

# 易方达新益灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年三月三十日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 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。

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|     |  |    |
|-----|--|----|
| § 1 | 重要提示及目录.....                             | 2  |
| 1.1 | 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 | 目录.....                                  | 3  |
| § 2 | 基金简介.....                                | 5  |
| 2.1 | 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 | 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 | 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 | 其他相关资料.....                              | 6  |
| § 3 | 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                | 7  |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 | 基金净值表现.....                              | 8  |
| 3.3 | 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 11 |
| § 4 | 管理人报告.....                               | 11 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 15 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 15 |
| 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.....             | 16 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 17 |
| 4.6 | 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 18 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 19 |
| 4.8 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 20 |
| § 5 | 托管人报告.....                               | 20 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 20 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 20 |
| 5.3 | 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 20 |
| § 6 | 审计报告.....                                | 20 |
| 6.1 | 审计意见.....                                | 20 |
| 6.2 | 形成审计意见的基础.....                           | 21 |
| 6.3 | 管理层和治理层对财务报表的责任.....                     | 21 |
| 6.4 | 注册会计师对财务报表审计的责任.....                     | 21 |
| § 7 | 年度财务报表.....                              | 22 |
| 7.1 | 资产负债表.....                               | 22 |
| 7.2 | 利润表.....                                 | 24 |
| 7.3 | 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 25 |
| 7.4 | 报表附注.....                                | 27 |
| § 8 | 投资组合报告.....                              | 58 |
| 8.1 | 期末基金资产组合情况.....                          | 58 |
| 8.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 58 |
| 8.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 59 |
| 8.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 61 |
| 8.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 63 |

|      |   |    |
|------|---|----|
| 8.6  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 63 |
| 8.7  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 64 |
| 8.8  | 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 64 |
| 8.9  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 64 |
| 8.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....              | 64 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....              | 64 |
| 8.12 | 投资组合报告附注 .....                          | 64 |
| § 9  | 基金份额持有人信息 .....                         | 66 |
| 9.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 66 |
| 9.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 66 |
| 9.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 66 |
| § 10 | 开放式基金份额变动 .....                         | 67 |
| § 11 | 重大事件揭示 .....                            | 67 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                       | 67 |
| 11.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....       | 67 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 67 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 .....                         | 68 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 68 |
| 11.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....          | 68 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                 | 68 |
| 11.8 | 其他重大事件 .....                            | 69 |
| § 12 | 影响投资者决策的其他重要信息 .....                    | 70 |
| 12.1 | 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 .....     | 70 |
| § 13 | 备查文件目录 .....                            | 71 |
| 13.1 | 备查文件目录 .....                            | 71 |
| 13.2 | 存放地点 .....                              | 71 |
| 13.3 | 查阅方式 .....                              | 71 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                 |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称            | 易方达新益灵活配置混合型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 易方达新益混合            |                 |
| 基金主代码           | 001314             |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                 |
| 基金合同生效日         | 2015 年 6 月 16 日    |                 |
| 基金管理人           | 易方达基金管理有限公司        |                 |
| 基金托管人           | 中国邮政储蓄银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 465,038,837.96 份   |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 易方达新益混合 I          | 易方达新益混合 E       |
| 下属分级基金的交易代码     | 001314             | 001315          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 383,985,497.05 份   | 81,053,340.91 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。  |
| 投资策略   | <p>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。股票投资策略方面，本基金将通过分析行业景气度和行业竞争格局，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置的基础上，本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。</p> <p>债券投资策略方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。</p> |
| 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   |

|  |                   |
|--|-------------------|
|  | 金，高于债券型基金和货币市场基金。 |
|--|-------------------|

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                            | 基金托管人                |
|-------------|------|----------------------------------|----------------------|
| 名称          |      | 易方达基金管理有限公司                      | 中国邮政储蓄银行股份有限公司       |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张南                               | 田东辉                  |
|             | 联系电话 | 020-85102688                     | 010-68858113         |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn            | tiandonghui@psbc.com |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088                     | 95580                |
| 传真          |      | 020-85104666                     | 010-68858120         |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区） | 北京市西城区金融大街3号         |
| 办公地址        |      | 广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼    | 北京市西城区金融大街3号A座       |
| 邮政编码        |      | 510620                           | 100808               |
| 法定代表人       |      | 刘晓艳                              | 张金良                  |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报   |
| 登载基金年度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> |
| 基金年度报告备置地点          | 广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼                                  |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                              |
|--------|----------------------|-----------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼           |
| 注册登记机构 | 易方达基金管理有限公司          | 广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间<br>数据和指<br>标    | 2020 年             |                    | 2019 年             |                   | 2018 年             |               |
|--------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|-------------------|--------------------|---------------|
|                          | 易方达新益<br>混合 I      | 易方达新益<br>混合 E      | 易方达新益<br>混合 I      | 易方达新益<br>混合 E     | 易方达新益<br>混合 I      | 易方达新益混<br>合 E |
| 本期已<br>实现收<br>益          | 77,779,590.<br>01  | 21,536,679.<br>58  | 25,830,827.8<br>8  | 4,227,790.30      | 58,200,536.7<br>7  | 1,842,551.00  |
| 本期利<br>润                 | 151,526,758<br>.77 | 45,131,228.<br>11  | 47,327,756.9<br>0  | 6,969,159.96      | 12,812,090.6<br>2  | 269,874.08    |
| 加权平<br>均基金<br>份额本<br>期利润 | 0.5219             | 0.7156             | 0.2771             | 0.3261            | 0.0354             | 0.0258        |
| 本期加<br>权平均<br>净值利<br>润率  | 27.32%             | 27.91%             | 17.96%             | 15.75%            | 2.56%              | 1.40%         |
| 本期基<br>金份额<br>净值增<br>长率  | 30.79%             | 30.53%             | 18.75%             | 18.49%            | 1.31%              | 1.15%         |
| 3.1.2 期末<br>数据和指<br>标    | 2020 年末            |                    | 2019 年末            |                   | 2018 年末            |               |
|                          | 易方达新益混<br>合 I      | 易方达新益混<br>合 E      | 易方达新益混<br>合 I      | 易方达新益混<br>合 E     | 易方达新益混<br>合 I      | 易方达新益混合<br>E  |
| 期末可<br>供分配<br>利润         | 330,655,309<br>.69 | 119,206,116<br>.93 | 126,225,600.<br>10 | 30,242,494.1<br>6 | 71,958,524.3<br>4  | 7,305,530.54  |
| 期末可<br>供分配<br>基金份<br>额利润 | 0.8611             | 1.4707             | 0.5836             | 1.1066            | 0.3920             | 0.8548        |
| 期末基<br>金资产<br>净值         | 830,016,690<br>.17 | 232,568,487<br>.31 | 357,567,020.<br>28 | 60,080,650.1<br>0 | 255,534,093.<br>30 | 15,851,834.52 |
| 期末基<br>金份额<br>净值         | 2.162              | 2.869              | 1.653              | 2.198             | 1.392              | 1.855         |
| 3.1.3 累计<br>期末指标         | 2020 年末            |                    | 2019 年末            |                   | 2018 年末            |               |
|                          | 易方达新益              | 易方达新益              | 易方达新益              | 易方达新益             | 易方达新益              | 易方达新益混        |

|             | 混合 I    | 混合 E    | 混合 I   | 混合 E    | 混合 I   | 合 E    |
|-------------|---------|---------|--------|---------|--------|--------|
| 基金份额累计净值增长率 | 116.20% | 186.90% | 65.30% | 119.80% | 39.20% | 85.50% |

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

##### 易方达新益混合 I

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 8.86%    | 0.50%       | 0.89%      | 0.01%         | 7.97%  | 0.49% |
| 过去六个月      | 16.55%   | 0.60%       | 1.79%      | 0.01%         | 14.76% | 0.59% |
| 过去一年       | 30.79%   | 0.61%       | 3.56%      | 0.01%         | 27.23% | 0.60% |
| 过去三年       | 57.35%   | 0.46%       | 10.66%     | 0.01%         | 46.69% | 0.45% |
| 过去五年       | 115.55%  | 0.59%       | 17.76%     | 0.01%         | 97.79% | 0.58% |
| 自基金合同生效起至今 | 116.20%  | 0.56%       | 19.85%     | 0.01%         | 96.35% | 0.55% |

##### 易方达新益混合 E

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 8.80%    | 0.50%       | 0.89%      | 0.01%         | 7.91%   | 0.49% |
| 过去六个月      | 16.44%   | 0.60%       | 1.79%      | 0.01%         | 14.65%  | 0.59% |
| 过去一年       | 30.53%   | 0.61%       | 3.56%      | 0.01%         | 26.97%  | 0.60% |
| 过去三年       | 56.43%   | 0.46%       | 10.66%     | 0.01%         | 45.77%  | 0.45% |
| 过去五年       | 186.90%  | 1.60%       | 17.76%     | 0.01%         | 169.14% | 1.59% |
| 自基金合同生效起至今 | 186.90%  | 1.52%       | 19.85%     | 0.01%         | 167.05% | 1.51% |

#### 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

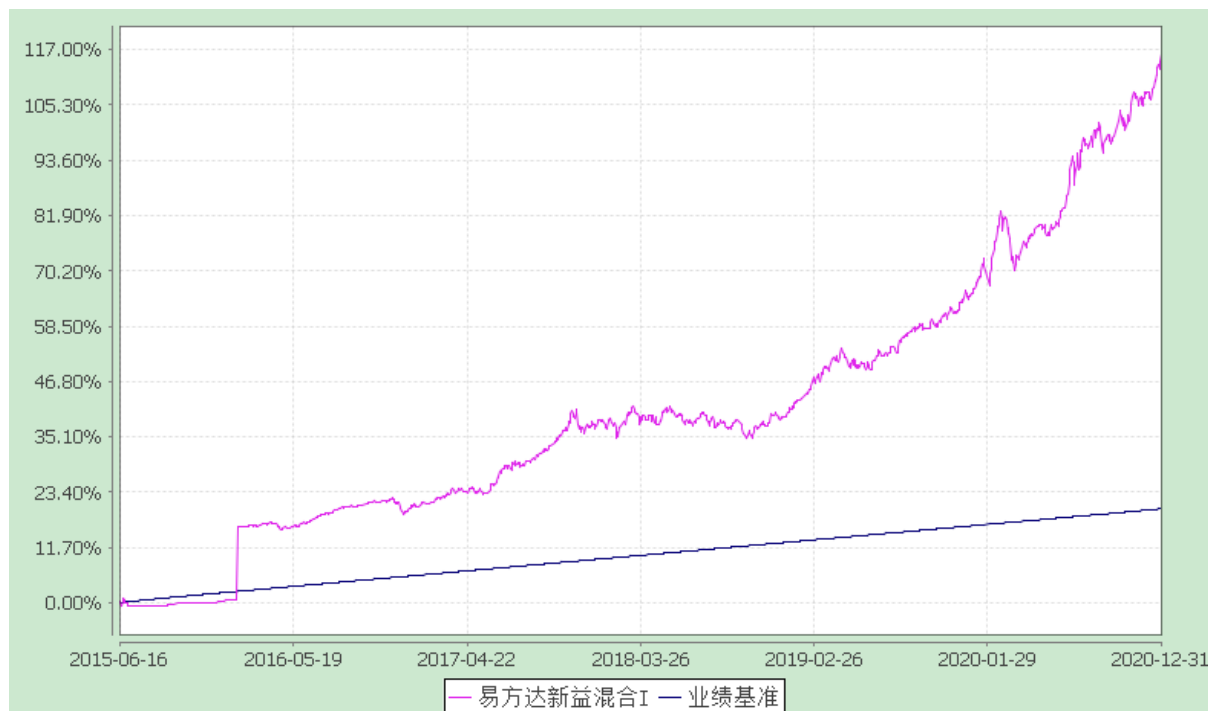


易方达新益灵活配置混合型证券投资基金

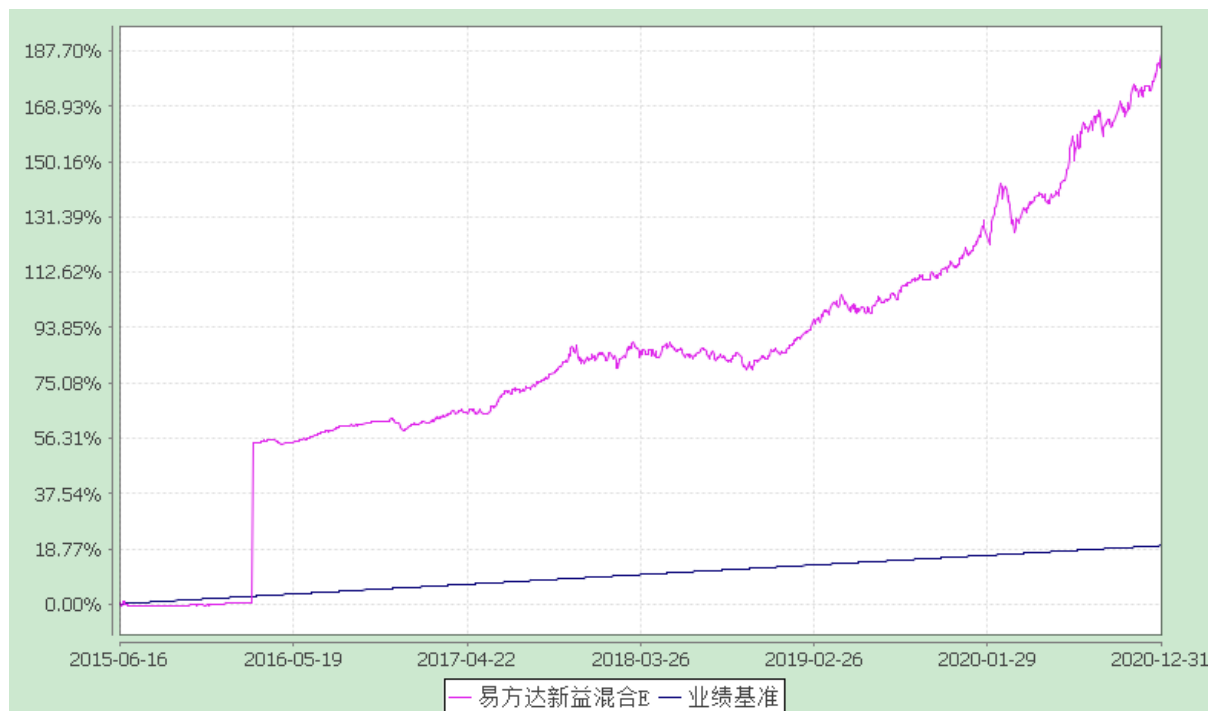
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 6 月 16 日至 2020 年 12 月 31 日)

易方达新益混合 I



易方达新益混合 E



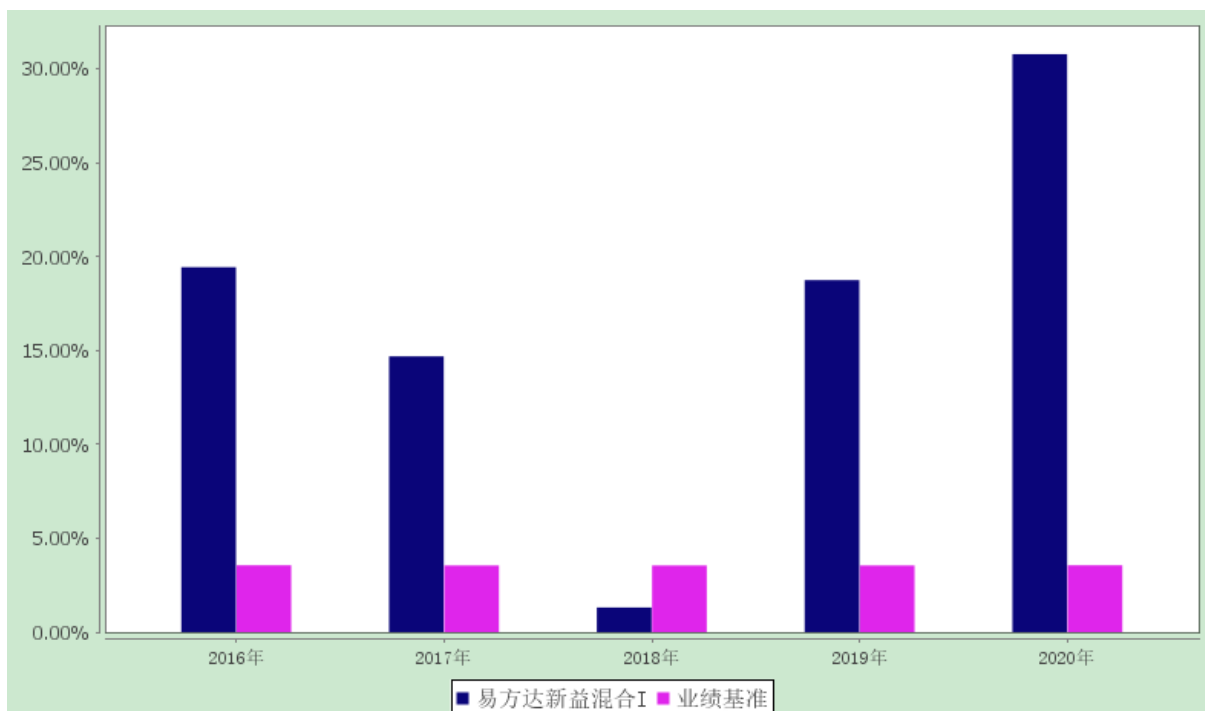
注：自基金合同生效至报告期末，I 类基金份额净值增长率为 116.20%，E 类基金份额净值增长

率为 186.90%，同期业绩比较基准收益率为 19.85%。

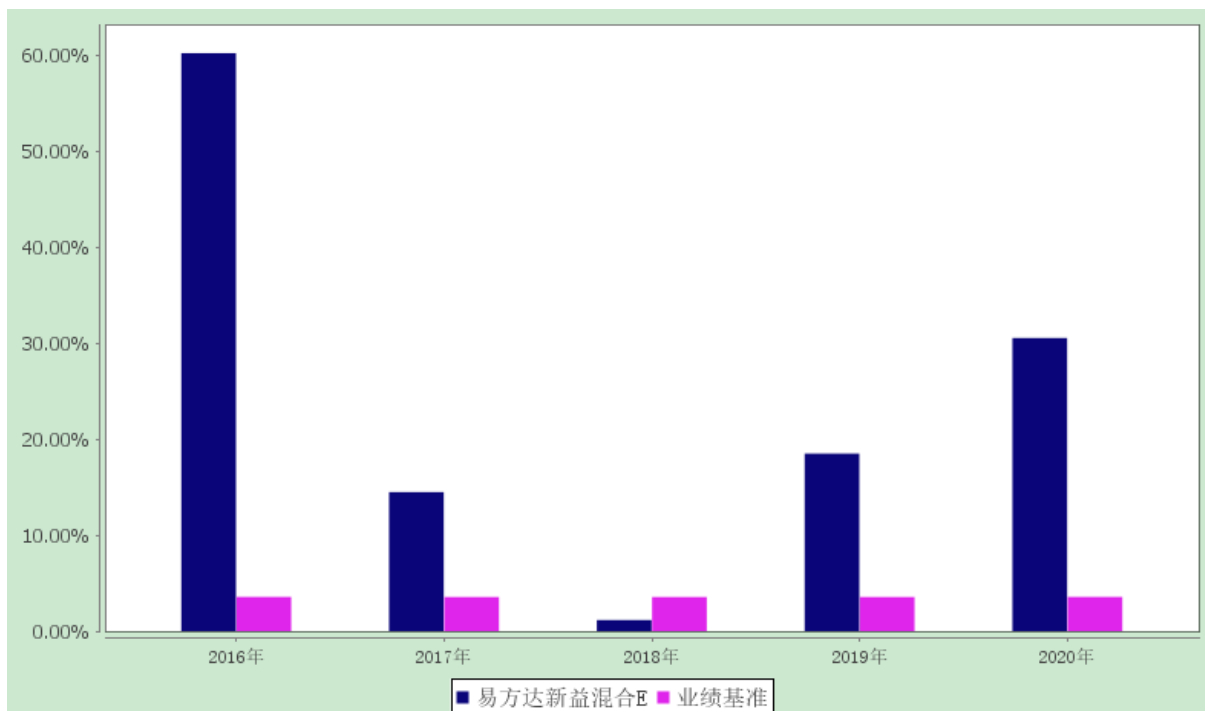
### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达新益灵活配置混合型证券投资基金  
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

#### 易方达新益混合 I



#### 易方达新益混合 E



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 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、广州、成都、大连等地设有分公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。本基金管理人始终专注于资产管理业务，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局。

#### 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<br>基金经理（助<br>理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明  |
|-----|--|-------------------------|----------|----------------|---|
|     |  | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |   |
| 韩阅川 | 本基金的基金经理、易方达瑞锦灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达丰惠混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达瑞信灵活配置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、易方达瑞祺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、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金 | 2019-08-03              | -        | 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。 |

|    |  |            |   |     |  |
|----|--|------------|---|-----|--|
|    | <p>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、易方达新鑫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、易方达瑞景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、易方达瑞祥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、多资产公募投资部总经理助理</p>                                       |            |   |     |  |
| 杨康 | <p>本基金的基金经理助理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达瑞锦灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达悦通一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达安盈回报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（自 2019 年 06 月 19 日至 2020 年 03 月 06 日）、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达新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、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祥</p> | 2019-07-31 | - | 5 年 | <p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部研究员、投资经理助理，易方达基金管理有限公司投资经理。</p> |

|    |   |            |   |     |   |
|----|---|------------|---|-----|---|
|    | <p>灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新鑫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、易方达瑞祺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、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐恒九个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理</p> |            |   |     |   |
| 周琼 | <p>本基金的基金经理助理、易方达悦通一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转招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、易方达安心回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕丰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、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金的基金经理助理</p>                | 2019-10-30 | - | 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>(自 2019 年 10 月 11 日至 2020 年 12 月 09 日)、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 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理助理 (自 2019 年 10 月 11 日至 2020 年 12 月 09 日)、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达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、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达富财纯债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券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、易方达瑞景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、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达丰惠混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞锦灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐恒九个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基</p> |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
| 金的基金经理助理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理 |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

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

待；建立事中和事后的同反向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 99 次，均为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易。

### 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 年利率债演绎了完整的牛熊切换行情，信用债利差先扩大后压缩，四季度在永煤等信用风险事件冲击下，信用利差整体走阔，在央行流动性呵护下高等级信用债利差率先回落、中低等级信用债利差则维持高位。具体来看，1-4 月，疫情的冲击使得实体经济被迫按下暂停键，经济基本面恶化的情况下，央行实施超宽松的货币政策，引发了一轮债市牛市，10 年期国债收益率创历史新低。二季度之后，国内外疫情形势趋于缓和，经济进入修复阶段。与此同时，以 5 月 15 日缩量续作 MLF 为开端，央行多次释放出货币政策回归常态化的明确信号，致使短端利率急剧调整，收益率曲线大幅平坦化上行。三季度之后，经济渐进企稳，货币政策不再边际放松成为一致预期，长端利率进入震荡上行阶段，市场缺乏明确主线，交投相对清淡。直到四季度中下旬，永煤违约事件给市场带来流动性冲击，叠加国内外疫情的反复，央行重新开始投放流动性，12 月长端收益率出现明显下行，并一直持续到年末收官。全年来看，10 年期国债和国开债分别下行 1BP 和 6BP，收益率先下后上波动幅度较大。信用债走势与利率债大体相似，同样先下后上，但在永煤等信用风险事件冲击后，评



级间利差显著扩大。

股票市场方面，2020 年全年市场大幅上涨，上半年行情主要由疫情和流动性主导，下半年行情则主要由盈利改善推动。年初，市场短暂延续自 2019 年年末开始的春节躁动，以科技为首的创业板指强势领涨。但随后新冠疫情在国内外先后爆发，A 股在情绪恐慌和海外流动性危机影响下巨幅震荡。市场转折点在 3 月底，全球货币政策和财政政策史无前例的大宽松，全球风险偏好开始逐步企稳，A 股开始筑底回升。在流动性环境宽裕，同时盈利增速相对趋弱的宏观环境下，医药、消费、科技演绎单边成长行情，成长与价值板块的估值分化创历史新高。三季度开始，在宏观经济快速修复的背景下，生产资料价格普涨，顺周期板块预期出现显著修复，整体风格趋于平衡。四季度，国内外主题事件交错，其中美国大选、永煤事件主导了短期估值波动，但 11 月下旬开始央行大额投放流动性以修复市场悲观情绪并熨平跨年流动性缺口，资金利率显著下行，成长股开始回暖。年末中央经济工作会议强调明年政策基调要稳，“不急转弯”，进一步有效稳定了市场预期，A 股主要指数均以年内新高结束本年度的行情。

操作上，组合权益坚持自下而上选择行业和个股的长期配置价值，维持一定的股票仓位以保持组合权益弹性。债券方面，组合继续维持较高的杠杆和中性的久期水平，整体仍按照票息策略的偏绝对收益操作思路为主。此外，组合仍积极参与科创板和创业板注册制下的网下询价打新。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 I 类基金份额净值为 2.162 元，本报告期份额净值增长率为 30.79%，同期业绩比较基准收益率为 3.56%；E 类基金份额净值为 2.869 元，本报告期份额净值增长率为 30.53%，同期业绩比较基准收益率为 3.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

伴随着国内外疫情逐步得到控制，居民消费倾向逐步回升，叠加政策对制造业的结构性信用支持，制造业和消费等内生动力预计持续修复，同时地产和基建在政策强调不出现“断崖”的基调下，预计不会大幅下滑。短期内将呈现经济回升、信用有序收紧的格局。但中长期来看，未来如果经济继续好转，政策总量宽松意愿下降，未来存在视经济情况进一步回收政策的可能，此外需要关注产能偏紧的状态下价格可能的压力。在目前经济持续向好、货币政策边际不放松，以及相对低利率的背景下，债券趋势性行情仍需等待，以获取票息收益为主。

考虑到经济回升推动企业盈利继续修复，整体宏观环境仍然有利于权益市场。但是在流动性逐步收紧的背景下，整体估值难以出现大幅提升，盈利将会成为更重要的驱动因素。部分在 2020 年表现较好的优质赛道仍然具备较好的配置价值，同时一些受益于经济回升的行业也有望出现修复性的行情。展望 2021 年，我们认为市场风格会更加均衡。

本基金纯债部分仍将以中高信用等级信用债为主，保持一定的杠杆水平，降低信用风险暴露，以获取票息收益和债券结构性机会为主；权益部分将继续根据市场情况，优化个股持仓。同时保持组合的灵活性，根据市场变化及时调仓，力争以优异的业绩回报基金持有人。此外组合仍会积极参与科创板和创业板注册制下的网下询价打新。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《关于实施〈公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法〉的规定》《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等最新法规、监管要求以及公司业务创新发展和风险应对管理的需要，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，加强各项政策法规和制度措施的落实执行，适应新的监管环境、市场环境和业务形势，保持公司良好的内控机制。

(2) 培育合规文化体系、严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，加大力度开展员工合规风控教育培训，秉持“受人之托、为人理财”的信义义务、践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“客户利益至上、实事求是、坚守长期”的核心价值观，促进公司合规文化建设；有针对性地根据《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及其配套规则的要求开展专项合规宣导与合规培训工作；根据业务实际及时健全完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等管控机制和措施，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为。

(3) 坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

(4) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询建议，严格进行合规审查。

(5) 深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督

管理办法》及其配套规则等法律法规和监管政策，进一步加强业务规范与机构管控要求，构建以加强投资者权益保护为中心、促进长期理性投资的机制，持续优化投资者适当性管理机制流程，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”的职责义务，切实保障投资者合法权益。

(6) 持续落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其配套规则，进一步健全信息披露管理工作机制流程，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(7) 持续推动风险为本的反洗钱工作体系建设，全面审视公司面临的洗钱风险与控制措施的有效性，进一步建立完善与风险相适应的政策、程序和控制措施，夯实制度、人员、系统等工作基础，保障资源投入，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，推动反洗钱重点工作提质增效，不断提高反洗钱合规和风险管理水平。

(8) 有计划、有重点地对投研交易、销售、运营、人员规范、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(9) 不断完善合规管控框架和机制，促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

截至 2020 年末，公司已通过 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，获得 GIPS 鉴证报告，鉴证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 鉴证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。同时，本年度公司通过 ISAE3402（《国际鉴证业务准则 3402 号》）内控鉴证，鉴证日期区间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日，获得控制设计适当性及运行有效性的无保留意见报告。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达新益混合 I:本报告期内未实施利润分配。

易方达新益混合 E:本报告期内未实施利润分配。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达新益灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

普华永道中天审字(2021)第 20618 号

易方达新益灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了易方达新益灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

## (二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达新益灵活配置混合型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达新益灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达新益灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

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

基金管理人治理层负责监督易方达新益灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这

些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

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

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

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

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

陈熹 陈轶杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2021 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：易方达新益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产  | 附注号 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|-------------------------|--------------------------|
| 资产： |     |                         |                          |

|                 |            |                                 |                                  |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 2,334,207.79                    | 5,880,671.11                     |
| 结算备付金           |            | 16,240,677.02                   | 6,859,014.33                     |
| 存出保证金           |            | 138,451.48                      | 96,647.73                        |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 1,334,698,992.55                | 501,755,337.91                   |
| 其中：股票投资         |            | 390,546,257.49                  | 82,282,395.54                    |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 904,139,735.06                  | 409,439,942.37                   |
| 资产支持证券投资        |            | 40,013,000.00                   | 10,033,000.00                    |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 9,990,125.00                    | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 943,888.17                      | 11,440,465.53                    |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 12,145,575.51                   | 6,606,985.10                     |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,336,486.39                    | 26,521.04                        |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>1,377,828,403.91</b>         | <b>532,665,642.75</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 314,038,835.43                  | 98,199,460.69                    |
| 应付证券清算款         |            | 13,588.04                       | 15,924,323.71                    |
| 应付赎回款           |            | 48,981.36                       | 110,623.54                       |
| 应付管理人报酬         |            | 507,996.85                      | 210,887.88                       |
| 应付托管费           |            | 169,332.29                      | 70,295.98                        |

|                   |          |                         |                       |
|-------------------|----------|-------------------------|-----------------------|
| 应付销售服务费           |          | 37,586.48               | 10,063.74             |
| 应付交易费用            | 7.4.7.7  | 150,446.04              | 116,409.18            |
| 应交税费              |          | 75,249.74               | 42,012.99             |
| 应付利息              |          | 18,205.18               | 53,892.74             |
| 应付利润              |          | -                       | -                     |
| 递延所得税负债           |          | -                       | -                     |
| 其他负债              | 7.4.7.8  | 183,005.02              | 280,001.92            |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>315,243,226.43</b>   | <b>115,017,972.37</b> |
| <b>所有者权益：</b>     |          |                         |                       |
| 实收基金              | 7.4.7.9  | 465,038,837.96          | 243,630,480.12        |
| 未分配利润             | 7.4.7.10 | 597,546,339.52          | 174,017,190.26        |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>1,062,585,177.48</b> | <b>417,647,670.38</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>1,377,828,403.91</b> | <b>532,665,642.75</b> |

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，I 类基金份额净值 2.162 元，E 类基金份额净值 2.869 元；基金份额总额 465,038,837.96 份，下属分级基金的份额总额分别为：I 类基金份额总额 383,985,497.05 份，E 类基金份额总额 81,053,340.91 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达新益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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目         | 附注号      | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|-------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|             |          | 2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b> |          | <b>209,595,915.65</b>               | <b>59,064,108.28</b>                |
| 1.利息收入      |          | 24,815,282.46                       | 11,323,028.04                       |
| 其中：存款利息收入   | 7.4.7.11 | 233,967.01                          | 76,215.75                           |
| 债券利息收入      |          | 23,946,111.68                       | 11,098,789.08                       |
| 资产支持证券利息收入  |          | 630,502.29                          | 103,141.40                          |
| 买入返售金融资产收入  |          | 4,701.48                            | 44,881.81                           |



|                            |          |                       |                      |
|----------------------------|----------|-----------------------|----------------------|
| 证券出借利息收入                   |          | -                     | -                    |
| 其他利息收入                     |          | -                     | -                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 87,374,959.93         | 23,486,409.21        |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12 | 78,409,217.08         | 21,249,436.23        |
| 基金投资收益                     |          | -                     | -                    |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13 | 6,717,328.81          | 1,081,136.66         |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -                     | -                    |
| 贵金属投资收益                    |          | -                     | -                    |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.14 | -                     | -                    |
| 股利收益                       | 7.4.7.15 | 2,248,414.04          | 1,155,836.32         |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.16 | 97,341,717.29         | 24,238,298.68        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                     | -                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.17 | 63,955.97             | 16,372.35            |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>12,937,928.77</b>  | <b>4,767,191.42</b>  |
| 1. 管理人报酬                   |          | 4,254,310.23          | 1,847,245.13         |
| 2. 托管费                     |          | 1,418,103.38          | 615,748.37           |
| 3. 销售服务费                   |          | 319,262.48            | 87,762.47            |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18 | 1,421,235.13          | 492,379.83           |
| 5. 利息支出                    |          | 5,220,126.57          | 1,468,796.11         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 5,220,126.57          | 1,468,796.11         |
| 6. 税金及附加                   |          | 84,690.98             | 38,059.51            |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.19 | 220,200.00            | 217,200.00           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>196,657,986.88</b> | <b>54,296,916.86</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>196,657,986.88</b> | <b>54,296,916.86</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达新益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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日      |                |                  |
|--|---|----------------|------------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 243,630,480.12                              | 174,017,190.26 | 417,647,670.38   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 196,657,986.88 | 196,657,986.88   |
| 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）      | 221,408,357.84                              | 226,871,162.38 | 448,279,520.22   |
| 其中：1.基金申购款                             | 279,390,863.02                              | 314,369,316.87 | 593,760,179.89   |
| 2.基金赎回款                                | -57,982,505.18                              | -87,498,154.49 | -145,480,659.67  |
| 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）                        | 465,038,837.96                              | 597,546,339.52 | 1,062,585,177.48 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |                |                  |
|  | 实收基金  | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 192,121,872.94                              | 79,264,054.88  | 271,385,927.82   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 54,296,916.86  | 54,296,916.86    |
| 三、本期基金份额交易                             | 51,508,607.18                               | 40,456,218.52  | 91,964,825.70    |

|  |                |                |                 |
|--|----------------|----------------|-----------------|
| 产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)            |                |                |                 |
| 其中：1.基金申购款                             | 134,987,866.29 | 85,672,512.71  | 220,660,379.00  |
| 2.基金赎回款                                | -83,479,259.11 | -45,216,294.19 | -128,695,553.30 |
| 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)                        | 243,630,480.12 | 174,017,190.26 | 417,647,670.38  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

易方达新益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]807号《关于准予易方达新益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达新益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，《易方达新益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为601,563,203.09份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达新益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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负

债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行

间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的



个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 2,334,207.79            | 5,880,671.11             |
| 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             | 2,334,207.79            | 5,880,671.11             |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 |                |                |               |
|---------------|-------------------------|----------------|----------------|---------------|
|               | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动         |               |
| 股票            | 261,871,748.92          | 390,546,257.49 | 128,674,508.57 |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -              | -              |               |
| 债券            | 交易所市场                   | 366,576,909.96 | 362,707,735.06 | -3,869,174.90 |

|               |                  |                  |                  |                |
|---------------|------------------|------------------|------------------|----------------|
|               | 银行间市场            | 543,448,215.32   | 541,432,000.00   | -2,016,215.32  |
|               | 合计               | 910,025,125.28   | 904,139,735.06   | -5,885,390.22  |
| 资产支持证券        |                  | 40,000,000.00    | 40,013,000.00    | 13,000.00      |
| 基金            |                  | -                | -                | -              |
| 其他            |                  | -                | -                | -              |
| 合计            |                  | 1,211,896,874.20 | 1,334,698,992.55 | 122,802,118.35 |
| 项目            | 上年度末             |                  |                  |                |
|               | 2019 年 12 月 31 日 |                  |                  |                |
|               |                  | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |                  | 62,787,945.23    | 82,282,395.54    | 19,494,450.31  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |                  | -                | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场            | 132,519,989.77   | 135,774,442.37   | 3,254,452.60   |
|               | 银行间市场            | 270,987,001.85   | 273,665,500.00   | 2,678,498.15   |
|               | 合计               | 403,506,991.62   | 409,439,942.37   | 5,932,950.75   |
| 资产支持证券        |                  | 10,000,000.00    | 10,033,000.00    | 33,000.00      |
| 基金            |                  | -                | -                | -              |
| 其他            |                  | -                | -                | -              |
| 合计            |                  | 476,294,936.85   | 501,755,337.91   | 25,460,401.06  |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末              |           |
|-------|------------------|-----------|
|       | 2020 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额             | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                | -         |
| 银行间市场 | 9,990,125.00     | -         |
| 合计    | 9,990,125.00     | -         |

| 项目    | 上年度末             |           |
|-------|------------------|-----------|
|       | 2019 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额             | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                | -         |
| 银行间市场 | -                | -         |
| 合计    | -                | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 639.77                  | 851.08                   |
| 应收定期存款利息   | -                       | -                        |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 7,308.30                | 3,086.50                 |
| 应收债券利息     | 11,743,341.53           | 6,496,768.40             |
| 应收资产支持证券利息 | 393,762.20              | 106,235.62               |
| 应收买入返售证券利息 | 461.41                  | -                        |
| 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         | 62.30                   | 43.50                    |
| 合计         | 12,145,575.51           | 6,606,985.10             |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|--------------------------|
|----|-------------------------|--------------------------|

|             |            |            |
|-------------|------------|------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 140,659.10 | 111,382.16 |
| 银行间市场应付交易费用 | 9,786.94   | 5,027.02   |
| 合计          | 150,446.04 | 116,409.18 |

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 5.02               | 1.92                |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 预提费用        | 183,000.00         | 280,000.00          |
| 合计          | 183,005.02         | 280,001.92          |

## 7.4.7.9 实收基金

易方达新益混合 I

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                |
|---------------|-----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末          | 216,301,868.77              | 216,301,868.77 |
| 本期申购          | 176,846,489.45              | 176,846,489.45 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -9,162,861.17               | -9,162,861.17  |
| 本期末           | 383,985,497.05              | 383,985,497.05 |

易方达新益混合 E

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                |
|---------------|-----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额           |
| 上年度末          | 27,328,611.35               | 27,328,611.35  |
| 本期申购          | 102,544,373.57              | 102,544,373.57 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -48,819,644.01              | -48,819,644.01 |

|     |               |               |
|-----|---------------|---------------|
| 本期末 | 81,053,340.91 | 81,053,340.91 |
|-----|---------------|---------------|

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

易方达新益混合 I

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           | 126,225,600.10 | 15,039,551.41  | 141,265,151.51 |
| 本期利润           | 77,779,590.01  | 73,747,168.76  | 151,526,758.77 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 126,650,119.58 | 26,589,163.26  | 153,239,282.84 |
| 其中：基金申购款       | 133,404,792.61 | 27,950,213.75  | 161,355,006.36 |
| 基金赎回款          | -6,754,673.03  | -1,361,050.49  | -8,115,723.52  |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 330,655,309.69 | 115,375,883.43 | 446,031,193.12 |

易方达新益混合 E

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           | 30,242,494.16  | 2,509,544.59   | 32,752,038.75  |
| 本期利润           | 21,536,679.58  | 23,594,548.53  | 45,131,228.11  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 67,426,943.19  | 6,204,936.35   | 73,631,879.54  |
| 其中：基金申购款       | 134,691,460.08 | 18,322,850.43  | 153,014,310.51 |
| 基金赎回款          | -67,264,516.89 | -12,117,914.08 | -79,382,430.97 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 119,206,116.93 | 32,309,029.47  | 151,515,146.40 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----|----------------------------------|----------------------------------|
|    | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|    |                                  |                                  |

|           |            |           |
|-----------|------------|-----------|
| 活期存款利息收入  | 36,393.08  | 33,160.75 |
| 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 | 194,781.55 | 42,154.21 |
| 其他        | 2,792.38   | 900.79    |
| 合计        | 233,967.01 | 76,215.75 |

## 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------|-----------------------|-----------------------|
|            | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 卖出股票成交总额   | 443,877,455.23        | 164,988,958.68        |
| 减：卖出股票成本总额 | 365,468,238.15        | 143,739,522.45        |
| 买卖股票差价收入   | 78,409,217.08         | 21,249,436.23         |

## 7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                         | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 216,321,265.17        | 250,174,285.67        |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 205,707,154.52        | 243,861,056.45        |
| 减：应收利息总额                | 3,896,781.84          | 5,232,092.56          |
| 买卖债券差价收入                | 6,717,328.81          | 1,081,136.66          |

## 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
|                | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 卖出资产支持证券成交总额   | 10,288,701.37         | -                     |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 10,000,000.00         | -                     |
| 减：应收利息总额       | 288,701.37            | -                     |
| 资产支持证券投资收益     | -                     | -                     |

## 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                    | 上年度可比期间               |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
|               | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 2,248,414.04          | 1,155,836.32          |
| 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            | 2,248,414.04          | 1,155,836.32          |

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 1.交易性金融资产              | 97,341,717.29         | 24,238,298.68         |
| ——股票投资                 | 109,180,058.26        | 18,248,405.46         |
| ——债券投资                 | -11,818,340.97        | 5,956,893.22          |
| ——资产支持证券投资             | -20,000.00            | 33,000.00             |
| ——基金投资                 | -                     | -                     |
| ——贵金属投资                | -                     | -                     |
| ——其他                   | -                     | -                     |
| 2.衍生工具                 | -                     | -                     |
| ——权证投资                 | -                     | -                     |
| 3.其他                   | -                     | -                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                     | -                     |
| 合计                     | 97,341,717.29         | 24,238,298.68         |

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|    |    |         |

|         | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金赎回费收入 | 63,955.97             | 15,879.20             |
| 其他      | -                     | 493.15                |
| 合计      | 63,955.97             | 16,372.35             |

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,413,410.13          | 485,749.83            |
| 银行间市场交易费用 | 7,825.00              | 6,630.00              |
| 合计        | 1,421,235.13          | 492,379.83            |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------|-----------------------|-----------------------|
|          | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 审计费用     | 63,000.00             | 60,000.00             |
| 信息披露费    | 120,000.00            | 120,000.00            |
| 证券出借违约金  | -                     | -                     |
| 银行汇划费    | -                     | -                     |
| 银行间账户维护费 | 36,000.00             | 36,000.00             |
| 其他       | 1,200.00              | 1,200.00              |
| 合计       | 220,200.00            | 217,200.00            |

### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9关联方关系

| 关联方名称       | 与本基金的关系           |
|-------------|-------------------|
| 易方达基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售 |



|                     | 机构             |
|---------------------|----------------|
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司      | 基金托管人          |
| 广发证券股份有限公司          | 基金管理人股东、基金销售机构 |
| 广东粤财信托有限公司          | 基金管理人股东        |
| 盈峰控股集团有限公司          | 基金管理人股东        |
| 广东省广晟资产经营有限公司       | 基金管理人股东        |
| 广州市广永国有资产经营有限公司     | 基金管理人股东        |
| 珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东        |
| 珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东        |
| 珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东        |
| 珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东        |
| 珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东        |
| 珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东        |
| 易方达资产管理有限公司         | 基金管理人的子公司      |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
|                 | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,254,310.23          | 1,847,245.13          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,385.14              | 1,177.66              |

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
|                | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,418,103.38          | 615,748.37            |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                    |            |            |
|----------------|-----------------------|------------|------------|
|                | 2020年1月1日至2020年12月31日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费      |            |            |
|                | 易方达新益混合 I             | 易方达新益混合 E  | 合计         |
| 易方达基金管理有限公司    | -                     | 274,065.25 | 274,065.25 |
| 广发证券           | -                     | 4,819.03   | 4,819.03   |
| 合计             | -                     | 278,884.28 | 278,884.28 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间               |            |            |
|                | 2019年1月1日至2019年12月31日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费      |            |            |
|                | 易方达新益混合 I             | 易方达新益混合 E  | 合计         |
| 易方达基金管理有限公司    | -                     | 84,865.03  | 84,865.03  |
| 广发证券           | -                     | 2,897.44   | 2,897.44   |
| 合计             | -                     | 87,762.47  | 87,762.47  |

注：本基金 I 类基金份额不收取销售服务费，E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，按前一日 E 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 E 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 E 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日      |        |      |       |      |                    |                |
|----------------------------------|--------|------|-------|------|--------------------|----------------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称           | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购              |                |
|                                  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额               | 利息支出           |
| 中国邮政储<br>蓄银行                     | -      | -    | -     | -    | 904,940,000.0<br>0 | 327,391.8<br>5 |
| 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年12月31日 |        |      |       |      |                    |                |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称           | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购              |                |
|                                  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额               | 利息支出           |
| 中国邮政储<br>蓄银行                     | -      | -    | -     | -    | 165,360,000.0<br>0 | 41,099.32      |

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

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

易方达新益混合 I

无。

易方达新益混合 E

无。

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称         | 本期                    |           | 上年度可比期间               |           |
|---------------|-----------------------|-----------|-----------------------|-----------|
|               | 2020年1月1日至2020年12月31日 |           | 2019年1月1日至2019年12月31日 |           |
|               | 期末余额                  | 当期利息收入    | 期末余额                  | 当期利息收入    |
| 中国邮政储蓄银行-活期存款 | 2,334,207.79          | 36,393.08 | 5,880,671.11          | 33,160.75 |

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

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

易方达新益混合 I

本报告期内未发生利润分配。

易方达新益混合 E

本报告期内未发生利润分配。

## 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |       |      |        |      |        |          |        |        |    |
|----------------------|------|-------|------|--------|------|--------|----------|--------|--------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |

|        |      |            |            |                |        |        |       |            |            |   |
|--------|------|------------|------------|----------------|--------|--------|-------|------------|------------|---|
| 003030 | 祖名股份 | 2020-12-25 | 2021-01-06 | 新股<br>流通<br>受限 | 15.18  | 15.18  | 480   | 7,286.40   | 7,286.40   | - |
| 003031 | 中瓷电子 | 2020-12-24 | 2021-01-04 | 新股<br>流通<br>受限 | 15.27  | 15.27  | 387   | 5,909.49   | 5,909.49   | - |
| 300860 | 锋尚文化 | 2020-08-06 | 2021-02-24 | 新股<br>流通<br>受限 | 138.02 | 126.67 | 381   | 52,585.62  | 48,261.27  | - |
| 300861 | 美畅股份 | 2020-08-06 | 2021-02-24 | 新股<br>流通<br>受限 | 43.76  | 51.10  | 895   | 39,165.20  | 45,734.50  | - |
| 300862 | 蓝盾光电 | 2020-08-07 | 2021-03-04 | 新股<br>流通<br>受限 | 33.95  | 38.54  | 5,843 | 198,369.85 | 225,189.22 | - |
| 300864 | 南大环境 | 2020-08-13 | 2021-02-25 | 新股<br>流通<br>受限 | 71.71  | 90.85  | 166   | 11,903.86  | 15,081.10  | - |
| 300867 | 圣元环保 | 2020-08-12 | 2021-03-03 | 新股<br>流通<br>受限 | 19.34  | 31.97  | 1,498 | 28,971.32  | 47,891.06  | - |
| 300868 | 杰美特  | 2020-08-12 | 2021-02-24 | 新股<br>流通<br>受限 | 41.26  | 43.28  | 593   | 24,467.18  | 25,665.04  | - |
| 300869 | 康泰医学 | 2020-08-12 | 2021-02-24 | 新股<br>流通<br>受限 | 10.16  | 110.88 | 862   | 8,757.92   | 95,578.56  | - |
| 300870 | 欧陆通  | 2020-08-13 | 2021-02-24 | 新股<br>流通<br>受限 | 36.81  | 65.67  | 478   | 17,595.18  | 31,390.26  | - |
| 300871 | 回盛生物 | 2020-08-13 | 2021-02-24 | 新股<br>流通<br>受限 | 33.61  | 38.70  | 618   | 20,770.98  | 23,916.60  | - |
| 300872 | 天阳科技 | 2020-08-14 | 2021-02-25 | 新股<br>流通<br>受限 | 21.34  | 37.84  | 871   | 18,587.14  | 32,958.64  | - |
| 300873 | 海晨股份 | 2020-08-14 | 2021-03-02 | 新股<br>流通<br>受限 | 30.72  | 41.32  | 484   | 14,868.48  | 19,998.88  | - |
| 300876 | 蒙泰高新 | 2020-08-14 | 2021-02-25 | 新股<br>流通<br>受限 | 20.09  | 36.62  | 350   | 7,031.50   | 12,817.00  | - |
| 300879 | 大叶股份 | 2020-08-25 | 2021-03-01 | 新股<br>流通       | 10.58  | 27.12  | 466   | 4,930.28   | 12,637.92  | - |

|        |      |            |            |        |        |        |       |           |            |   |
|--------|------|------------|------------|--------|--------|--------|-------|-----------|------------|---|
|        |      |            |            | 受限     |        |        |       |           |            |   |
| 300881 | 盛德鑫泰 | 2020-08-25 | 2021-03-05 | 新股流通受限 | 14.17  | 32.31  | 291   | 4,123.47  | 9,402.21   | - |
| 300882 | 万胜智能 | 2020-08-27 | 2021-03-10 | 新股流通受限 | 10.33  | 25.79  | 440   | 4,545.20  | 11,347.60  | - |
| 300884 | 狄耐克  | 2020-11-05 | 2021-05-12 | 新股流通受限 | 24.87  | 33.51  | 499   | 12,410.13 | 16,721.49  | - |
| 300886 | 华业香料 | 2020-09-08 | 2021-03-16 | 新股流通受限 | 18.59  | 45.67  | 147   | 2,732.73  | 6,713.49   | - |
| 300887 | 谱尼测试 | 2020-09-09 | 2021-03-16 | 新股流通受限 | 44.47  | 74.52  | 210   | 9,338.70  | 15,649.20  | - |
| 300889 | 爱克股份 | 2020-09-09 | 2021-03-16 | 新股流通受限 | 27.97  | 30.12  | 479   | 13,397.63 | 14,427.48  | - |
| 300890 | 翔丰华  | 2020-09-10 | 2021-03-18 | 新股流通受限 | 14.69  | 48.85  | 286   | 4,201.34  | 13,971.10  | - |
| 300891 | 惠云钛业 | 2020-09-10 | 2021-03-17 | 新股流通受限 | 3.64   | 16.40  | 1,143 | 4,160.52  | 18,745.20  | - |
| 300892 | 品渥食品 | 2020-09-11 | 2021-03-30 | 新股流通受限 | 26.66  | 60.01  | 272   | 7,251.52  | 16,322.72  | - |
| 300893 | 松原股份 | 2020-09-17 | 2021-03-24 | 新股流通受限 | 13.47  | 35.08  | 276   | 3,717.72  | 9,682.08   | - |
| 300895 | 铜牛信息 | 2020-09-17 | 2021-03-24 | 新股流通受限 | 12.65  | 45.30  | 283   | 3,579.95  | 12,819.90  | - |
| 300896 | 爱美客  | 2020-09-21 | 2021-03-29 | 新股流通受限 | 118.27 | 603.36 | 417   | 49,318.59 | 251,601.12 | - |
| 300900 | 广联航空 | 2020-10-19 | 2021-04-29 | 新股流通受限 | 17.87  | 33.16  | 879   | 15,707.73 | 29,147.64  | - |
| 300902 | 国安达  | 2020-10-22 | 2021-04-29 | 新股流通受限 | 15.38  | 24.26  | 551   | 8,474.38  | 13,367.26  | - |
| 300908 | 仲景   | 2020-11-13 | 2021-05-24 | 新股     | 39.74  | 60.44  | 285   | 11,325.90 | 17,225.40  | - |

|        |      |            |            |        |       |       |        |            |              |   |  |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|--------|------------|--------------|---|--|
|        | 食品   |            |            | 流通受限   |       |       |        |            |              |   |  |
| 300910 | 瑞丰新材 | 2020-11-20 | 2021-05-27 | 新股流通受限 | 30.26 | 47.87 | 474    | 14,343.24  | 22,690.38    | - |  |
| 300911 | 亿田智能 | 2020-11-24 | 2021-06-03 | 新股流通受限 | 24.35 | 33.06 | 309    | 7,524.15   | 10,215.54    | - |  |
| 300917 | 特发服务 | 2020-12-14 | 2021-06-21 | 新股流通受限 | 18.78 | 31.94 | 281    | 5,277.18   | 8,975.14     | - |  |
| 300918 | 南山智尚 | 2020-12-15 | 2021-06-22 | 新股流通受限 | 4.97  | 8.94  | 1,063  | 5,283.11   | 9,503.22     | - |  |
| 300919 | 中伟股份 | 2020-12-15 | 2021-06-23 | 新股流通受限 | 24.60 | 61.51 | 610    | 15,006.00  | 37,521.10    | - |  |
| 300922 | 天秦装备 | 2020-12-18 | 2021-06-25 | 新股流通受限 | 16.05 | 31.58 | 287    | 4,606.35   | 9,063.46     | - |  |
| 300925 | 法本信息 | 2020-12-21 | 2021-06-30 | 新股流通受限 | 20.08 | 37.33 | 353    | 7,088.24   | 13,177.49    | - |  |
| 300926 | 博俊科技 | 2020-12-29 | 2021-01-07 | 新股流通受限 | 10.76 | 10.76 | 3,225  | 34,701.00  | 34,701.00    | - |  |
| 300926 | 博俊科技 | 2020-12-29 | 2021-07-07 | 新股流通受限 | 10.76 | 10.76 | 359    | 3,862.84   | 3,862.84     | - |  |
| 300927 | 江天化学 | 2020-12-29 | 2021-01-07 | 新股流通受限 | 13.39 | 13.39 | 1,946  | 26,056.94  | 26,056.94    | - |  |
| 300927 | 江天化学 | 2020-12-29 | 2021-07-07 | 新股流通受限 | 13.39 | 13.39 | 217    | 2,905.63   | 2,905.63     | - |  |
| 300999 | 金龙鱼  | 2020-09-29 | 2021-04-15 | 新股流通受限 | 25.70 | 88.29 | 6,405  | 164,608.50 | 565,497.45   | - |  |
| 601995 | 中金公司 | 2020-10-22 | 2021-05-06 | 新股流通受限 | 28.78 | 68.71 | 24,951 | 718,089.78 | 1,714,383.21 | - |  |
| 605277 | 新亚电子 | 2020-12-25 | 2021-01-06 | 新股流通受限 | 16.95 | 16.95 | 507    | 8,593.65   | 8,593.65     | - |  |

|        |      |            |            |                      |       |            |         |                   |                   |   |
|--------|------|------------|------------|----------------------|-------|------------|---------|-------------------|-------------------|---|
| 688027 | 国盾量子 | 2020-06-30 | 2021-01-11 | 新股<br>流通<br>受限       | 36.18 | 232.1<br>6 | 2,830   | 102,389.40        | 657,012.80        | - |
| 688155 | 先惠技术 | 2020-08-03 | 2021-02-18 | 新股<br>流通<br>受限       | 38.77 | 67.26      | 2,403   | 93,164.31         | 161,625.78        | - |
| 688215 | 瑞晟智能 | 2020-08-20 | 2021-03-01 | 新股<br>流通<br>受限       | 34.73 | 46.12      | 1,229   | 42,683.17         | 56,681.48         | - |
| 688229 | 博睿数据 | 2020-08-07 | 2021-02-18 | 新股<br>流通<br>受限       | 65.82 | 101.2<br>5 | 1,643   | 108,142.26        | 166,353.75        | - |
| 688330 | 宏力达  | 2020-09-28 | 2021-04-15 | 新股<br>流通<br>受限       | 88.23 | 75.87      | 3,573   | 315,245.79        | 271,083.51        | - |
| 688335 | 复洁环保 | 2020-08-07 | 2021-02-18 | 新股<br>流通<br>受限       | 46.22 | 36.69      | 4,076   | 188,392.72        | 149,548.44        | - |
| 688557 | 兰剑智能 | 2020-11-25 | 2021-06-02 | 新股<br>流通<br>受限       | 27.70 | 32.75      | 1,812   | 50,192.40         | 59,343.00         | - |
| 688569 | 铁科轨道 | 2020-08-21 | 2021-03-01 | 新股<br>流通<br>受限       | 22.46 | 20.10      | 6,841   | 153,648.86        | 137,504.10        | - |
| 688586 | 江航装备 | 2020-07-24 | 2021-02-01 | 新股<br>流通<br>受限       | 10.27 | 30.20      | 16,436  | 168,797.72        | 496,367.20        | - |
| 688600 | 皖仪科技 | 2020-06-23 | 2021-01-04 | 新股<br>流通<br>受限       | 15.50 | 17.06      | 5,468   | 84,754.00         | 93,284.08         | - |
| 688617 | 惠泰医疗 | 2020-12-30 | 2021-01-07 | 新股<br>流通<br>受限       | 74.46 | 74.46      | 1,673   | 124,571.58        | 124,571.58        | - |
| 000333 | 美的集团 | 2020-11-20 | 2021-05-20 | 大宗<br>交易<br>流通<br>受限 | 87.01 | 93.89      | 160,000 | 13,921,600.0<br>0 | 15,022,400.<br>00 | - |
| 002938 | 鹏鼎控股 | 2020-09-11 | 2021-03-11 | 大宗<br>交易<br>流通<br>受限 | 45.88 | 47.47      | 110,000 | 5,046,800.00      | 5,221,700.0<br>0  | - |
| 603806 | 福斯特  | 2020-12-30 | 2021-06-30 | 大宗<br>交易<br>流通<br>受限 | 77.92 | 78.58      | 61,000  | 4,753,120.00      | 4,793,380.0<br>0  | - |



| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |      |            |            |        |        |        |          |            |            |    |
|----------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 113044               | 大秦转债 | 2020-12-16 | 2021-01-15 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 5,370    | 536,995.29 | 536,995.29 | -  |

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

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 163,038,835.43 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称           | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|----------------|------------|--------|---------|---------------|
| 101901352 | 19 绿城房产 MTN003 | 2021-01-04 | 99.83  | 53,000  | 5,290,990.00  |
| 101901369 | 19 金融街投 MTN001 | 2021-01-04 | 100.84 | 192,000 | 19,361,280.00 |
| 012001802 | 20 冀东水泥 SCP003 | 2021-01-05 | 100.15 | 300,000 | 30,045,000.00 |
| 101901023 | 19 蓝星 MTN001   | 2021-01-05 | 99.52  | 100,000 | 9,952,000.00  |
| 101901352 | 19 绿城房产 MTN003 | 2021-01-05 | 99.83  | 45,000  | 4,492,350.00  |
| 101901599 | 19 大唐集 MTN003  | 2021-01-05 | 100.48 | 100,000 | 10,048,000.00 |
| 101901728 | 19 国电 MTN005   | 2021-01-05 | 100.24 | 100,000 | 10,024,000.00 |
| 102000236 | 20 中化工 MTN004A | 2021-01-05 | 98.75  | 100,000 | 9,875,000.00  |
| 102000698 | 20 华电 MTN003B  | 2021-01-05 | 97.97  | 100,000 | 9,797,000.00  |
| 102000748 | 20 中建          | 2021-01-05 | 98.85  | 100,000 | 9,885,000.00  |

|           |                   |            |        |           |                |
|-----------|-------------------|------------|--------|-----------|----------------|
|           | MTN003            |            |        |           |                |
| 180208    | 18 国开 08          | 2021-01-05 | 100.49 | 120,000   | 12,058,800.00  |
| 101900813 | 19 四川路桥<br>MTN001 | 2021-01-06 | 101.18 | 100,000   | 10,118,000.00  |
| 101901207 | 19 三一<br>MTN002   | 2021-01-06 | 100.18 | 120,000   | 12,021,600.00  |
| 101901669 | 19 江宁城建<br>MTN001 | 2021-01-06 | 99.88  | 100,000   | 9,988,000.00   |
| 101901006 | 19 三一<br>MTN001   | 2021-01-07 | 100.13 | 100,000   | 10,013,000.00  |
| 101901369 | 19 金融街投<br>MTN001 | 2021-01-07 | 100.84 | 7,000     | 705,880.00     |
| 合计        |                   |            |        | 1,737,000 | 173,675,900.00 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 151,000,000.00 元,于 2021 年 1 月 4 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合,全面管理、专业分工”的思路,将风险控制嵌入到全公司的组织架构中,对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看,投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控,并根据其不同权限实施风险控制;从岗位职能的分工上看,基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、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。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险,本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡,以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 84.83%(2019 年 12 月 31 日：96.72%)。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 10,077,807.12      | 20,525,066.67       |
| A-1 以下 | 0.00               | 0.00                |
| 未评级    | 145,754,237.42     | 22,144,672.26       |
| 合计     | 155,832,044.54     | 42,669,738.93       |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年12月31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                |

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年12月31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 |

## 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 647,057,822.02     | 282,479,764.99      |
| AAA 以下 | 112,993,210.03     | 90,787,206.85       |
| 未评级    | 0.00               | 0.00                |
| 合计     | 760,051,032.05     | 373,266,971.84      |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年12月31日 | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 40,406,762.20      | 10,139,235.62       |
| AAA 以下 | 0.00               | 0.00                |
| 未评级    | 0.00               | 0.00                |
| 合计     | 40,406,762.20      | 10,139,235.62       |

## 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年12月31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                |

### 7.4.13.3 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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 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                       | 2,334,207.79 | -     | -     | -   | 2,334,207.79 |

|                     |                |                |               |                |                  |
|---------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 结算备付金               | 16,240,677.02  | -              | -             | -              | 16,240,677.02    |
| 存出保证金               | 138,451.48     | -              | -             | -              | 138,451.48       |
| 交易性金融资产             | 283,130,158.10 | 599,695,247.39 | 61,327,329.57 | 390,546,257.49 | 1,334,698,992.55 |
| 衍生金融资产              | -              | -              | -             | -              | -                |
| 买入返售金融资产            | 9,990,125.00   | -              | -             | -              | 9,990,125.00     |
| 应收证券清算款             | -              | -              | -             | 943,888.17     | 943,888.17       |
| 应收利息                | -              | -              | -             | 12,145,575.51  | 12,145,575.51    |
| 应收股利                | -              | -              | -             | -              | -                |
| 应收申购款               | -              | -              | -             | 1,336,486.39   | 1,336,486.39     |
| 递延所得税资产             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 其他资产                | -              | -              | -             | -              | -                |
| 资产总计                | 311,833,619.39 | 599,695,247.39 | 61,327,329.57 | 404,972,207.56 | 1,377,828,403.91 |
| 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           | 314,038,835.43 | -              | -             | -              | 314,038,835.43   |
| 应付证券清算款             | -              | -              | -             | 13,588.04      | 13,588.04        |
| 应付赎回款               | -              | -              | -             | 48,981.36      | 48,981.36        |
| 应付管理人报酬             | -              | -              | -             | 507,996.85     | 507,996.85       |
| 应付托管费               | -              | -              | -             | 169,332.29     | 169,332.29       |
| 应付销售服务费             | -              | -              | -             | 37,586.48      | 37,586.48        |
| 应付交易费用              | -              | -              | -             | 150,446.04     | 150,446.04       |
| 应交税费                | -              | -              | -             | 75,249.74      | 75,249.74        |
| 应付利息                | -              | -              | -             | 18,205.18      | 18,205.18        |
| 应付利润                | -              | -              | -             | -              | -                |
| 递延所得税负债             | -              | -              | -             | -              | -                |
| 其他负债                | -              | -              | -             | 183,005.02     | 183,005.02       |
| 负债总计                | 314,038,835.43 | -              | -             | 1,204,391.00   | 315,243,226.43   |
| 利率敏感度缺口             | -2,205,216.04  | 599,695,247.39 | 61,327,329.57 | 403,767,816.56 | 1,062,585,177.48 |
| 上年度末<br>2019年12月31日 | 1年以内           | 1-5年           | 5年以上          | 不计息            | 合计               |

|           |                |                |               |                |                |
|-----------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 资产        |                |                |               |                |                |
| 银行存款      | 5,880,671.11   | -              | -             | -              | 5,880,671.11   |
| 结算备付金     | 6,859,014.33   | -              | -             | -              | 6,859,014.33   |
| 存出保证金     | 96,647.73      | -              | -             | -              | 96,647.73      |
| 交易性金融资产   | 133,234,060.10 | 273,414,973.31 | 12,823,908.96 | 82,282,395.54  | 501,755,337.91 |
| 衍生金融资产    | -              | -              | -             | -              | -              |
| 买入返售金融资产  | -              | -              | -             | -              | -              |
| 应收证券清算款   | -              | -              | -             | 11,440,465.53  | 11,440,465.53  |
| 应收利息      | -              | -              | -             | 6,606,985.10   | 6,606,985.10   |
| 应收股利      | -              | -              | -             | -              | -              |
| 应收申购款     | -              | -              | -             | 26,521.04      | 26,521.04      |
| 递延所得税资产   | -              | -              | -             | -              | -              |
| 其他资产      | -              | -              | -             | -              | -              |
| 资产总计      | 146,070,393.27 | 273,414,973.31 | 12,823,908.96 | 100,356,367.21 | 532,665,642.75 |
| 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 | 98,199,460.69  | -              | -             | -              | 98,199,460.69  |
| 应付证券清算款   | -              | -              | -             | 15,924,323.71  | 15,924,323.71  |
| 应付赎回款     | -              | -              | -             | 110,623.54     | 110,623.54     |
| 应付管理人报酬   | -              | -              | -             | 210,887.88     | 210,887.88     |
| 应付托管费     | -              | -              | -             | 70,295.98      | 70,295.98      |
| 应付销售服务费   | -              | -              | -             | 10,063.74      | 10,063.74      |
| 应付交易费用    | -              | -              | -             | 116,409.18     | 116,409.18     |
| 应交税费      | -              | -              | -             | 42,012.99      | 42,012.99      |
| 应付利息      | -              | -              | -             | 53,892.74      | 53,892.74      |
| 应付利润      | -              | -              | -             | -              | -              |
| 递延所得税负债   | -              | -              | -             | -              | -              |
| 其他负债      | -              | -              | -             | 280,001.92     | 280,001.92     |
| 负债总计      | 98,199,460.69  | -              | -             | 16,818,511.68  | 115,017,972.37 |
| 利率敏感度缺口   | 47,870,932.58  | 273,414,973.31 | 12,823,908.96 | 83,537,855.53  | 417,647,670.38 |

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

## 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设              | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                     |
|-----------------|--------------------|---------------------------------|---------------------|
| 分析              | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                     |
|                 |                    | 本期末<br>2020年12月31日              | 上年度末<br>2019年12月31日 |
|                 | 1.市场利率下降 25 个基点    | 4,081,393.54                    | 2,004,575.97        |
| 2.市场利率上升 25 个基点 | -4,054,704.48      | -1,982,811.61                   |                     |

## 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

## 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020年12月31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  | 390,546,257.49     | 36.75                    | 82,282,395.54       | 19.70                    |
| 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            | 390,546,257.49     | 36.75                    | 82,282,395.54       | 19.70                    |

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析



| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                          |
|----|----------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                      | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|    | 1.业绩比较基准上升 5%        | 23,624,617.65                   | 6,524,394.80             |
|    | 2.业绩比较基准下降 5%        | -23,624,617.65                  | -6,524,394.80            |

注：股票投资业绩基准取上证 A 指。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i)各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 399,885,237.37 元，属于第二层次的余额为 934,813,755.18 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 102,078,969.94 元，第二层次 399,676,367.97 元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 390,546,257.49   | 28.35         |
|    | 其中:股票             | 390,546,257.49   | 28.35         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 944,152,735.06   | 68.52         |
|    | 其中:债券             | 904,139,735.06   | 65.62         |
|    | 资产支持证券            | 40,013,000.00    | 2.90          |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | 9,990,125.00     | 0.73          |
|    | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 18,574,884.81    | 1.35          |
| 8  | 其他各项资产            | 14,564,401.55    | 1.06          |
| 9  | 合计                | 1,377,828,403.91 | 100.00        |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -             | -             |
| B  | 采矿业      | 12,234,930.00 | 1.15          |

|   |                  |                |       |
|---|------------------|----------------|-------|
| C | 制造业              | 326,207,109.89 | 30.70 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -     |
| E | 建筑业              | -              | -     |
| F | 批发和零售业           | 8,940,387.72   | 0.84  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 19,998.88      | 0.00  |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 244,026.02     | 0.02  |
| J | 金融业              | 29,020,903.21  | 2.73  |
| K | 房地产业             | 8,975.14       | 0.00  |
| L | 租赁和商务服务业         | -              | -     |
| M | 科学研究和技术服务业       | 15,649.20      | 0.00  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 62,972.16      | 0.01  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -     |
| P | 教育               | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | 13,743,044.00  | 1.29  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 48,261.27      | 0.00  |
| S | 综合               | -              | -     |
|   | 合计               | 390,546,257.49 | 36.75 |

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 13,300  | 26,573,400.00 | 2.50         |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 258,800 | 24,748,272.00 | 2.33         |
| 3  | 601799 | 星宇股份 | 122,200 | 24,501,100.00 | 2.31         |
| 4  | 603806 | 福斯特  | 286,420 | 24,044,248.00 | 2.26         |
| 5  | 601012 | 隆基股份 | 202,100 | 18,633,620.00 | 1.75         |
| 6  | 603179 | 新泉股份 | 520,046 | 17,629,559.40 | 1.66         |
| 7  | 600893 | 航发动力 | 288,347 | 17,113,394.45 | 1.61         |
| 8  | 000651 | 格力电器 | 259,200 | 16,054,848.00 | 1.51         |
| 9  | 300274 | 阳光电源 | 218,221 | 15,773,013.88 | 1.48         |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 306,000 | 14,844,060.00 | 1.40         |
| 11 | 600763 | 通策医疗 | 49,700  | 13,743,044.00 | 1.29         |

|    |        |       |           |               |      |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 12 | 000725 | 京东方 A | 2,277,000 | 13,662,000.00 | 1.29 |
| 13 | 688390 | 固德威   | 54,419    | 12,946,280.10 | 1.22 |
| 14 | 601318 | 中国平安  | 141,400   | 12,298,972.00 | 1.16 |
| 15 | 601899 | 紫金矿业  | 1,317,000 | 12,234,930.00 | 1.15 |
| 16 | 600600 | 青岛啤酒  | 110,200   | 10,953,880.00 | 1.03 |
| 17 | 600104 | 上汽集团  | 418,800   | 10,235,472.00 | 0.96 |
| 18 | 600176 | 中国巨石  | 452,153   | 9,024,973.88  | 0.85 |
| 19 | 603233 | 大参林   | 113,900   | 8,924,065.00  | 0.84 |
| 20 | 300750 | 宁德时代  | 23,500    | 8,251,085.00  | 0.78 |
| 21 | 300059 | 东方财富  | 247,068   | 7,659,108.00  | 0.72 |
| 22 | 002080 | 中材科技  | 305,800   | 7,394,244.00  | 0.70 |
| 23 | 600036 | 招商银行  | 167,200   | 7,348,440.00  | 0.69 |
| 24 | 300628 | 亿联网络  | 98,900    | 7,231,568.00  | 0.68 |
| 25 | 600161 | 天坛生物  | 172,860   | 7,208,262.00  | 0.68 |
| 26 | 300115 | 长盈精密  | 236,200   | 5,822,330.00  | 0.55 |
| 27 | 000858 | 五粮液   | 18,000    | 5,253,300.00  | 0.49 |
| 28 | 300132 | 青松股份  | 278,700   | 5,236,773.00  | 0.49 |
| 29 | 002938 | 鹏鼎控股  | 110,000   | 5,221,700.00  | 0.49 |
| 30 | 002475 | 立讯精密  | 87,276    | 4,897,929.12  | 0.46 |
| 31 | 300433 | 蓝思科技  | 150,040   | 4,592,724.40  | 0.43 |
| 32 | 002241 | 歌尔股份  | 119,400   | 4,456,008.00  | 0.42 |
| 33 | 601995 | 中金公司  | 24,951    | 1,714,383.21  | 0.16 |
| 34 | 688027 | 国盾量子  | 2,830     | 657,012.80    | 0.06 |
| 35 | 300999 | 金龙鱼   | 6,405     | 565,497.45    | 0.05 |
| 36 | 688586 | 江航装备  | 16,436    | 496,367.20    | 0.05 |
| 37 | 688330 | 宏力达   | 3,573     | 271,083.51    | 0.03 |
| 38 | 300896 | 爱美客   | 417       | 251,601.12    | 0.02 |
| 39 | 300862 | 蓝盾光电  | 5,843     | 225,189.22    | 0.02 |
| 40 | 688229 | 博睿数据  | 1,643     | 166,353.75    | 0.02 |
| 41 | 688155 | 先惠技术  | 2,403     | 161,625.78    | 0.02 |
| 42 | 688335 | 复洁环保  | 4,076     | 149,548.44    | 0.01 |
| 43 | 688569 | 铁科轨道  | 6,841     | 137,504.10    | 0.01 |
| 44 | 688617 | 惠泰医疗  | 1,673     | 124,571.58    | 0.01 |
| 45 | 300869 | 康泰医学  | 862       | 95,578.56     | 0.01 |
| 46 | 688600 | 皖仪科技  | 5,468     | 93,284.08     | 0.01 |
| 47 | 688557 | 兰剑智能  | 1,812     | 59,343.00     | 0.01 |
| 48 | 688215 | 瑞晟智能  | 1,229     | 56,681.48     | 0.01 |
| 49 | 300860 | 锋尚文化  | 381       | 48,261.27     | 0.00 |
| 50 | 300867 | 圣元环保  | 1,498     | 47,891.06     | 0.00 |
| 51 | 300861 | 美畅股份  | 895       | 45,734.50     | 0.00 |
| 52 | 300926 | 博俊科技  | 3,584     | 38,563.84     | 0.00 |
| 53 | 300919 | 中伟股份  | 610       | 37,521.10     | 0.00 |
| 54 | 300872 | 天阳科技  | 871       | 32,958.64     | 0.00 |
| 55 | 300870 | 欧陆通   | 478       | 31,390.26     | 0.00 |



|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 1  | 000333 | 美的集团  | 23,767,386.29 | 5.69 |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 23,483,613.00 | 5.62 |
| 3  | 600893 | 航发动力  | 17,087,423.00 | 4.09 |
| 4  | 000651 | 格力电器  | 16,334,591.85 | 3.91 |
| 5  | 000725 | 京东方 A | 15,551,094.00 | 3.72 |
| 6  | 000002 | 万科 A  | 15,517,317.00 | 3.72 |
| 7  | 601318 | 中国平安  | 15,090,381.00 | 3.61 |
| 8  | 600048 | 保利地产  | 13,796,059.00 | 3.30 |
| 9  | 002456 | 欧菲光   | 13,037,797.00 | 3.12 |
| 10 | 300433 | 蓝思科技  | 13,022,418.00 | 3.12 |
| 11 | 002129 | 中环股份  | 12,449,382.06 | 2.98 |
| 12 | 600104 | 上汽集团  | 12,237,785.87 | 2.93 |
| 13 | 603806 | 福斯特   | 12,202,682.26 | 2.92 |
| 14 | 002415 | 海康威视  | 12,002,650.00 | 2.87 |
| 15 | 600585 | 海螺水泥  | 11,254,975.18 | 2.69 |
| 16 | 601012 | 隆基股份  | 10,789,953.90 | 2.58 |
| 17 | 601899 | 紫金矿业  | 10,346,812.00 | 2.48 |
| 18 | 603939 | 益丰药房  | 8,564,289.20  | 2.05 |
| 19 | 603233 | 大参林   | 8,480,810.88  | 2.03 |
| 20 | 688390 | 固德威   | 8,036,716.25  | 1.92 |

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1  | 300433 | 蓝思科技 | 14,847,979.00 | 3.56               |
| 2  | 600048 | 保利地产 | 13,816,903.63 | 3.31               |
| 3  | 000002 | 万科 A | 13,417,647.00 | 3.21               |
| 4  | 002456 | 欧菲光  | 12,405,916.25 | 2.97               |
| 5  | 002129 | 中环股份 | 12,342,037.00 | 2.96               |
| 6  | 600584 | 长电科技 | 11,093,309.00 | 2.66               |
| 7  | 603939 | 益丰药房 | 10,249,619.20 | 2.45               |
| 8  | 600585 | 海螺水泥 | 10,241,529.15 | 2.45               |
| 9  | 002475 | 立讯精密 | 9,803,088.20  | 2.35               |
| 10 | 600588 | 用友网络 | 9,769,912.07  | 2.34               |
| 11 | 601816 | 京沪高铁 | 8,298,062.22  | 1.99               |
| 12 | 601012 | 隆基股份 | 8,039,716.92  | 1.92               |
| 13 | 600690 | 海尔智家 | 7,436,811.12  | 1.78               |
| 14 | 300628 | 亿联网络 | 7,435,775.10  | 1.78               |
| 15 | 601899 | 紫金矿业 | 7,244,909.01  | 1.73               |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 16 | 300115 | 长盈精密 | 7,084,265.77 | 1.70 |
| 17 | 002273 | 水晶光电 | 6,660,338.42 | 1.59 |
| 18 | 603338 | 浙江鼎力 | 6,504,963.18 | 1.56 |
| 19 | 000063 | 中兴通讯 | 6,101,006.00 | 1.46 |
| 20 | 603259 | 药明康德 | 5,819,341.00 | 1.39 |

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 564,552,041.84 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 443,877,455.23 |

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 3,994,800.00   | 0.38         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 50,056,823.70  | 4.71         |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,056,823.70  | 4.71         |
| 4  | 企业债券      | 328,798,640.90 | 30.94        |
| 5  | 企业短期融资券   | 99,985,000.00  | 9.41         |
| 6  | 中期票据      | 380,046,000.00 | 35.77        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 41,258,470.46  | 3.88         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 904,139,735.06 | 85.09        |

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

金额单位：人民币元

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

|   |           |                |         |               | 值比例 (%) |
|---|-----------|----------------|---------|---------------|---------|
| 1 | 175089    | 20CHNE04       | 500,000 | 50,165,000.00 | 4.72    |
| 2 | 102002180 | 20 紫金矿业 MTN003 | 300,000 | 30,189,000.00 | 2.84    |
| 3 | 012001802 | 20 冀东水泥 SCP003 | 300,000 | 30,045,000.00 | 2.83    |
| 4 | 136849    | 16 华能债         | 280,000 | 27,700,400.00 | 2.61    |
| 5 | 112729    | 18 申宏 02       | 200,000 | 20,624,000.00 | 1.94    |

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

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  | 169448 | 弘德 01A  | 200,000 | 20,020,000.00 | 1.88          |
| 2  | 169745 | 弘德 03A  | 100,000 | 10,006,000.00 | 0.94          |
| 3  | 168733 | 申程 01 优 | 100,000 | 9,987,000.00  | 0.94          |

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 2020 年 5 月 21 日，上杭县交通综合行政执法大队针对紫金矿业集团股份有限公司使用卫星定位装置出现故障不能保持在线的运输车辆从事经营活动的违法违规事实，处以罚款 800 元。

本基金投资 20 紫金矿业 MTN003 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 20 紫金矿业 MTN003 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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|----|----|
|    |    |    |



|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金   | 138,451.48    |
| 2 | 应收证券清算款 | 943,888.17    |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 12,145,575.51 |
| 5 | 应收申购款   | 1,336,486.39  |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 14,564,401.55 |

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称  | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|--------------|---------------|
| 1  | 128023 | 亚太转债  | 9,317,169.09 | 0.88          |
| 2  | 128026 | 众兴转债  | 9,041,239.06 | 0.85          |
| 3  | 128037 | 岩土转债  | 6,737,587.56 | 0.63          |
| 4  | 113011 | 光大转债  | 3,224,596.40 | 0.30          |
| 5  | 127011 | 中鼎转 2 | 2,724,430.00 | 0.26          |
| 6  | 110045 | 海澜转债  | 2,594,548.40 | 0.24          |
| 7  | 110062 | 烽火转债  | 1,674,869.60 | 0.16          |
| 8  | 123023 | 迪森转债  | 868,359.80   | 0.08          |
| 9  | 128100 | 搜特转债  | 346,907.22   | 0.03          |
| 10 | 128108 | 蓝帆转债  | 325,247.90   | 0.03          |
| 11 | 113583 | 益丰转债  | 164,785.40   | 0.02          |

## 8.12.5 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  | 000333 | 美的集团 | 15,022,400.00 | 1.41          | 大宗交易流通受限 |
| 2  | 603806 | 福斯特  | 4,793,380.00  | 0.45          | 大宗交易流通受限 |

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东减持或者特定股东减持，采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超

过公司股份总数的 2%；前款交易的受让方在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别      | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构          |        |               |        |
|-----------|----------|------------|----------------|--------|---------------|--------|
|           |          |            | 机构投资者          |        | 个人投资者         |        |
|           |          |            | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例 |
| 易方达新益混合 I | 515      | 745,602.91 | 360,981,351.21 | 94.01% | 23,004,145.84 | 5.99%  |
| 易方达新益混合 E | 767      | 105,675.80 | 67,930,530.77  | 83.81% | 13,122,810.14 | 16.19% |
| 合计        | 1,282    | 362,744.80 | 428,911,881.98 | 92.23% | 36,126,955.98 | 7.77%  |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别      | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 易方达新益混合 I | 487,676.03 | 0.1270%  |
|                  | 易方达新益混合 E | 20,203.67  | 0.0249%  |
|                  | 合计        | 507,879.70 | 0.1092%  |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别      | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 易方达新益混合 I | 0                 |
|                                | 易方达新益混合 E | 0                 |
|                                | 合计        | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 易方达新益混合 I | 0                 |
|                                | 易方达新益混合 E | 0                 |
|                                | 合计        | 0                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 易方达新益混合 I      | 易方达新益混合 E      |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 16 日）基金份额总额 | 600,875,303.09 | 687,900.00     |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 216,301,868.77 | 27,328,611.35  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 176,846,489.45 | 102,544,373.57 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 9,162,861.17   | 48,819,644.01  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 383,985,497.05 | 81,053,340.91  |

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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。

本基金管理人于 2020 年 7 月 24 日发布公告，自 2020 年 7 月 24 日起聘任胡剑先生、张清华先生担任公司副总经理级高级管理人员。

本基金管理人于 2020 年 9 月 19 日发布公告，自 2020 年 9 月 19 日起聘任冯波先生、陈皓先生担任公司副总经理级高级管理人员。

本基金管理人于 2020 年 9 月 30 日发布公告，自 2020 年 9 月 28 日起张优造先生不再担任公司副总经理。

本基金管理人于 2020 年 12 月 12 日发布公告，自 2020 年 12 月 10 日起汪兰英女士不再担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）。

本报告期内，基金托管人于 2020 年 12 月 30 日发布任职公告，韩笑微女士担任中国邮政储蓄银行托管业务部副总经理。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 6 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 63,000.00 元。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东方证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国泰君安 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国信证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 海通证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 申万宏源 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 银河证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中信建投 | 1      | 125,458,007.70 | 13.27%       | 100,366.04 | 13.27%     | -  |
| 中信证券 | 2      | 819,922,699.99 | 86.73%       | 655,937.93 | 86.73%     | -  |

注：a) 本报告期内本基金减少大同证券有限责任公司一个交易单元,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、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东方证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 海通证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 申万宏源 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 银河证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 中信建投 | 11,257,312.03  | 3.37%        | 1,491,100,000.00  | 5.14%          | -    | -            |
| 中信证券 | 323,108,633.01 | 96.63%       | 27,522,178,000.00 | 94.86%         | -    | -            |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 1  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告  | 中国证券报                       | 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                 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 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   | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-02-04 |
| 4  | 易方达新益灵活配置混合型证券投资基金在非直销销售机构、网上直销系统调整大额申购、大额转换转入业务金额限制及在直销中心调整申购及转换转入业务金额限制的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-02-22 |
| 5  | 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  | 中国证券报                       | 2020-03-31 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 6  | 易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告         | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-04-10 |
| 7  | 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        | 中国证券报                       | 2020-04-21 |
| 8  | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                      | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-06-22 |
| 9  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 2 季度报告提示性公告        | 中国证券报                       | 2020-07-21 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                      | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-07-24 |
| 11 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年中期报告提示性公告            | 中国证券报                       | 2020-08-28 |
| 12 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                      | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-09-19 |
| 13 | 易方达基金管理有限公司关于延长旗下部分开放式基金在直销中心开展赎回费率优惠活动的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-09-25 |
| 14 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                      | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-09-30 |
| 15 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告          | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-10-15 |
| 16 | 易方达基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告                    | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-10-28 |
| 17 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 3 季度报告提示性公告        | 中国证券报                       | 2020-10-28 |
| 18 | 关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告           | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-12-10 |
| 19 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                      | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2020-12-12 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情 |
|----|----------------|-----------|
|----|----------------|-----------|

| 者类别  |    |                         |                |      |      | 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01月01日~2020年12月31日 | 110,494,368.01 | -    | -    | 110,494,368.01 | 23.76% |
|  | 2  | 2020年01月01日~2020年05月20日 | 66,224,503.31  | -    | -    | 66,224,503.31  | 14.24% |
| <b>产品特有风险</b>  |    |                         |                |      |      |                |        |
| <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；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> |    |                         |                |      |      |                |        |

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达新益灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达新益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达新益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。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年三月三十日