

# 易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年中期报告

### 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| 1 重要提示及目录.....                               | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 目录.....                                  | 3  |
| 2 基金简介.....                                  | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| 3 主要财务指标和基金净值表现.....                         | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| 4 管理人报告.....                                 | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12 |
| 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.....             | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 14 |
| 5 托管人报告.....                                 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 15 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....                       | 15 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 15 |
| 6.2 利润表.....                                 | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 18 |
| 6.4 报表附注.....                                | 19 |
| 7 投资组合报告.....                                | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 37 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 37 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 38 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 40 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 41 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....      | 42 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 42 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....   | 42 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....      | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 43 |

|      |                                     |    |
|------|-------------------------------------|----|
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 43 |
| 7.12 | 投资组合报告附注 .....                      | 43 |
| 8    | 基金份额持有人信息 .....                     | 44 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 44 |
| 8.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 45 |
| 8.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..... | 45 |
| 9    | 开放式基金份额变动 .....                     | 45 |
| 10   | 重大事件揭示 .....                        | 45 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                   | 45 |
| 10.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 45 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 46 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                     | 46 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 46 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 46 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 46 |
| 10.8 | 其他重大事件 .....                        | 47 |
| 11   | 备查文件目录 .....                        | 49 |
| 11.1 | 备查文件目录 .....                        | 49 |
| 11.2 | 存放地点 .....                          | 49 |
| 11.3 | 查阅方式 .....                          | 49 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 易方达瑞和混合            |
| 基金主代码      | 001562             |
| 交易代码       | 001562             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2018年2月2日          |
| 基金管理人      | 易方达基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 交通银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 644,605,899.40 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   | 本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场因素、估值及流动性因素、政策因素等分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。本基金在行业分析、公司基本面分析及估值水平分析的基础上，进行股票组合的构建。当行业、公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时，本基金将对股票组合适时进行动态调整。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。 |
| 业绩比较基准 | 一年期人民币定期存款利率（税后）+2%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。  |

### 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           | 交通银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张南                    | 陆志俊               |
|             | 联系电话 | 020-85102688          | 95559             |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088          | 95559             |
| 传真          |      | 020-85104666          | 021-62701216      |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区宝华路6        | 中国（上海）自由贸易试验区银    |

|       |                               |                 |
|-------|-------------------------------|-----------------|
|       | 号105室-42891（集中办公区）            | 城中路188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 | 中国（上海）长宁区仙霞路18号 |
| 邮政编码  | 510620                        | 200336          |
| 法定代表人 | 刘晓艳                           | 任德奇             |

## 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  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼                                  |

## 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2020年1月1日至2020年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 66,327,702.57             |
| 本期利润          | 17,822,359.48             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0517                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.51%                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.84%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | 311,714,800.68            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.4836                    |
| 期末基金资产净值      | 956,320,700.08            |
| 期末基金份额净值      | 1.484                     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | 48.40%                    |

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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.41%    | 0.15%       | 0.31%      | 0.01%         | 0.10%  | 0.14% |
| 过去三个月      | 1.99%    | 0.16%       | 0.88%      | 0.01%         | 1.11%  | 0.15% |
| 过去六个月      | 6.84%    | 1.21%       | 1.77%      | 0.01%         | 5.07%  | 1.20% |
| 过去一年       | 33.94%   | 1.12%       | 3.56%      | 0.01%         | 30.38% | 1.11% |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 48.40%   | 1.11%       | 8.56%      | 0.01%         | 39.84% | 1.10% |

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

易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年2月2日至2020年6月30日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 48.40%，同期业绩比较基准收益率为

8.56%。

## 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，总部设在广州，在北京、上海、香港等地设有分公司或子公司。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、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局，为境内外客户提供包括标准化公募基金与定制化私募产品在内的资产管理解决方案。

#### 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、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达丰和债券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、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理（自 2018 年 01 月 30 日至 2020 年 03 月 06 日）、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理（自 2018 年 08 月 09 日至 2020 年 03 月 06 日）、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理（自 2018 年 11 月 07 日至 2020 年 03 月 06 日）、易方达新收益灵活配置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（自 2019 年 01 月 29 日至 2020 | 2018-02-07      | 2020-03-07 | 13 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、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。 |



|             |  |            |   |     |  |
|-------------|--|------------|---|-----|--|
|             | 年 03 月 06 日)、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理、混合资产投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员  |            |   |     |  |
| 韩<br>阅<br>川 | 本基金的基金经理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞兴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、易方达瑞智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、易方达新鑫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、易方达瑞选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、易方达瑞祺灵活配置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、易方达鑫转添利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、易方达丰惠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助理(自 2018 年 03 月 03 日至 2020 年 03 月 06 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 07 月 04 日至 2020 年 03 月 06 日)、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 | 2020-03-07 | - | 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、易方达瑞祥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、易方达新益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、易方达新鑫债券型证券投资基金基金经理助理。 |
| 胡<br>文<br>伯 | 本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、易方达丰惠混合型证券投资基金的基金经理助理(自 2018 年 07 月 31 日至 2020 年 06 月 09 日)、易方达稳健收益债券型证券投资基金   | 2018-11-23 | - | 6 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部高级研究员、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、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理  |

|    |   |            |   |     |  |
|----|---|------------|---|-----|--|
|    | <p>的基金经理助理、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、易方达瑞财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、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达安盈回报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、易方达双债增强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、易方达富惠纯债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达信用债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</p> |            |   |     | <p>助理、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、易方达瑞智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、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金基金经理助理。</p> |
| 周琼 | <p>本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、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达</p>   | 2019-10-11 | - | 6 年 | <p>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>  |

|   |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|
| <p>鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达富财纯债债券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、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数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、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金的基金经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达恒久添利 1 年定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理(自 2019 年 10 月 11 日至 2020 年 05 月 21 日)、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、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</p> |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|

|   |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|
| 经理助理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理 |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 59 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，债券市场先涨后跌，收益率整体大致呈 U 型走势。年初，突如其来的新冠疫情，打破了市场原有节奏。从 2 月开始，央行货币政策的边际放松，提供了充足的超额流动性，隔夜资金利率一度下探至 1% 以下的历史低位。由于海外疫情的爆发，避险情绪大幅升温，短端资金利率下行后带动长端跟随，利率债收益率大幅下行，10 年国债收益率从疫情前 1 月末的 3.0%，下行至 4 月初的低点 2.5%。信用利差跟随下行。进入二季度，疫情和经济在边际好转，社融也持续高增，货币政策也逐渐有所变化，开始强调直达实体经济，打击金融“空转套利”。央行的连续暂停公开市场操作，也使得隔夜资金利率从 1% 以下快速上行至 2% 左右的水平。与央行边际收紧相伴，债市也经历了 5-6 月的连续调整。“熊平”行情中大幅回吐了前期涨幅，10 年国债收益率回到了 3% 以上的水平。

上半年，在全球股票资产价格高度联动下，A 股市场波动起伏，疫情和流动性成为市场的核心矛盾。春节期间国内疫情爆发，需求大幅萎缩、经济环境恶化，终结了 A 股自 2019 年底开始提前演绎的春季躁动，上证指数大跌。随着防控措施快速有效的遏制住了疫情蔓延，2 月政治局会议逐渐倾向复工复产，货币信贷政策频频，流动性充裕，大类资产齐涨。然而 3 月海外疫情的蔓延引发了全球性的金融避险，也诱发了海外的流动性危机，A 股跟随海外市场再度显著回调至年内低点。到了二季度，稳增长明显加码，经济修复也有所加快，叠加在美联储的大幅宽松的货币政策下，海外情绪显著修复。风险偏好的整体提升也带动 A 股市场开始走牛，但结构上仍以成长板块占优，尤其以医药在整个上半年格外亮眼，并一直持续到半年末。

上半年本基金跟随市场变化进行大类资产配置的调整。债券方面整体以杠杆票息策略的偏绝对收益操作思路为主。权益部分在市场大幅变化下，进行了仓位上的调整，但整体仍以自下而上选股为主要策略。此外，组合积极参与科创板打新。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.484 元，本报告期份额净值增长率为 6.84%，同期业绩比较基准收益率为 1.77%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观基本面方面，国内经济或将继续稳步上修，在疫情不会超预期恶化的情况下，经济再度大幅恶化的风险有限。货币政策方面，政策发力点或仍将围绕如何更加切实有效地支撑实体经济展开。虽然二季度末央行有意引导资金利率水平上移，以打击监管套利，避免资金空转。但宽信用基调下，

整体流动性水平仍需维持充裕状态，且财政政策的投入也需要相对宽松的货币政策的环境支持。在保就业的底线思维下，居民收入水平向下波动的风险有限，消费增速仍有较充足的修复空间。海外经济体各项经济数据已现修复拐点，国际贸易链有望进一步恢复常态，国内货物资本项顺差大概率恢复对经济增长的正向贡献。

展望下半年，权益市场机会或大于债券市场。流动性充裕环境下仍利于权益市场的估值修复，经济慢复苏有望支撑盈利底企稳。债市方面，由于利率水平依然处于偏低水平，信用修复对债市构成较大压力。但货币政策收紧的可能性较小，收益率可能以震荡行情为主。

本基金仍将根据市场情况保留适度的权益仓位，均衡风格配置，自下而上精选个股，并积极参与打新。债券部分维持信用债杠杆的票息策略，减少长端利率的方向性博弈，并做好交易层面的止盈止损，力争以优异的业绩回报基金持有人。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，基金托管人在易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

报告期内，易方达基金管理有限公司在易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产      | 附注号     | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|---------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产：     |         |                        |                          |
| 银行存款    | 6.4.7.1 | 1,215,538.21           | 562,664.58               |
| 结算备付金   |         | 9,610,632.84           | 718,315.92               |
| 存出保证金   |         | 138,632.07             | 72,755.18                |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,107,299,556.01       | 294,579,896.43           |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其中：股票投资         |            | 144,005,804.81            | 272,757,095.79              |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | 911,293,751.20            | 21,822,800.64               |
| 资产支持证券投资        |            | 52,000,000.00             | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                         | -                           |
| 应收证券清算款         |            | 1,973,327.05              | 1,999,915.48                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 10,186,876.29             | 433,339.21                  |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 205,367.27                | 340,992.39                  |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 1,130,629,929.74          | 298,707,879.19              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2019年12月31日</b> |
| 负债：             |            |                           |                             |
| 短期借款            |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 170,000,000.00            | 2,500,000.00                |
| 应付证券清算款         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款           |            | 3,336,636.98              | 2,253,375.94                |
| 应付管理人报酬         |            | 453,765.61                | 148,851.75                  |
| 应付托管费           |            | 75,627.60                 | 24,808.64                   |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 79,939.34                 | 77,928.56                   |
| 应交税费            |            | 65,776.84                 | 514.52                      |
| 应付利息            |            | -                         | -42.26                      |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 297,483.29                | 263,502.21                  |
| 负债合计            |            | 174,309,229.66            | 5,268,939.36                |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 644,605,899.40            | 211,322,069.99              |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | 311,714,800.68            | 82,116,869.84               |
| 所有者权益合计         |            | 956,320,700.08            | 293,438,939.83              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,130,629,929.74          | 298,707,879.19              |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.484 元，基金份额总额 644,605,899.40 份。



## 6.2 利润表

会计主体：易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>21,599,836.87</b>                     | <b>89,186,968.04</b>                          |
| 1.利息收入                     |          | 5,841,238.42                             | 2,556,359.12                                  |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 70,879.25                                | 71,720.55                                     |
| 债券利息收入                     |          | 5,663,441.17                             | 2,430,982.97                                  |
| 资产支持证券利息收入                 |          | 39,741.58                                | 18,002.46                                     |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 67,176.42                                | 35,653.14                                     |
| 证券出借利息收入                   |          | -  | -   |
| 其他利息收入                     |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 63,385,489.77                            | 49,860,655.58                                 |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.12 | 60,299,092.77                            | 31,807,453.70                                 |
| 基金投资收益                     |          | -  | -   |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.13 | -59,913.67                               | 17,040,480.66                                 |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -  | 57,946.58                                     |
| 贵金属投资收益                    |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 股利收益                       | 6.4.7.15 | 3,146,310.67                             | 954,774.64                                    |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.16 | -48,505,343.09                           | 36,693,723.85                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.17 | 878,451.77                               | 76,229.49                                     |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>3,777,477.39</b>                      | <b>2,817,254.36</b>                           |
| 1. 管理人报酬                   |          | 1,512,013.66                             | 991,389.31                                    |
| 2. 托管费                     |          | 252,002.24                               | 165,231.60                                    |
| 3. 销售服务费                   |          | -  | -   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 1,211,953.07                             | 644,919.24                                    |
| 5. 利息支出                    |          | 655,301.68                               | 886,086.94                                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 655,301.68                               | 886,086.94                                    |
| 6. 税金及附加                   |          | 18,984.56                                | 7,130.75                                      |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 127,222.18                               | 122,496.52                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>17,822,359.48</b>                     | <b>86,369,713.68</b>                          |
| 减：所得税费用                    |          | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>17,822,359.48</b>                     | <b>86,369,713.68</b>                          |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日      |                 |                  |
|--|--|-----------------|------------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 211,322,069.99                             | 82,116,869.84   | 293,438,939.83   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 17,822,359.48   | 17,822,359.48    |
| 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）      | 433,283,829.41                             | 211,775,571.36  | 645,059,400.77   |
| 其中：1.基金申购款                             | 680,042,678.51                             | 322,354,898.23  | 1,002,397,576.74 |
| 2.基金赎回款                                | -246,758,849.10                            | -110,579,326.87 | -357,338,175.97  |
| 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）                        | 644,605,899.40                             | 311,714,800.68  | 956,320,700.08   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |                 |                  |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 547,986,323.84                             | -41,680,467.74  | 506,305,856.10   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 86,369,713.68   | 86,369,713.68    |
| 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）      | -355,664,891.14                            | -23,958,269.74  | -379,623,160.88  |
| 其中：1.基金申购款                             | 37,514,152.00                              | 3,844,652.67    | 41,358,804.67    |
| 2.基金赎回款                                | -393,179,043.14                            | -27,802,922.41  | -420,981,965.55  |
| 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）                        | 192,321,432.70                             | 20,730,976.20   | 213,052,408.90   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1261 号《关于准予易方达瑞和灵活配置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[2017]1119 号《关于易方达瑞和灵活配置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《易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 640,447,581.38 份基金份额,其中认购资金利息折合 127,659.30 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2020年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 1,215,538.21      |
| 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           | 1,215,538.21      |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020年6月30日 |                  |                |               |
|---------------|-------------------|------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                | 公允价值             | 公允价值变动         |               |
| 股票            | 134,689,915.58    | 144,005,804.81   | 9,315,889.23   |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -                | -              |               |
| 债券            | 交易所市场             | 259,220,160.32   | 256,323,051.20 | -2,897,109.12 |
|               | 银行间市场             | 660,345,752.74   | 654,970,700.00 | -5,375,052.74 |
|               | 合计                | 919,565,913.06   | 911,293,751.20 | -8,272,161.86 |
| 资产支持证券        | 52,000,000.00     | 52,000,000.00    | -              |               |
| 基金            | -                 | -                | -              |               |
| 其他            | -                 | -                | -              |               |
| 合计            | 1,106,255,828.64  | 1,107,299,556.01 | 1,043,727.37   |               |

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 261.53                 |
| 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  | 3,892.23               |
| 应收债券利息     | 10,141,732.77          |
| 应收资产支持证券利息 | 40,933.69              |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 应收出借证券利息   | -                      |
| 其他         | 56.07                  |
| 合计         | 10,186,876.29          |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 67,239.22              |
| 银行间市场应付交易费用 | 12,700.12              |
| 合计          | 79,939.34              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 4,975.69               |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 292,507.60             |
| 合计          | 297,483.29             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 211,322,069.99                        | 211,322,069.99  |
| 本期申购          | 680,042,678.51                        | 680,042,678.51  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -246,758,849.10                       | -246,758,849.10 |

|     |                |                |
|-----|----------------|----------------|
| 本期末 | 644,605,899.40 | 644,605,899.40 |
|-----|----------------|----------------|

注：申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

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           | 56,427,222.44   | 25,689,647.40  | 82,116,869.84   |
| 本期利润           | 66,327,702.57   | -48,505,343.09 | 17,822,359.48   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 212,923,301.86  | -1,147,730.50  | 211,775,571.36  |
| 其中：基金申购款       | 317,354,096.68  | 5,000,801.55   | 322,354,898.23  |
| 基金赎回款          | -104,430,794.82 | -6,148,532.05  | -110,579,326.87 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | 335,678,226.87  | -23,963,426.19 | 311,714,800.68  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 35,042.43                  |
| 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 | 35,029.73                  |
| 其他        | 807.09                     |
| 合计        | 70,879.25                  |

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 434,965,779.93             |
| 减：卖出股票成本总额 | 374,666,687.16             |
| 买卖股票差价收入   | 60,299,092.77              |

#### 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 201,147,297.84             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 199,510,168.89             |
| 减：应收利息总额                | 1,697,042.62               |

|          |            |
|----------|------------|
| 买卖债券差价收入 | -59,913.67 |
|----------|------------|

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 3,146,310.67               |
| 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            | 3,146,310.67               |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | -48,505,343.09             |
| ——股票投资                     | -39,808,024.62             |
| ——债券投资                     | -8,697,318.47              |
| ——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<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | -48,505,343.09             |

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 878,451.77                 |
| 其他      | -                          |
| 合计      | 878,451.77                 |

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|



|           |              |
|-----------|--------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,200,660.57 |
| 银行间市场交易费用 | 11,292.50    |
| 合计        | 1,211,953.07 |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 29,835.26                  |
| 信息披露费    | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金  | -                          |
| 银行汇划费    | 19,114.58                  |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00                  |
| 其他       | 600.00                     |
| 合计       | 127,222.18                 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系             |
|------------------------|---------------------|
| 易方达基金管理有限公司            | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期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。

###### 6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,512,013.66                   | 991,389.31                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 194,353.70                     | 428,181.31                          |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值基金管理费每日计提,按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月<br>30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 252,002.24                     | 165,231.60                          |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$  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。于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期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。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期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。

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

本基金本报告期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。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称     | 本期                   |           | 上年度可比期间              |           |
|-----------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
|           | 2020年1月1日至2020年6月30日 |           | 2019年1月1日至2019年6月30日 |           |
|           | 期末余额                 | 当期利息收入    | 期末余额                 | 当期利息收入    |
| 交通银行-活期存款 | 1,215,538.21         | 35,042.43 | 890,999.67           | 21,704.47 |

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

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

## 6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |          |          |          |    |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|----------|----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 300840               | 酷特智能 | 2020-06-30 | 2020-07-08 | 新股流通受限 | 5.94  | 5.94   | 1,185    | 7,038.90 | 7,038.90 | -  |
| 300843               | 胜蓝股份 | 2020-06-23 | 2020-07-02 | 新股流通受限 | 10.01 | 10.01  | 751      | 7,517.51 | 7,517.51 | -  |

|            |          |                |                |                |       |       |             |                  |                  |   |
|------------|----------|----------------|----------------|----------------|-------|-------|-------------|------------------|------------------|---|
| 30084<br>5 | 捷安<br>高科 | 2020-0<br>6-24 | 2020-0<br>7-03 | 新股<br>流通<br>受限 | 17.63 | 17.63 | 470         | 8,286.<br>10     | 8,286.<br>10     | - |
| 30084<br>6 | 首都<br>在线 | 2020-0<br>6-22 | 2020-0<br>7-01 | 新股<br>流通<br>受限 | 3.37  | 3.37  | 1,131       | 3,811.<br>47     | 3,811.<br>47     | - |
| 60181<br>6 | 京沪<br>高铁 | 2020-0<br>1-08 | 2020-0<br>7-16 | 新股<br>流通<br>受限 | 4.88  | 6.17  | 906,53<br>6 | 4,423,<br>895.68 | 5,593,<br>327.12 | - |
| 68802<br>7 | 国盾<br>量子 | 2020-0<br>6-30 | 2020-0<br>7-09 | 新股<br>流通<br>受限 | 36.18 | 36.18 | 2,830       | 102,38<br>9.40   | 102,38<br>9.40   | - |
| 68808<br>1 | 兴图<br>新科 | 2019-1<br>2-26 | 2020-0<br>7-06 | 新股<br>流通<br>受限 | 28.21 | 42.01 | 3,153       | 88,946<br>.13    | 132,45<br>7.53   | - |
| 68812<br>6 | 沪硅<br>产业 | 2020-0<br>4-13 | 2020-1<br>0-20 | 新股<br>流通<br>受限 | 3.89  | 26.34 | 135,62<br>5 | 527,58<br>1.25   | 3,572,<br>362.50 | - |
| 68818<br>6 | 广大<br>特材 | 2020-0<br>1-23 | 2020-0<br>8-11 | 新股<br>流通<br>受限 | 17.16 | 34.15 | 8,033       | 137,84<br>6.28   | 274,32<br>6.95   | - |
| 68818<br>9 | 南新<br>制药 | 2020-0<br>3-18 | 2020-0<br>9-28 | 新股<br>流通<br>受限 | 34.94 | 50.21 | 6,833       | 238,74<br>5.02   | 343,08<br>4.93   | - |
| 68827<br>7 | 天智<br>航  | 2020-0<br>6-24 | 2020-0<br>7-07 | 新股<br>流通<br>受限 | 12.04 | 12.04 | 8,810       | 106,07<br>2.40   | 106,07<br>2.40   | - |
| 68837<br>7 | 迪威<br>尔  | 2020-0<br>6-29 | 2020-0<br>7-08 | 新股<br>流通<br>受限 | 16.42 | 16.42 | 7,894       | 129,61<br>9.48   | 129,61<br>9.48   | - |
| 68851<br>8 | 联赢<br>激光 | 2020-0<br>6-12 | 2020-1<br>2-22 | 新股<br>流通<br>受限 | 7.81  | 20.83 | 14,111      | 110,20<br>6.91   | 293,93<br>2.13   | - |
| 68856<br>8 | 中科<br>星图 | 2020-0<br>6-30 | 2020-0<br>7-08 | 新股<br>流通<br>受限 | 16.21 | 16.21 | 11,020      | 178,63<br>4.20   | 178,63<br>4.20   | - |
| 68859<br>9 | 天合<br>光能 | 2020-0<br>6-02 | 2020-1<br>2-10 | 新股<br>流通<br>受限 | 8.16  | 13.91 | 92,213      | 752,45<br>8.08   | 1,282,<br>682.83 | - |
| 68860<br>0 | 皖仪<br>科技 | 2020-0<br>6-23 | 2020-0<br>7-03 | 新股<br>流通<br>受限 | 15.50 | 15.50 | 5,468       | 84,754<br>.00    | 84,754<br>.00    | - |
| 30065<br>7 | 弘信<br>电子 | 2019-0<br>9-10 | 2020-0<br>9-11 | 非公<br>开发       | 23.83 | 18.87 | 155,79<br>0 | 2,249,<br>980.94 | 2,939,<br>757.30 | - |

|                                 |        |            |            | 行<br>流<br>通<br>受<br>限      |                  |                            |                                  |                            |                            |        |
|---------------------------------|--------|------------|------------|----------------------------|------------------|----------------------------|----------------------------------|----------------------------|----------------------------|--------|
| 300657                          | 弘信电子   | 2019-09-10 | 2021-09-13 | 非公开发<br>行流<br>通受<br>限      | 23.83            | 17.27                      | 155,791                          | 2,250,004.77               | 2,690,510.57               | -      |
| <b>6.4.12.1.2 受限证券类别：资产支持证券</b> |        |            |            |                            |                  |                            |                                  |                            |                            |        |
| 证券代码                            | 证券名称   | 成功认购日      | 可流通日       | 流<br>通<br>受<br>限<br>类<br>型 | 认<br>购<br>价<br>格 | 期<br>末<br>估<br>值<br>单<br>价 | 数<br>量<br>(<br>单<br>位<br>:<br>张) | 期<br>末<br>成<br>本<br>总<br>额 | 期<br>末<br>估<br>值<br>总<br>额 | 备<br>注 |
| 138809                          | 厚德04A  | 2020-06-11 | 2020-07-15 | 新发<br>流<br>通<br>受<br>限     | 100.00           | 100.00                     | 120,000                          | 12,000,000.00              | 12,000,000.00              | -      |
| 138885                          | 荟享041A | 2020-06-23 | 2020-07-17 | 新发<br>流<br>通<br>受<br>限     | 100.00           | 100.00                     | 100,000                          | 10,000,000.00              | 10,000,000.00              | -      |
| 168589                          | 天信7A   | 2020-06-22 | 2020-08-07 | 新发<br>流<br>通<br>受<br>限     | 100.00           | 100.00                     | 100,000                          | 10,000,000.00              | 10,000,000.00              | -      |
| 168608                          | 健弘04A  | 2020-06-23 | 2020-07-13 | 新发<br>流<br>通<br>受<br>限     | 100.00           | 100.00                     | 100,000                          | 10,000,000.00              | 10,000,000.00              | -      |
| 168613                          | 智禾01A  | 2020-06-16 | 2020-07-07 | 新发<br>流<br>通<br>受<br>限     | 100.00           | 100.00                     | 100,000                          | 10,000,000.00              | 10,000,000.00              | -      |

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 170,000,000.00 元，于 2020 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内

持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 96.67%(2019 年 12 月 31 日：2.38%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 50,465,890.71     | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 99,014,906.76     | 15,267,695.01       |
| 合计     | 149,480,797.47    | 15,267,695.01       |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019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                |

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019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                |

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 648,177,673.61    | 2,268,926.62        |
| AAA 以下 | 123,777,012.89    | 4,718,523.36        |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 771,954,686.50    | 6,987,449.98        |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 52,040,933.69     | 0.00                |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 52,040,933.69     | 0.00                |

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年度末<br>2019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                |

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|-------|-------|-------|-----|----|
|     |       |       |       |     |    |



|            |                |                |   |                |                  |
|------------|----------------|----------------|---|----------------|------------------|
| 2020年6月30日 |                |                |   |                |                  |
| 资产         |                |                |   |                |                  |
| 银行存款       | 1,215,538.21   | -              | - | -              | 1,215,538.21     |
| 结算备付金      | 9,610,632.84   | -              | - | -              | 9,610,632.84     |
| 存出保证金      | 138,632.07     | -              | - | -              | 138,632.07       |
| 交易性金融资产    | 251,363,700.00 | 711,930,051.20 | - | 144,005,804.81 | 1,107,299,556.01 |
| 衍生金融资产     | -              | -              | - | -              | -                |
| 买入返售金融资产   | -              | -              | - | -              | -                |
| 应收证券清算款    | -              | -              | - | 1,973,327.05   | 1,973,327.05     |
| 应收利息       | -              | -              | - | 10,186,876.29  | 10,186,876.29    |
| 应收股利       | -              | -              | - | -              | -                |
| 应收申购款      | -              | -              | - | 205,367.27     | 205,367.27       |
| 递延所得税资产    | -              | -              | - | -              | -                |
| 其他资产       | -              | -              | - | -              | -                |
| 资产总计       | 262,328,503.12 | 711,930,051.20 | - | 156,371,375.42 | 1,130,629,929.74 |
| 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  | 170,000,000.00 | -              | - | -              | 170,000,000.00   |
| 应付证券清算款    | -              | -              | - | -              | -                |
| 应付赎回款      | -              | -              | - | 3,336,636.98   | 3,336,636.98     |
| 应付管理人报酬    | -              | -              | - | 453,765.61     | 453,765.61       |
| 应付托管费      | -              | -              | - | 75,627.60      | 75,627.60        |
| 应付销售服务费    | -              | -              | - | -              | -                |
| 应付交易费用     | -              | -              | - | 79,939.34      | 79,939.34        |
| 应交税费       | -              | -              | - | 65,776.84      | 65,776.84        |
| 应付利息       | -              | -              | - | -              | -                |
| 应付利润       | -              | -              | - | -              | -                |
| 递延所得税负债    | -              | -              | - | -              | -                |
| 其他负债       | -              | -              | - | 297,483.29     | 297,483.29       |
| 负债总计       | 170,000,000.00 | -              | - | 4,309,229.66   | 174,309,229.66   |
| 利率敏感度缺口    | 92,328,503.12  | 711,930,051.20 | - | 152,062,145.76 | 956,320,700.08   |

| 上年度末<br>2019 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内         | 1-5 年        | 5 年以上        | 不计息            | 合计             |
|-----------------------------|---------------|--------------|--------------|----------------|----------------|
| 资产                          |               |              |              |                |                |
| 银行存款                        | 562,664.58    | -            | -            | -              | 562,664.58     |
| 结算备付金                       | 718,315.92    | -            | -            | -              | 718,315.92     |
| 存出保证金                       | 72,755.18     | -            | -            | -              | 72,755.18      |
| 交易性金融资产                     | 15,005,970.00 | 4,154,656.60 | 2,662,174.04 | 272,757,095.79 | 294,579,896.43 |
| 衍生金融资产                      | -             | -            | -            | -              | -              |
| 买入返售金融资产                    | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应收证券清算款                     | -             | -            | -            | 1,999,915.48   | 1,999,915.48   |
| 应收利息                        | -             | -            | -            | 433,339.21     | 433,339.21     |
| 应收股利                        | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应收申购款                       | -             | -            | -            | 340,992.39     | 340,992.39     |
| 递延所得税资产                     | -             | -            | -            | -              | -              |
| 其他资产                        | -             | -            | -            | -              | -              |
| 资产总计                        | 16,359,705.68 | 4,154,656.60 | 2,662,174.04 | 275,531,342.87 | 298,707,879.19 |
| 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                   | 2,500,000.00  | -            | -            | -              | 2,500,000.00   |
| 应付证券清算款                     | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应付赎回款                       | -             | -            | -            | 2,253,375.94   | 2,253,375.94   |
| 应付管理人报酬                     | -             | -            | -            | 148,851.75     | 148,851.75     |
| 应付托管费                       | -             | -            | -            | 24,808.64      | 24,808.64      |
| 应付销售服务费                     | -             | -            | -            | -              | -              |
| 应付交易费用                      | -             | -            | -            | 77,928.56      | 77,928.56      |
| 应交税费                        | -             | -            | -            | 514.52         | 514.52         |
| 应付利息                        | -             | -            | -            | -42.26         | -42.26         |
| 应付利润                        | -             | -            | -            | -              | -              |
| 递延所得税负债                     | -             | -            | -            | -              | -              |
| 其他负债                        | -             | -            | -            | 263,502.21     | 263,502.21     |
| 负债总计                        | 2,500,000.00  | -            | -            | 2,768,939.36   | 5,268,939.36   |
| 利率敏感度缺口                     | 13,859,705.68 | 4,154,656.60 | 2,662,174.04 | 272,762,403.51 | 293,438,939.8  |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设            | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|---------------|--------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析            | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                     |
|               |                    | 本期末<br>2020年6月30日           | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|               | 1.市场利率下降25个基点      | 5,208,612.35                | 25,863.52           |
| 2.市场利率上升25个基点 | -5,145,180.06      | -25,778.87                  |                     |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020年6月30日 |                          | 上年度末<br>2019年12月31日 |                          |
|---------------|-------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值              | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 144,005,804.81    | 15.06                    | 272,757,095.79      | 92.95                    |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                 | -                        | -                   | -                        |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                 | -                        | -                   | -                        |
| 其他            | -                 | -                        | -                   | -                        |

|    |                |       |                |       |
|----|----------------|-------|----------------|-------|
| 合计 | 144,005,804.81 | 15.06 | 272,757,095.79 | 92.95 |
|----|----------------|-------|----------------|-------|

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                     |
|----|----------------------|---------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                     |
|    |                      | 本期末<br>2020年6月30日               | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|    | 1.业绩比较基准上升 5%        | 6,298,594.56                    | 13,987,511.86       |
|    | 2.业绩比较基准下降 5%        | -6,298,594.56                   | -13,987,511.86      |

注：股票投资业绩基准取沪深 300 指数。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 126,255,239.49 元，属于第二层次的余额为 981,044,316.52 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 250,370,236.14 元，第二层次 44,209,660.29 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

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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 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)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 144,005,804.81   | 12.74         |
|    | 其中：股票             | 144,005,804.81   | 12.74         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 963,293,751.20   | 85.20         |
|    | 其中：债券             | 911,293,751.20   | 80.60         |
|    | 资产支持证券            | 52,000,000.00    | 4.60          |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 10,826,171.05    | 0.96          |
| 8  | 其他各项资产            | 12,504,202.68    | 1.11          |
| 9  | 合计                | 1,130,629,929.74 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 |
|----|------|----------|-----------|
|----|------|----------|-----------|

|   |                  |                | (%)   |
|---|------------------|----------------|-------|
| A | 农、林、牧、渔业         | -              | -     |
| B | 采矿业              | 5,873,240.00   | 0.61  |
| C | 制造业              | 90,855,921.60  | 9.50  |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,952,382.32   | 0.73  |
| E | 建筑业              | 5,742,126.00   | 0.60  |
| F | 批发和零售业           | -              | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 15,489,298.12  | 1.62  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 190,731.77     | 0.02  |
| J | 金融业              | 5,779,209.00   | 0.60  |
| K | 房地产业             | 13,122,896.00  | 1.37  |
| 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          | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -              | -     |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 144,005,804.81 | 15.06 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值         | 占基金资产净值<br>比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|------------------|
| 1  | 601877 | 正泰电器 | 277,300 | 7,306,855.00 | 0.76             |
| 2  | 600900 | 长江电力 | 366,400 | 6,939,616.00 | 0.73             |
| 3  | 600048 | 保利地产 | 453,900 | 6,708,642.00 | 0.70             |
| 4  | 600585 | 海螺水泥 | 120,400 | 6,370,364.00 | 0.67             |
| 5  | 600066 | 宇通客车 | 508,364 | 6,202,040.80 | 0.65             |
| 6  | 600377 | 宁沪高速 | 625,500 | 6,136,155.00 | 0.64             |
| 7  | 600104 | 上汽集团 | 359,000 | 6,099,410.00 | 0.64             |
| 8  | 601088 | 中国神华 | 409,000 | 5,873,240.00 | 0.61             |

|    |        |       |           |              |      |
|----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 9  | 601668 | 中国建筑  | 1,203,800 | 5,742,126.00 | 0.60 |
| 10 | 300657 | 弘信电子  | 311,581   | 5,630,267.87 | 0.59 |
| 11 | 601816 | 京沪高铁  | 906,536   | 5,593,327.12 | 0.58 |
| 12 | 000651 | 格力电器  | 78,600    | 4,446,402.00 | 0.46 |
| 13 | 002601 | 龙蟠佰利  | 212,700   | 3,934,950.00 | 0.41 |
| 14 | 000002 | 万科 A  | 149,600   | 3,910,544.00 | 0.41 |
| 15 | 000858 | 五粮液   | 22,700    | 3,884,424.00 | 0.41 |
| 16 | 002142 | 宁波银行  | 146,300   | 3,843,301.00 | 0.40 |
| 17 | 688126 | 沪硅产业  | 135,625   | 3,572,362.50 | 0.37 |
| 18 | 002242 | 九阳股份  | 91,700    | 3,417,659.00 | 0.36 |
| 19 | 002078 | 太阳纸业  | 350,100   | 3,332,952.00 | 0.35 |
| 20 | 002352 | 顺丰控股  | 59,100    | 3,232,770.00 | 0.34 |
| 21 | 000538 | 云南白药  | 33,800    | 3,170,778.00 | 0.33 |
| 22 | 000333 | 美的集团  | 50,900    | 3,043,311.00 | 0.32 |
| 23 | 002597 | 金禾实业  | 132,100   | 3,034,337.00 | 0.32 |
| 24 | 000157 | 中联重科  | 464,900   | 2,989,307.00 | 0.31 |
| 25 | 000895 | 双汇发展  | 64,400    | 2,968,196.00 | 0.31 |
| 26 | 300628 | 亿联网络  | 39,750    | 2,713,335.00 | 0.28 |
| 27 | 002311 | 海大集团  | 56,900    | 2,707,871.00 | 0.28 |
| 28 | 002475 | 立讯精密  | 50,309    | 2,583,367.15 | 0.27 |
| 29 | 002146 | 荣盛发展  | 309,100   | 2,503,710.00 | 0.26 |
| 30 | 000338 | 潍柴动力  | 181,500   | 2,490,180.00 | 0.26 |
| 31 | 000581 | 威孚高科  | 117,600   | 2,431,968.00 | 0.25 |
| 32 | 000063 | 中兴通讯  | 52,200    | 2,094,786.00 | 0.22 |
| 33 | 601939 | 建设银行  | 306,800   | 1,935,908.00 | 0.20 |
| 34 | 600519 | 贵州茅台  | 1,000     | 1,462,880.00 | 0.15 |
| 35 | 688599 | 天合光能  | 92,213    | 1,282,682.83 | 0.13 |
| 36 | 603806 | 福斯特   | 21,800    | 1,088,038.00 | 0.11 |
| 37 | 002304 | 洋河股份  | 9,300     | 977,802.00   | 0.10 |
| 38 | 000429 | 粤高速 A | 75,400    | 527,046.00   | 0.06 |
| 39 | 688189 | 南新制药  | 6,833     | 343,084.93   | 0.04 |
| 40 | 688518 | 联赢激光  | 14,111    | 293,932.13   | 0.03 |
| 41 | 688186 | 广大特材  | 8,033     | 274,326.95   | 0.03 |
| 42 | 688568 | 中科星图  | 11,020    | 178,634.20   | 0.02 |
| 43 | 688081 | 兴图新科  | 3,153     | 132,457.53   | 0.01 |
| 44 | 688377 | 迪威尔   | 7,894     | 129,619.48   | 0.01 |
| 45 | 603087 | 甘李药业  | 1,076     | 107,922.80   | 0.01 |
| 46 | 688277 | 天智航   | 8,810     | 106,072.40   | 0.01 |
| 47 | 688027 | 国盾量子  | 2,830     | 102,389.40   | 0.01 |
| 48 | 688600 | 皖仪科技  | 5,468     | 84,754.00    | 0.01 |
| 49 | 300842 | 帝科股份  | 455       | 18,527.60    | 0.00 |
| 50 | 600956 | 新天绿能  | 2,533     | 12,766.32    | 0.00 |
| 51 | 300839 | 博汇股份  | 502       | 11,751.82    | 0.00 |
| 52 | 300845 | 捷安高科  | 470       | 8,286.10     | 0.00 |

|    |        |      |       |          |      |
|----|--------|------|-------|----------|------|
| 53 | 300843 | 胜蓝股份 | 751   | 7,517.51 | 0.00 |
| 54 | 300840 | 酷特智能 | 1,185 | 7,038.90 | 0.00 |
| 55 | 300846 | 首都在线 | 1,131 | 3,811.47 | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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  | 603786 | 科博达  | 19,331,043.34 | 6.59            |
| 2  | 600066 | 宇通客车 | 13,784,593.00 | 4.70            |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 8,151,825.80  | 2.78            |
| 4  | 002884 | 凌霄泵业 | 8,014,295.00  | 2.73            |
| 5  | 002402 | 和而泰  | 7,958,146.00  | 2.71            |
| 6  | 600048 | 保利地产 | 7,448,155.00  | 2.54            |
| 7  | 600486 | 扬农化工 | 7,271,892.00  | 2.48            |
| 8  | 300115 | 长盈精密 | 7,108,181.72  | 2.42            |
| 9  | 601877 | 正泰电器 | 7,086,443.30  | 2.41            |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 6,742,524.94  | 2.30            |
| 11 | 600104 | 上汽集团 | 6,546,563.00  | 2.23            |
| 12 | 601816 | 京沪高铁 | 6,319,848.88  | 2.15            |
| 13 | 002236 | 大华股份 | 6,314,259.24  | 2.15            |
| 14 | 002250 | 联化科技 | 6,203,241.00  | 2.11            |
| 15 | 601668 | 中国建筑 | 6,199,570.00  | 2.11            |
| 16 | 600900 | 长江电力 | 6,197,270.00  | 2.11            |
| 17 | 601799 | 星宇股份 | 6,156,936.82  | 2.10            |
| 18 | 601088 | 中国神华 | 6,052,090.00  | 2.06            |
| 19 | 600377 | 宁沪高速 | 5,998,071.00  | 2.04            |
| 20 | 601899 | 紫金矿业 | 5,441,427.00  | 1.85            |

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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  | 300628 | 亿联网络 | 24,870,695.51 | 8.48            |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 23,467,916.84 | 8.00            |
| 3  | 600486 | 扬农化工 | 20,617,853.27 | 7.03            |
| 4  | 002250 | 联化科技 | 20,213,562.42 | 6.89            |
| 5  | 603259 | 药明康德 | 19,833,243.04 | 6.76            |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 19,375,689.86 | 6.60            |



|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 7  | 000860 | 顺鑫农业 | 18,661,223.36 | 6.36 |
| 8  | 603786 | 科博达  | 18,400,779.06 | 6.27 |
| 9  | 603806 | 福斯特  | 17,547,451.78 | 5.98 |
| 10 | 601012 | 隆基股份 | 17,462,389.30 | 5.95 |
| 11 | 600703 | 三安光电 | 16,812,883.57 | 5.73 |
| 12 | 600004 | 白云机场 | 16,369,213.99 | 5.58 |
| 13 | 002415 | 海康威视 | 14,325,508.36 | 4.88 |
| 14 | 600066 | 宇通客车 | 14,288,674.66 | 4.87 |
| 15 | 601318 | 中国平安 | 12,499,829.00 | 4.26 |
| 16 | 600009 | 上海机场 | 11,522,266.00 | 3.93 |
| 17 | 603986 | 兆易创新 | 10,870,371.50 | 3.70 |
| 18 | 002884 | 凌霄泵业 | 8,772,696.00  | 2.99 |
| 19 | 600741 | 华域汽车 | 8,383,124.00  | 2.86 |
| 20 | 002402 | 和而泰  | 7,120,866.42  | 2.43 |
| 21 | 600519 | 贵州茅台 | 6,506,526.46  | 2.22 |
| 22 | 600886 | 国投电力 | 6,044,908.00  | 2.06 |
| 23 | 300115 | 长盈精密 | 5,890,977.14  | 2.01 |

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 285,723,420.80 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 434,965,779.93 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 国家债券      | 1,000,500.00   | 0.10             |
| 2  | 央行票据      | -              | -                |
| 3  | 金融债券      | 47,467,700.00  | 4.96             |
|    | 其中：政策性金融债 | 47,467,700.00  | 4.96             |
| 4  | 企业债券      | 273,787,647.20 | 28.63            |
| 5  | 企业短期融资券   | 99,938,000.00  | 10.45            |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 6  | 中期票据      | 489,040,000.00 | 51.14 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 59,904.00      | 0.01  |
| 8  | 同业存单      | -              | -     |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 911,293,751.20 | 95.29 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 042000045 | 20 鞍钢集 CP001  | 500,000 | 50,040,000.00 | 5.23         |
| 2  | 163458    | 20 新际 02      | 300,000 | 29,640,000.00 | 3.10         |
| 3  | 102000716 | 20 深业 MTN002  | 300,000 | 29,487,000.00 | 3.08         |
| 4  | 160206    | 16 国开 06      | 250,000 | 25,122,500.00 | 2.63         |
| 5  | 101901273 | 19 陕有色 MTN003 | 200,000 | 20,602,000.00 | 2.15         |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量（份）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 138809 | 厚德 04A  | 120,000 | 12,000,000.00 | 1.25         |
| 2  | 138885 | 荟享 041A | 100,000 | 10,000,000.00 | 1.05         |
| 2  | 168589 | 天信 7A   | 100,000 | 10,000,000.00 | 1.05         |
| 2  | 168608 | 健弘 04A  | 100,000 | 10,000,000.00 | 1.05         |
| 2  | 168613 | 智禾 01A  | 100,000 | 10,000,000.00 | 1.05         |

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 2019 年 12 月 2 日，重庆渝中区税务局对中联重科股份有限公司未按照规定期限办理纳税申报和报送纳税资料的行为，作出行政处罚。

2019 年 11 月 18 日，北京市规划委员会石景山分局对首钢集团有限公司“因设计失误造成实测建筑面积超出规划许可建筑面积”的行为罚款额 58765.25 元。

本基金投资 19 中联重科 MTN001、19 首钢 MTN004 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 19 中联重科 MTN001、19 首钢 MTN004 外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 138,632.07    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,973,327.05  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 10,186,876.29 |
| 5  | 应收申购款   | 205,367.27    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | -             |
| 9 | 合计 | 12,504,202.68 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明  |
|----|--------|------|--------------|--------------|-----------|
| 1  | 300657 | 弘信电子 | 2,939,757.30 | 0.31         | 非公开发行流通受限 |
| 2  | 300657 | 弘信电子 | 2,690,510.57 | 0.28         | 非公开发行流通受限 |

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东以外的股东减持所持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%。持有上市公司非公开发行股份的股东，通过集中竞价交易减持该部分股份的，除遵守前款规定外，自股份解除限售之日起 12 个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 3,397    | 189,757.40 | 574,551,250.89 | 89.13% | 70,054,648.51 | 10.87% |

## 8.2 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 | 82,211.84 | 0.0128%  |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                |
|--------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2018年2月2日）基金份额总额 | 640,447,581.38 |
| 本报告期期初基金份额总额             | 211,322,069.99 |
| 本报告期基金总申购份额              | 680,042,678.51 |
| 减：本报告期基金总赎回份额            | 246,758,849.10 |
| 本报告期基金拆分变动份额             | -              |
| 本报告期末基金份额总额              | 644,605,899.40 |

## 10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2020 年 6 月 22 日发布公告，自 2020 年 6 月 22 日起聘任张坤先生、陈丽园女

士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|-------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|       |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 招商证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中信证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 太平洋证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 安信证券  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 申万宏源  | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 民生证券  | 1      | 149,380,843.05 | 21.22%       | 139,118.57 | 21.22%     | -  |
| 中泰证券  | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 海通证券  | 2      | 554,703,036.95 | 78.78%       | 516,594.90 | 78.78%     | -  |

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 债券交易           |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|-------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|       | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 招商证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中信证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 太平洋证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 安信证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 申万宏源  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 民生证券  | 390,735,157.10 | 85.81%       | 4,827,000,000.00 | 89.12%         | -    | -            |
| 中泰证券  | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 海通证券  | 64,605,700.33  | 14.19%       | 589,200,000.00   | 10.88%         | -    | -            |

#### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                | 法定披露方式 | 法定披露日期     |
|----|-------------------------------------|--------|------------|
| 1  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告 | 证券时报   | 2020-01-18 |

|    |  |                            |            |
|----|--|----------------------------|------------|
| 2  | 易方达基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年 1 月 31 日不开放申购、赎回、转换、定期定额投资等业务的提示性公告 | 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 | 2020-01-30 |
| 3  | 易方达基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告                               | 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 | 2020-02-04 |
| 4  | 易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、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 | 2020-03-03 |
| 5  | 易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                                   | 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 | 2020-03-07 |
| 6  | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加百度百盈费率优惠活动的公告                          | 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 | 2020-03-10 |
| 7  | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加华瑞保险销售为销售机构、参加华瑞保险销售费率优惠活动的公告          | 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 | 2020-03-23 |
| 8  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年年度报告提示性公告                              | 证券时报                       | 2020-03-31 |
| 9  | 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 | 2020-04-10 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告                          | 证券时报                       | 2020-04-21 |
| 11 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中信证券华南为销售机构的公告                         | 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 | 2020-04-30 |
| 12 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加华夏财富费率优惠活动的公告                          | 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 | 2020-05-23 |
| 13 | 易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金在招商银行最低定期定额投资金额限制的公告                 | 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 | 2020-06-04 |
| 14 | 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 | 2020-06-22 |
| 15 | 易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金在非直销销售机构、网上直销系统暂停大额申购、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 | 2020-06-24 |



## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十八日