

易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金

2020 年第 2 季度报告

2020 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

报告送出日期：二〇二〇年七月二十一日

§ 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 22 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 易方达瑞川混合发起式 |
| 基金主代码 | 009215 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 4 月 22 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 371,080,531.26 份 |
| 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 | 本基金将综合考虑宏观经济环境、政策形势、市场估值与流动性等因素，对股票市场、债券市场等证券市场中内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，确定组合中股票、债券、货币市场工具的比例。本基金的股票投资比例主要依据股票基准指数整体估值水平在过去十年中的分位值排位进行 |

| | |
|--------|--|
| | <p>相应调整，力争控制下行风险。其中，股票基准指数为沪深 300 指数，估值水平主要使用股票基准指数的市净率 PB。股票投资策略方面，本基金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。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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债新综合指数（财富）收益率×60%+沪深 300 指数收益率×40% |
| 风险收益特征 | <p>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。</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</p> |

| | | |
|-----------------|---|--------------|
| | 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 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达瑞川混合发起式 A | 易方达瑞川混合发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009215 | 009216 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 370,819,026.28 份 | 261,504.98 份 |

§ 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 (2020 年 4 月 22 日 (基金合同生效日) -2020 年 6 月 30 日) | |
|----------------|--|--------------|
| | 易方达瑞川混合发起式 A | 易方达瑞川混合发起式 C |
| 1.本期已实现收益 | -1,400,251.69 | -1,084.90 |
| 2.本期利润 | -3,622,360.74 | -2,652.19 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0098 | -0.0101 |
| 4.期末基金资产净值 | 367,196,665.54 | 258,852.79 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9902 | 0.9899 |

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.本基金合同于 2020 年 4 月 22 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 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

易方达瑞川混合发起式 A

| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | -0.98% | 0.13% | 2.99% | 0.33% | -3.97% | -0.20% |

易方达瑞川混合发起式 C

| 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 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | -1.01% | 0.13% | 2.99% | 0.33% | -4.00% | -0.20% |

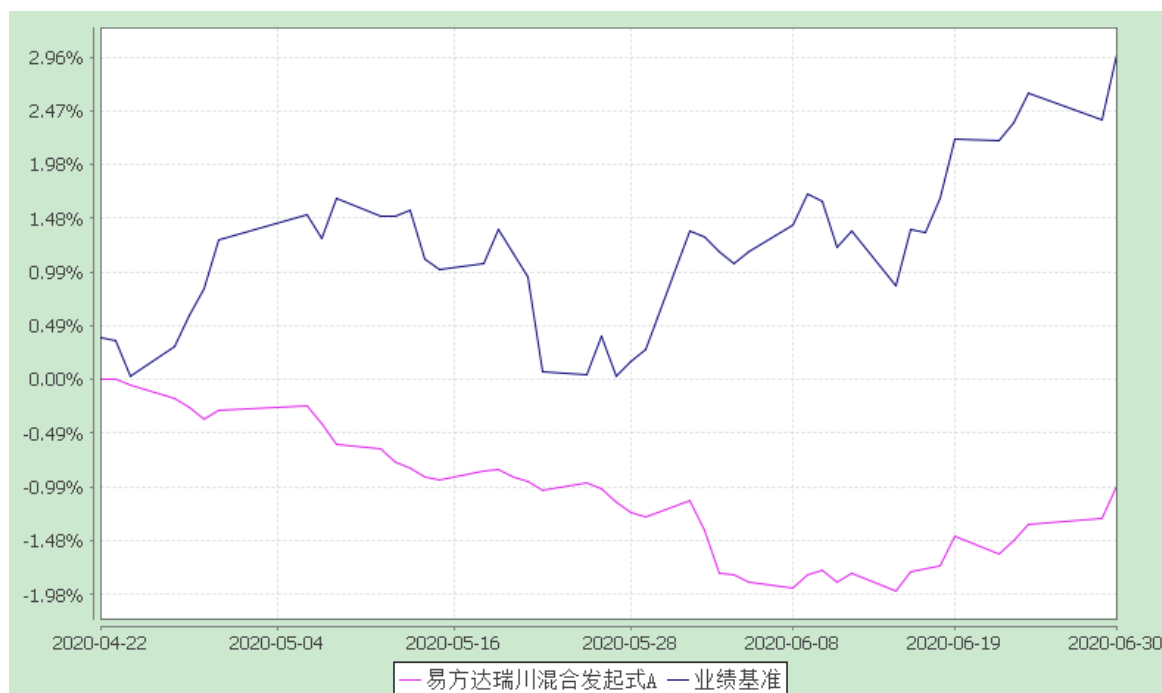
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

率变动的比较

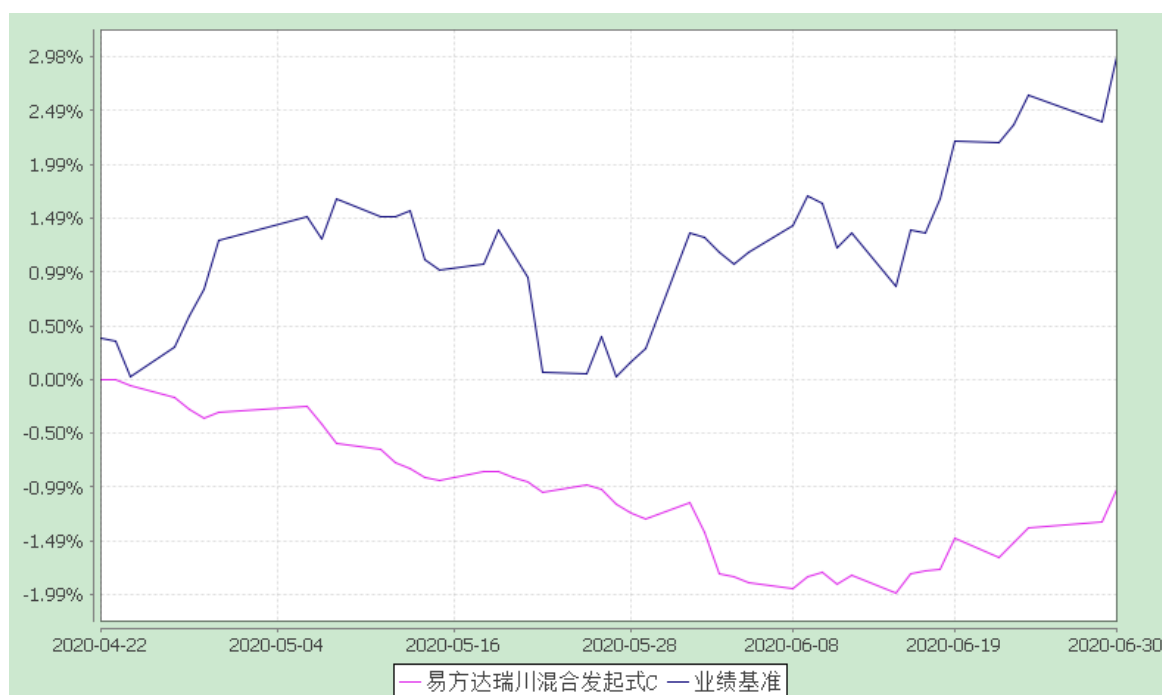
易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 4 月 22 日至 2020 年 6 月 30 日)

易方达瑞川混合发起式 A



易方达瑞川混合发起式 C



注：1.本基金合同于 2020 年 4 月 22 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为-0.98%，C 类基金份额净值增长率为-1.01%，同期业绩比较基准收益率为 2.99%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杨康 | 本基金的基金经理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰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、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达 | 2020-04-22 | - | 5 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易方达鑫转增利混合型证券投资基金基金经理助理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金基金经理助理。 |

| | | | | | |
|-----|---|------------|---|-----|--|
| | 新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞选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、易方达丰和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、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、投资经理 | | | | |
| 韩阅川 | 本基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞祺灵 | 2020-05-01 | - | 9 年 | 硕士研究生,具有基金从业资格。曾任嘉实基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理,易方达基金管理有限公司易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | 活配置混合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、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰惠混合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金经理助理 | | | | 易方达裕鑫债券型证券投资基金基金经理助理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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，“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.报告期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（“任职时间”为首次开始管理下表中本类产品的时间）

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量 (只) | 资产净值(元) | 任职时间 |
|----|--------------|-------------|----------------|------------|
| 杨康 | 公募基金 | 3 | 647,247,186.24 | 2019-11-07 |
| | 私募资产管理 计划 | 1 | 19,228,175.08 | 2019-12-23 |
| | 其他组合 | 0 | 0.00 | - |
| | 合计 | 4 | 666,475,361.32 | - |

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 42 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债券市场方面，二季度收益率先下后上，整体波动很大。季度初，海内外疫情影响仍在持续，市场风险偏好仍处于相对低位。清明节期间央行实行定向降准、下调超额准备金利率等操作，资金面整体较为宽松，长端收益率震荡下行。但到 5 月上旬，货币政策进一步宽松不及预期叠加五一消费复苏经济修复延续，长端收益率开始上行。随后，社融放量强化经济修复预期，收益率进一步大幅上行，且短端上行幅度更大，曲线呈现出熊平趋势。进入 6 月，货币环境仍未好转，叠加首批 1000 亿元特别国债发行但央行无配套动作，市场情绪进一步悲观，继续推动长端收益率上行。直到半年末，央行适时开启逆回购呵护半年末流动性，市场情绪有所恢复，长端收益率趋于稳定。信用债走势与利率债类似，全季来看收益率整体大幅上行，长端信用利差整体走阔。

权益市场方面，二季度整体收涨，各类风格及指数品种均呈现较好的弹性。从一季度末开始，在海外金融风险期过后，国内及海外资本市场均有较强的表现，体现出风险偏好的快速提升。从国内市场来看，A 股主要沿着业绩“确定性”的方向延伸，其中一季报超预期品种的超额收益尤为确定及显著，医药行业表现持续强势，机构配置持续维持高位。二季度初，伴随海外疫情逐渐消散，国内工业及服务业复工复产快速

恢复，与稳增长相关的板块及部分恢复速度较快的可选消费板块表现强劲，其中食品饮料、水泥、半导体等表现突出。市场投资者情绪也呈现快速修复，主动管理基金申购再度回暖。进入 5 月，中美贸易摩擦再度有所升温，美国疫情进入二次爆发，致使 TMT 板块的风险偏好有小幅降温，但在海外市场持续强劲的背景下，北上资金不改前期持续流入的趋势，市场并未出现明显调整，保持着结构性行情的震荡格局。6 月份以来，资本市场改革政策逐步推出，创业板注册制的快速推进、新三板精选层基金的发布等，显著提升了权益市场的风险偏好，也催生二季度后期科技板块的强劲反弹。

报告期内，组合仍处于建仓期，债券仓位和久期保持中性水平，按照票息策略的偏绝对收益操作思路为主。组合逐步加仓权益类资产，以高分红、低估值、较高 ROE 的优质个股为主，行业配置较为均衡。

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 0.9902 元，本报告期份额净值增长率为-0.98%，同期业绩比较基准收益率为 2.99%；C 类基金份额净值为 0.9899 元，本报告期份额净值增长率为-1.01%，同期业绩比较基准收益率为 2.99%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|---------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 86,200,185.56 | 18.84 |
| | 其中：股票 | 86,200,185.56 | 18.84 |
| 2 | 固定收益投资 | 353,246,900.00 | 77.19 |
| | 其中：债券 | 343,246,900.00 | 75.01 |
| | 资产支持证券 | 10,000,000.00 | 2.19 |
| 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 | 11,465,621.46 | 2.51 |
| 7 | 其他资产 | 6,698,509.85 | 1.46 |
| 8 | 合计 | 457,611,216.87 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 56,826,833.67 | 15.46 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,903,170.32 | 2.15 |
| E | 建筑业 | 1,735,326.00 | 0.47 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 12,097.57 | 0.00 |
| J | 金融业 | 15,186,614.00 | 4.13 |
| 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 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 4,536,144.00 | 1.23 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 86,200,185.56 | 23.46 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产 净值比例 (%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|----------------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 7,700 | 11,264,176.00 | 3.07 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 2,066,300 | 10,290,174.00 | 2.80 |
| 3 | 600900 | 长江电力 | 416,600 | 7,890,404.00 | 2.15 |
| 4 | 603806 | 福斯特 | 107,040 | 5,342,366.40 | 1.45 |
| 5 | 601799 | 星宇股份 | 37,800 | 4,800,600.00 | 1.31 |
| 6 | 600763 | 通策医疗 | 27,200 | 4,536,144.00 | 1.23 |
| 7 | 600161 | 天坛生物 | 86,900 | 3,939,177.00 | 1.07 |
| 8 | 601688 | 华泰证券 | 197,700 | 3,716,760.00 | 1.01 |
| 9 | 601012 | 隆基股份 | 89,800 | 3,657,554.00 | 1.00 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 52,611 | 3,145,611.69 | 0.86 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产 净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|------------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 343,190,400.00 | 93.40 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 56,500.00 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 343,246,900.00 | 93.41 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金 资产净 值比例 |
|----|------|------|-------|---------|-------------------|
|----|------|------|-------|---------|-------------------|

| | | | | | (%) |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 1 | 122436 | 15 远洋 02 | 300,000 | 30,603,000.00 | 8.33 |
| 2 | 136337 | 16 乌房 01 | 300,000 | 30,510,000.00 | 8.30 |
| 3 | 136603 | 16 义市 01 | 300,000 | 30,114,000.00 | 8.20 |
| 4 | 163320 | 20 能源 03 | 300,000 | 29,790,000.00 | 8.11 |
| 5 | 163441 | 20 外高 01 | 300,000 | 29,532,000.00 | 8.04 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净 值比例 (%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|-------------------|
| 1 | 168613 | 智禾 01A | 100,000 | 10,000,000.00 | 2.72 |

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2019 年 12 月 17 日，国家外汇管理局深圳市分局对华侨城集团有限公司违反“《国家外汇管理局关于进一步简化和改进直接投资外汇管理政策的通知》第二条第三项”的行为作出“警告、罚款 3 万元”的行政处罚决定。

本基金投资 18 侨集 02 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 18 侨集 02 外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 71,789.99 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,087,258.30 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,539,461.56 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,698,509.85 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 易方达瑞川混合发 起式A | 易方达瑞川混合发 起式C |
|------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日基金份额总额 | 370,819,026.28 | 261,504.98 |
| 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（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 370,819,026.28 | 261,504.98 |

注：本基金合同生效日为 2020 年 04 月 22 日。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 易方达瑞川混合发起式 A | 易方达瑞川混合发起式 C |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日管理人持有的 的本基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 基金合同生效日起至报告期 期末买入/申购总份额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期 期末卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本 基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例 (%) | 2.6967 | - |

注：本基金合同生效日为 2020 年 04 月 22 日。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额 (份) | 交易金额 (元) | 适用费率 |
|----|------|----------------|---------------|---------------|------|
| 1 | 认购 | 2020-04-1 7 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 合计 | | | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | |

注：按照基金合同等相关法律文件的规定，该笔交易费用为 1000 元。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额 占基金总 份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额 占基金总 份额比例 | 发起份 额承诺 持有期 限 |
|-----------------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|------------------------|
| 基金管理人 固有资金 | 10,000,000.00 | 2.6948% | 10,000,000.00 | 2.6948% | 不少于 3 年 |
| 基金管理人 高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等 人员 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-------------|---------------|---------|---------------|---------|---|
| 基金管理人 股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 2.6948% | 10,000,000.00 | 2.6948% | - |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|-------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2020年04月22日~2020年06月30日 | 111,013,985.00 | - | - | 111,013,985.00 | 29.92% |
| | 2 | 2020年04月22日~2020年06月30日 | 89,999,000.00 | - | - | 89,999,000.00 | 24.25% |
| | 3 | 2020年04月22日~2020年06月30日 | 84,999,000.00 | - | - | 84,999,000.00 | 22.91% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，若个别投资者大额赎回后本基金出现连续五十个工作日基金资产净值低于5000万元，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。</p> | | | | | | | |

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达瑞川灵活配置混合型发起式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。

10.2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。

10.3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

二〇二〇年七月二十一日