59	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
60	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
61	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
62	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
63	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
64	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
65	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
66	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
67	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
68	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
69	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
70	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
71	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
72	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
73	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
74	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
75	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
76	001207	联科科技	682	14,922.16	0.00
77	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
78	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
79	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
80	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
81	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
82	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
83	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
84	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
85	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
86	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
87	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
88	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
89	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
90	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
91	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
92	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
93	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
94	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
95	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
96	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
97	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
98	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
99	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
100	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00

101	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
102	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
103	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
104	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
105	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
106	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
107	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
108	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
109	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
110	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
111	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
112	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
113	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
114	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
115	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
116	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
117	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
118	871245	威博液压	200	1,936.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000661	长春高新	185,534,650.60	21.11
2	002415	海康威视	157,605,979.00	17.93
3	603882	金域医学	130,967,351.79	14.90
4	600486	扬农化工	106,046,582.99	12.06
5	601012	隆基股份	104,268,869.88	11.86
6	000333	美的集团	76,121,670.90	8.66
7	300558	贝达药业	68,455,811.22	7.79
8	688188	柏楚电子	62,580,098.98	7.12
9	600426	华鲁恒升	55,171,925.22	6.28
10	600588	用友网络	46,822,241.07	5.33
11	603986	兆易创新	45,153,750.00	5.14
12	000596	古井贡酒	44,000,000.00	5.01
13	603259	药明康德	40,328,305.77	4.59
14	300059	东方财富	34,980,848.00	3.98
15	300782	卓胜微	32,055,714.05	3.65
16	000516	国际医学	30,383,513.38	3.46
17	000858	五粮液	23,162,109.00	2.64

18	600436	片仔癀	22,532,655.55	2.56
19	002859	洁美科技	20,893,142.00	2.38
20	002304	洋河股份	20,792,762.03	2.37

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603806	福斯特	35,849,025.00	4.08
2	600588	用友网络	32,343,389.85	3.68
3	600436	片仔癀	25,960,722.00	2.95
4	600570	恒生电子	24,306,307.26	2.77
5	002507	涪陵榨菜	21,587,849.93	2.46
6	600763	通策医疗	18,433,386.50	2.10
7	600600	青岛啤酒	15,005,935.75	1.71
8	002078	太阳纸业	14,554,950.07	1.66
9	600905	三峡能源	8,767,193.59	1.00
10	600161	天坛生物	8,306,302.88	0.94
11	002415	海康威视	8,193,207.00	0.93
12	603712	七一二	5,308,354.92	0.60
13	002601	龙佰集团	4,888,557.00	0.56
14	603259	药明康德	4,881,563.18	0.56
15	688050	爱博医疗	4,116,021.37	0.47
16	688303	大全能源	2,982,066.05	0.34
17	002597	金禾实业	2,854,817.00	0.32
18	688187	时代电气	1,899,241.15	0.22
19	688538	和辉光电	1,584,559.04	0.18
20	301155	海力风电	1,561,679.13	0.18

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。

8.4.3 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	1,490,346,977.97
卖出股票收入（成交）总额	294,131,677.70

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。

8.5 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	230,134,000.00	6.26
	其中：政策性金融债	190,031,000.00	5.17
4	企业债券	70,148,000.00	1.91
5	企业短期融资券	40,100,000.00	1.09
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,549,188,358.93	42.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,889,570,358.93	51.39

8.6 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	123111	东财转 3	636,250	107,004,525.00	2.91
2	132018	G 三峡 EB1	719,450	100,651,055.00	2.74
3	210404	21 农发 04	800,000	79,992,000.00	2.18
4	132015	18 中油 EB	500,000	51,965,000.00	1.41
5	210206	21 国开 06	500,000	50,035,000.00	1.36

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到乌审旗住房和城乡建设局的处罚。

本基金对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，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	205,708.63
2	应收证券清算款	5,412,732.59
3	应收股利	-
4	应收利息	8,167,270.47
5	应收申购款	17,466,658.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,252,369.81

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	123111	东财转 3	107,004,525.00	2.91

2	132018	G 三峡 EB1	100,651,055.00	2.74
3	132015	18 中油 EB	51,965,000.00	1.41
4	111000	起帆转债	45,826,570.00	1.25
5	113011	光大转债	43,128,820.20	1.17
6	110053	苏银转债	42,385,899.60	1.15
7	110074	精达转债	41,345,321.20	1.12
8	110079	杭银转债	40,069,499.60	1.09
9	113044	大秦转债	39,895,257.60	1.09
10	113048	晶科转债	39,407,931.60	1.07
11	113050	南银转债	37,725,148.80	1.03
12	123107	温氏转债	33,648,354.32	0.92
13	110073	国投转债	32,170,846.20	0.88
14	123083	朗新转债	30,649,415.70	0.83
15	113025	明泰转债	28,632,329.10	0.78
16	110045	海澜转债	25,799,939.00	0.70
17	128081	海亮转债	25,029,519.83	0.68
18	113037	紫银转债	22,214,256.30	0.60
19	113615	金诚转债	22,097,075.00	0.60
20	127030	盛虹转债	21,729,520.68	0.59
21	127022	恒逸转债	21,256,873.61	0.58
22	127035	濮耐转债	18,697,979.69	0.51
23	110061	川投转债	16,903,620.00	0.46
24	123086	海兰转债	14,868,744.24	0.40
25	113051	节能转债	14,794,433.50	0.40
26	113043	财通转债	14,493,757.00	0.39
27	113537	文灿转债	14,209,288.50	0.39
28	128130	景兴转债	14,065,109.04	0.38
29	127033	中装转 2	13,980,277.08	0.38
30	128128	齐翔转 2	13,534,297.10	0.37
31	110048	福能转债	13,278,553.20	0.36
32	113568	新春转债	13,014,018.60	0.35
33	128107	交科转债	12,532,285.44	0.34
34	127029	中钢转债	12,284,378.39	0.33
35	110075	南航转债	12,037,101.50	0.33
36	113026	核能转债	11,921,549.20	0.32
37	123071	天能转债	11,028,043.47	0.30
38	123078	飞凯转债	11,017,727.50	0.30
39	123098	一品转债	10,113,922.00	0.28
40	113046	金田转债	9,648,318.40	0.26
41	127005	长证转债	9,354,898.80	0.25
42	128013	洪涛转债	8,519,364.00	0.23
43	113624	正川转债	7,903,487.20	0.21
44	128141	旺能转债	7,741,091.28	0.21
45	128144	利民转债	7,629,459.60	0.21

46	123105	拓尔转债	7,398,090.15	0.20
47	123103	震安转债	7,258,574.40	0.20
48	110059	浦发转债	6,921,131.50	0.19
49	128109	楚江转债	6,830,058.80	0.19
50	128129	青农转债	6,798,894.30	0.18
51	113009	广汽转债	6,710,047.20	0.18
52	113599	嘉友转债	6,384,134.00	0.17
53	110047	山鹰转债	5,891,975.20	0.16
54	113598	法兰转债	5,688,868.90	0.15
55	113563	柳药转债	5,602,698.90	0.15
56	128108	蓝帆转债	5,400,722.90	0.15
57	127032	苏行转债	5,386,452.72	0.15
58	113039	嘉泽转债	4,833,831.80	0.13
59	110080	东湖转债	4,662,039.60	0.13
60	113605	大参转债	4,570,324.60	0.12
61	123061	航新转债	4,455,806.20	0.12
62	127025	冀东转债	4,425,466.86	0.12
63	118000	嘉元转债	4,327,972.20	0.12
64	128083	新北转债	4,083,707.52	0.11
65	110077	洪城转债	4,053,655.00	0.11
66	113033	利群转债	4,036,147.20	0.11
67	113550	常汽转债	3,740,904.30	0.10
68	113049	长汽转债	3,635,887.50	0.10
69	127011	中鼎转 2	3,579,614.00	0.10
70	127026	超声转债	3,479,028.10	0.09
71	123080	海波转债	3,456,123.20	0.09
72	113042	上银转债	3,355,650.20	0.09
73	128140	润建转债	3,318,441.00	0.09
74	123106	正丹转债	3,084,282.81	0.08
75	123004	铁汉转债	3,008,230.70	0.08
76	128090	汽模转 2	2,947,421.50	0.08
77	123090	三诺转债	2,577,256.44	0.07
78	128075	远东转债	2,484,761.60	0.07
79	123050	聚飞转债	2,469,365.40	0.07
80	123108	乐普转 2	2,424,101.10	0.07
81	127027	靖远转债	2,389,407.44	0.06
82	123099	普利转债	2,341,407.80	0.06
83	127013	创维转债	2,266,517.30	0.06
84	128106	华统转债	2,234,400.00	0.06
85	123092	天壕转债	2,106,217.80	0.06
86	113596	城地转债	2,057,544.00	0.06
87	128021	兄弟转债	2,031,993.00	0.06
88	128139	祥鑫转债	1,943,290.40	0.05
89	113591	胜达转债	1,796,997.20	0.05

90	113609	永安转债	1,786,321.70	0.05
91	110057	现代转债	1,771,905.90	0.05
92	128145	日丰转债	1,733,498.30	0.05
93	113013	国君转债	1,702,935.90	0.05
94	113577	春秋转债	1,663,494.10	0.05
95	113570	百达转债	1,638,118.00	0.04
96	123063	大禹转债	1,505,747.30	0.04
97	123096	思创转债	1,365,331.26	0.04
98	128034	江银转债	1,183,080.60	0.03
99	113567	君禾转债	1,055,296.80	0.03
100	123070	鹏辉转债	1,042,998.40	0.03
101	123060	苏试转债	996,858.48	0.03
102	113604	多伦转债	859,633.50	0.02
103	113623	凤 21 转债	472,012.50	0.01
104	128134	鸿路转债	137,017.74	0.00
105	132009	17 中油 EB	104,480.00	0.00
106	127012	招路转债	594.90	0.00

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
154,548	9,338.98	513,439,435.71	35.57%	929,881,046.67	64.43%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,364,534.71	0.0945%

9.3 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情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年2月16日)基金份额总额	604,172,113.67
本报告期期初基金份额总额	381,337,442.74
本报告期基金总申购份额	1,801,027,826.54
减：本报告期基金总赎回份额	739,044,786.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,443,320,482.38

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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；2021 年 7 月 17 日发布公告，自 2021 年 7 月 15 日起陈丽园女士不再担任公司副总经理级高级管理人员；2021 年 7 月 24 日发布公告，自 2021 年 7 月 24 日起聘任萧楠先生担任公司副总经理级高级管理人员，聘任管勇先生担任公司首席信息官；2021 年 7 月 30 日发布公告，自 2021 年 7 月 30 日起聘任杨冬梅女士担任公司副总经理级高级管理人员。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 5 年聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为 100,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
安信证券	1	16,063,710.84	0.98%	9,638.31	0.76%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	134,026,996.77	8.19%	80,415.92	6.30%	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	246,092,790.39	15.04%	196,874.28	15.43%	-
方正证券	2	237,312,005.53	14.50%	189,850.23	14.88%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	653,712.56	0.04%	522.96	0.04%	-
海通证券	1	115,038,554.41	7.03%	92,030.85	7.21%	-
华泰证券	1	16,891,507.54	1.03%	10,135.04	0.79%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	39,096,166.09	2.39%	31,276.91	2.45%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	430,715,862.60	26.32%	344,572.74	27.00%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	400,831,989.20	24.49%	320,666.28	25.13%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注: a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为中信证券股份有限公司,新增交易单元的证券公司为安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、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；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。

11.7.2 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
安信证券	78,517,194.43	1.99%	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	212,464,119.75	5.39%	341,000,000.00	2.30%	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方财富	1,004,692,143.80	25.48%	7,215,000,000.00	48.67%	-	-
方正证券	439,054,868.40	11.13%	509,000,000.00	3.43%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	58,036,646.10	1.47%	449,900,000.00	3.03%	-	-
海通证券	284,424,914.80	7.21%	2,114,000,000.00	14.26%	-	-
华泰证券	136,562,907.	3.46%	-	-	-	-

	01					
华西证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	69,199,185.20	1.75%	576,000,000.00	3.89%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	972,252,805.20	24.66%	3,609,900,000.00	24.35%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	687,977,281.83	17.45%	10,000,000.00	0.07%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加东方财富证券为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
2	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加基煜基金为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
3	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加联泰基金为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-21
4	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中欧财富为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-21
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2021-01-21
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配卓胜微（300782）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30
8	易方达基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021-02-08
9	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加腾安基金为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-10
10	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加海通证券为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金	2021-02-19

		电子披露网站	
11	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加焦作中旅银行为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-05
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报	2021-03-30
13	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
14	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2021-04-19
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配天坛生物（600161）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-28
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配涪陵榨菜（002507）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-19
17	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-17
18	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	证券时报	2021-07-20
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配古井贡酒（000596）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-23
20	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
21	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
22	易方达基金管理有限公司关于南京分公司营业场所变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-28
23	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-30
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配新强联（300850）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-14
25	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	证券时报	2021-08-28
26	易方达安盈回报混合型证券投资基金暂停机构客户大额申购及大额转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金	2021-08-31

		电子披露网站	
27	易方达安盈回报混合型证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-01
28	易方达安盈回报混合型证券投资基金恢复机构客户大额申购及大额转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-02
29	易方达安盈回报混合型证券投资基金暂停大额申购及大额转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-17
30	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第三季度报告提示性公告	证券时报	2021-10-27
31	易方达安盈回报混合型证券投资基金分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-09
32	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-15
33	易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-17

§ 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安盈回报混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达安盈回报混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达安盈回报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

二〇二二年三月三十日