

# 易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12	投资组合报告附注 .....	45
8	基金份额持有人信息 .....	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	47
9	开放式基金份额变动 .....	47
10	重大事件揭示 .....	48
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4	基金投资策略的改变 .....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8	其他重大事件 .....	51
11	备查文件目录 .....	51
11.1	备查文件目录 .....	51
11.2	存放地点 .....	51
11.3	查阅方式 .....	52

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	易方达科瑞混合
基金主代码	003293
交易代码	003293
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年1月3日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	616,888,364.72 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面，本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券等资产类别的配置比例。股票投资方面，本基金将根据对各行业的综合分析，确定并调整行业配置比例；在各行业中，本基金将精选具有持续竞争优势的公司进行投资。债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债新综合财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	陆志俊
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38798812	021-62701216
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6	中国（上海）自由贸易试验区银

	号105室-42891（集中办公区）	城中路188号
办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	510620	200336
法定代表人	刘晓艳	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

## 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	90,021,820.49
本期利润	101,573,801.00
加权平均基金份额本期利润	0.1686
本期加权平均净值利润率	8.71%
本期基金份额净值增长率	8.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	503,863,653.50
期末可供分配基金份额利润	0.8168
期末基金资产净值	1,266,363,547.59
期末基金份额净值	2.0528
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	140.37%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

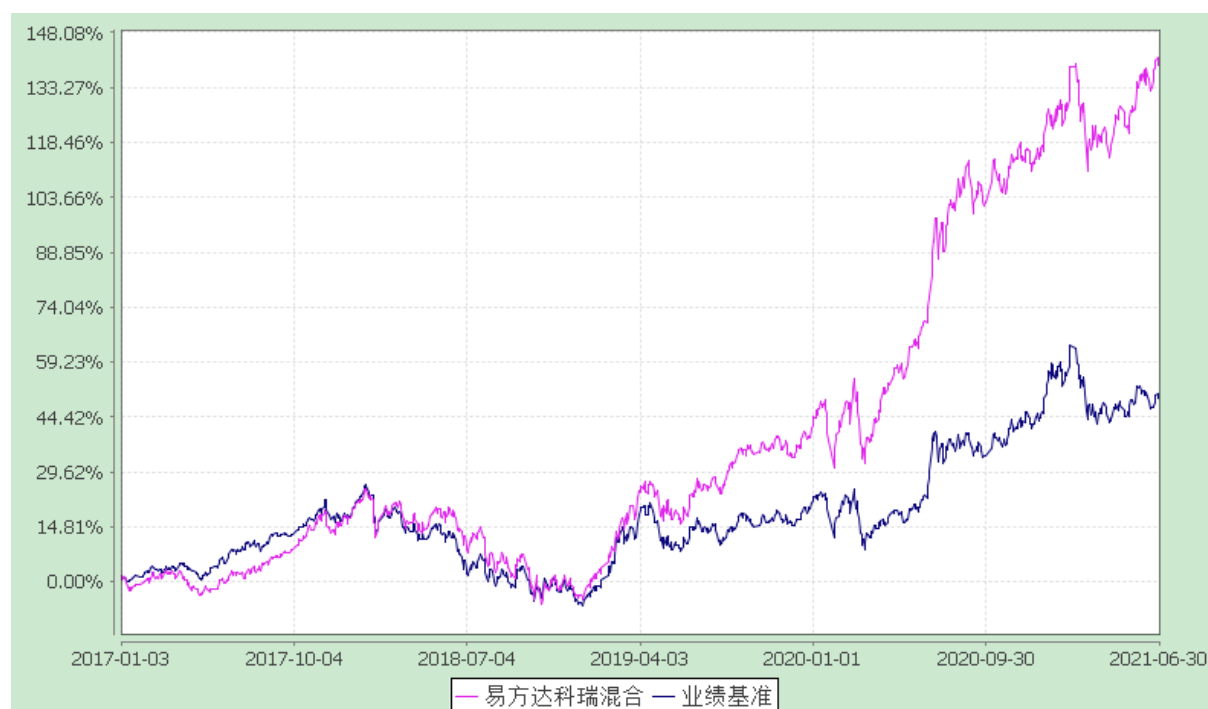
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.95%	0.83%	-1.57%	0.64%	3.52%	0.19%
过去三个月	9.95%	0.83%	3.03%	0.78%	6.92%	0.05%
过去六个月	8.97%	1.11%	0.62%	1.05%	8.35%	0.06%
过去一年	39.98%	1.17%	20.92%	1.06%	19.06%	0.11%
过去三年	113.66%	1.24%	41.95%	1.09%	71.71%	0.15%
自基金合同生效起至今	140.37%	1.11%	50.12%	0.97%	90.25%	0.14%

### 3.2.2 自基金转型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

易方达科瑞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

（2017年1月3日至2021年6月30日）



注：1. 本基金由原科瑞证券投资基金于2017年1月3日转型而来。

2.自基金转型至报告期末,基金份额净值增长率为140.37%,同期业绩比较基准收益率为50.12%。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准,本基金管理人成立于2001年4月17日,注册资本13,244.2万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格,在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF投资等领域全面布局,为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨嘉文	本基金的基金经理、易方达逆向投资混合型证券投资基金的基金经理、易方达科益混合型证券投资基金的基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017-12-27	-	10年	硕士研究生,具有基金从业资格。曾任大成基金管理有限公司研究部研究员,易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理。

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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



### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 15 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年 A 股大部分指数是上涨的，一季度指数整体波动较大，主要是春节后有较大幅度的下跌，而二季度指数整体平稳上扬。2021 年上半年，各指数的收益率呈现出一定的分化，创业板指数、科创 50 指数表现突出，分别上涨了 17.22% 和 14.01%，中证 500 指数、沪深 300 指数分别上涨了 6.93% 和 0.24%，而上证 50 指数却下跌了 3.90%。板块方面，2021 年上半年申万行业指数走势出现明显分化，电气设备、钢铁、化工行业表现最好，涨幅超过 20%，而表现不佳的行业指数包括家用电器、非银金融、国防军工等板块。

分析原因：

国外方面，今年一季度，伴随新冠疫苗接种推进，疫情逐渐好转，全球经济同步修复。美国总统拜登上任，并推出 1.9 万亿大规模财政刺激计划以支持疫后经济修复，提振经济同时加强通胀预期，全球利率普遍上行，并对“长久期”资产估值造成负面影响。二季度海外政治环境相对平稳，风险偏好更多受到流动性和基本面变化的驱动。就业市场的疲软和通胀压力的超预期矛盾凸显，市场和美联储关于流动性是否收紧的博弈进入白热化。

国内方面，一季度我国经济稳步修复，在海外需求强劲且供给恢复仍不足情形下，国内出口持续强势。地产销售投资均较强，考虑到出口强势叠加制造业企业扩产意愿提升。工业品涨价、“就地

过年”倡议下企业提前开工等因素影响下，一季度企业盈利明显改善。通胀压力下，货币政策维持稳健中性，信贷需求旺盛，数量和质量均有增长。二季度，随着海外供给侧释放节奏缓慢驱动国内出口再度超预期，制造业投资也持续改善。房地产销售热情不减，投资端在政策压制下仍有韧性，延续前期高增态势。财政支出进度和专项债发行进度低于预期，基建投资继续低迷。消费方面没有明显亮点，可选消费弱于地产产业链竣工强度，服务消费仍在恢复但程度弱于预期。货币政策方面，央行始终“按兵不动”维持 MLF（中期借贷便利）和逆回购等额续作，同时增加非公开工具投放，流动性供给充裕，资金利率大部分时间处在政策利率下方。

本基金股票仓位在 2021 年一季度稳定在 80%-85%，二季度随着市场反弹仓位从 80%左右逐渐下降到 70%左右。市场已经从春节前的“好公司应该给好的价格”的投资主线逐渐转化为“增长快的企业阶段性给更高的价格”。虽然市场风格多变，但是寻找市场未充分定价的好公司在目前估值两极分化的市场里尤其重要。而本基金根据上述宏观经济判断，以及根据行业和个股的估值性价比作出了一些调整，而且因为市场估值的两极分化，所以阶段性估值性价比高且有中长期投资逻辑的个股数量变少，也导致本基金仓位阶段性有所降低。结构方面，一季度增持的行业主要有建材、电气设备、公用事业，而减持的行业主要有机械设备、非银金融、计算机。二季度增持的行业主要有交通运输、银行、电气设备，而减持的行业主要有化工、电子、轻工制造。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.0528 元，本报告期份额净值增长率为 8.97%，同期业绩比较基准收益率为 0.62%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，海外发达经济体复苏进入中后期，经济驱动力从商品消费逐步向服务消费过渡，将不利于我国出口维持去年下半年以来的高增长，但出口份额的永久性提升也保证了出口的韧性所在。房地产预计仍是投资方面的亮点，关注后地产链条商品消费的恢复。PPI 高点在二季度逐步寻顶，下半年逐步回落概率较大，成本对中游的压制作用将逐步释放，上游盈利可期。另外，下半年企业盈利将进一步呈现成长占优趋势，结构上关注成长投资机会。流动性预计是下半年影响资产价格的重要变量，海外宏观经济下半年仍是验证经济恢复节奏的关键窗口期，货币政策收紧预期发酵或将有所反复。与此同时，国内经济高点已现，但仍有韧性的情况下，监管调结构的动力较强，国内流动性难以更加宽松。

从海外历次疫情的经验以及目前全球疫情的发展态势来看，本次疫情及其影响也只是阶段性的，有很多有竞争力的企业或者行业可能只是阶段性受到了疫情的影响，在里面寻找错误定价的机会应

该是一个性价比很高的方法。而在全球疫情逐渐消退的过程中，流动性将会逐步收紧，但是目前流动性依然宽裕，各类主题投资活跃，而市场主线从春节前“核心资产”切换到 PEG（市盈率相对盈利增长比率）估值低的资产。原因是核心资产阶段性定价相对较贵，其次是在疫情的影响下，2020 年受到较大冲击的中小型公司今年却因基数较低而获得高增长，持续性有待考究。基于以上判断，本基金在 2021 年继续优先在景气度变好的行业或者非热点行业的优质企业这两类资产里进行选股。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	378,081,604.15	113,822,139.81
结算备付金		1,020,568.43	776,273.45
存出保证金		282,535.98	216,858.94
交易性金融资产	6.4.7.2	902,402,908.78	899,139,716.00
其中：股票投资		900,949,534.66	898,560,116.00
基金投资		-	-
债券投资		1,453,374.12	579,600.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		371,216.48	101,923,231.55
应收利息	6.4.7.5	64,695.32	16,877.83
应收股利		-	-
应收申购款		326,523.42	88,102.04
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,282,550,052.56	1,115,983,199.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,019,346.09	1,206,814.40
应付赎回款		11,248,663.38	3,424,823.71
应付管理人报酬		1,516,079.26	1,359,860.87
应付托管费		252,679.89	226,643.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	621,614.39	657,610.03
应交税费		1,307,939.53	1,307,941.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	220,182.43	201,033.61
负债合计		16,186,504.97	8,384,727.10
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	616,888,364.72	587,927,737.40
未分配利润	6.4.7.10	649,475,182.87	519,670,735.12
所有者权益合计		1,266,363,547.59	1,107,598,472.52
负债和所有者权益总计		1,282,550,052.56	1,115,983,199.62

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0528 元，基金份额总额 616,888,364.72 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>114,651,990.37</b>	<b>147,525,448.93</b>
1.利息收入		928,729.70	520,698.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	902,874.26	356,100.09
债券利息收入		1,101.74	164,598.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		24,753.70	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		101,457,908.22	125,599,951.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	92,542,468.90	119,383,032.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	772,964.48	369,060.36
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	8,142,474.84	5,847,858.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	11,551,980.51	21,342,515.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	713,371.94	62,284.41
<b>减：二、费用</b>		<b>13,078,189.37</b>	<b>8,833,191.87</b>
1. 管理人报酬		8,693,888.46	5,335,817.67
2. 托管费		1,448,981.39	889,302.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,813,556.76	2,487,071.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		3.67	6.32
7. 其他费用	6.4.7.19	121,759.09	120,993.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>101,573,801.00</b>	<b>138,692,257.06</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>101,573,801.00</b>	<b>138,692,257.06</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	587,927,737.40	519,670,735.12	1,107,598,472.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	101,573,801.00	101,573,801.00
三、本期基金份额交易产	28,960,627.32	28,230,646.75	57,191,274.07

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	145,377,755.13	135,855,079.46	281,232,834.59
2.基金赎回款	-116,417,127.81	-107,624,432.71	-224,041,560.52
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）	616,888,364.72	649,475,182.87	1,266,363,547.59
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	596,937,359.21	126,883,493.76	723,820,852.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	138,692,257.06	138,692,257.06
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）	-55,692,792.20	-13,087,515.20	-68,780,307.40
其中：1.基金申购款	34,067,153.88	9,621,489.96	43,688,643.84
2.基金赎回款	-89,759,946.08	-22,709,005.16	-112,468,951.24
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）	541,244,567.01	252,488,235.62	793,732,802.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由科瑞证券投资基金转型而来。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[2016]1917号《关于准予科瑞证券投资基金变更注册的批复》和基金管理人于2016年10月12日发布的《易方达基金管理有限公司关于科瑞证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，科瑞证券投资基金由封闭式

基金转为开放式基金、调整存续期限、更换登记机构、终止上市、更名为“易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金”、修改投资目标、投资范围及投资策略、调整收益分配原则等条款及相应修订基金合同等。自 2017 年 1 月 3 日科瑞证券投资基金终止上市之日起，由《科瑞证券投资基金基金合同》修订而成的《易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《科瑞证券投资基金基金合同》将自同一日起失效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为



销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资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，股权的股息、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。

#### (4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	378,081,604.15
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	378,081,604.15

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	709,757,330.32	900,949,534.66	191,192,204.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,395,794.70	1,453,374.12
	银行间市场	-	-
	合计	1,395,794.70	1,453,374.12
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	711,153,125.02	902,402,908.78	191,249,783.76

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	64,058.26
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	413.37
应收债券利息	109.30
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	114.39
合计	64,695.32

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	621,614.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	621,614.39

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	1,003.48
应付证券出借违约金	-
预提费用	219,178.95
合计	220,182.43

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	587,927,737.40	587,927,737.40
本期申购	145,377,755.13	145,377,755.13
本期赎回（以“-”号填列）	-116,417,127.81	-116,417,127.81
本期末	616,888,364.72	616,888,364.72

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	392,213,798.00	127,456,937.12	519,670,735.12
本期利润	90,021,820.49	11,551,980.51	101,573,801.00
本期基金份额交易产生的变动数	21,628,035.01	6,602,611.74	28,230,646.75
其中：基金申购款	103,166,179.75	32,688,899.71	135,855,079.46
基金赎回款	-81,538,144.74	-26,086,287.97	-107,624,432.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	503,863,653.50	145,611,529.37	649,475,182.87

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	活期存款利息收入	887,729.62
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	13,062.48	
其他	2,082.16	
合计	902,874.26	

## 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	卖出股票成交总额	1,057,069,344.08

减：卖出股票成本总额	964,526,875.18
买卖股票差价收入	92,542,468.90

#### 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,323,027.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,549,000.00
减：应收利息总额	1,062.52
买卖债券差价收入	772,964.48

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,142,474.84
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	8,142,474.84

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	11,551,980.51
——股票投资	11,494,401.09
——债券投资	57,579.42
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	11,551,980.51

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	713,371.94
其他	-
合计	713,371.94

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	2,813,556.76
银行间市场交易费用	-
合计	2,813,556.76

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,980.14
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	121,759.09

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	-	-	23,940,846.10	1.48%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
广发证券	19,152.67	1.37%	19,152.67	2.73%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年6月 30日	2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,693,888.46	5,335,817.67
其中：支付销售机构的客户维护费	601,913.95	415,957.86

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月 30日	2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,448,981.39	889,302.97

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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



本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	378,081,604.15	887,729.62	167,416,955.32	345,346.26

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	605090	九丰能源	新股网下发行	1,090	37,681.30
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：报告期内本基金参与了九丰能源首次公开发行的申购，此次发行的分销商广发证券股份有限公司为本基金管理人的关联方。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-

300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-

				受限						
30097 3	立高 食品	2021-0 4-08	2021-1 0-15	新股 流通 受限	28.28	115.71	360	10,180 .80	41,655 .60	-
30097 5	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696. 16	6,410. 76	-
30097 8	东箭 科技	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 流通 受限	8.42	13.60	593	4,993. 06	8,064. 80	-
30097 9	华利 集团	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 流通 受限	33.22	87.50	925	30,728 .50	80,937 .50	-
30098 2	苏文 电能	2021-0 4-19	2021-1 0-27	新股 流通 受限	15.83	45.29	317	5,018. 11	14,356 .93	-
30098 5	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 流通 受限	24.90	24.81	295	7,345. 50	7,318. 95	-
30098 6	志特 新材	2021-0 4-21	2021-1 1-01	新股 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904. 56	8,070. 48	-
30098 7	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	新股 流通 受限	6.79	26.81	301	2,043. 79	8,069. 81	-
30099 1	创益 通	2021-0 5-12	2021-1 1-22	新股 流通 受限	13.06	26.51	254	3,317. 24	6,733. 54	-
30099 2	泰福 泵业	2021-0 5-17	2021-1 1-25	新股 流通 受限	9.36	20.32	200	1,872. 00	4,064. 00	-
30099 5	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811. 52	4,454. 12	-
30099 7	欢乐 家	2021-0 5-26	2021-1 2-02	新股 流通 受限	4.94	13.05	928	4,584. 32	12,110 .40	-
30099 8	宁波 方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	新股 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210. 02	4,285. 32	-
30100 2	崧盛 股份	2021-0 5-27	2021-1 2-07	新股 流通 受限	18.71	57.62	201	3,760. 71	11,581 .62	-
30100	嘉益	2021-0	2021-1	新股	7.81	21.94	312	2,436.	6,845.	-

4	股份	6-18	2-27	流通受限				72	28	
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688083	中望软件	2021-03-04	2021-09-13	新股流通受限	150.50	524.08	1,837	276,468.50	962,734.96	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-

688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688468	科美诊断	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	7.15	16.50	3,919	28,020.85	64,663.50	-
688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	新股流通受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	新股流通受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688669	聚石化学	2021-01-15	2021-07-26	新股流通受限	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-
002415	海康威视	2021-03-03	2021-09-03	大宗交易流通受限	55.00	62.62	100,000	5,500,000.00	6,262,000.00	-
300657	弘信电子	2019-09-10	2021-09-13	非公开发行流通受限	23.83	16.47	173,101	2,500,005.30	2,850,973.47	-
<b>6.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										
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
113050	南银转债	2021-06-16	2021-07-01	新发流通受限	100.00	100.00	12,100	1,209,994.70	1,209,994.70	-

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、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。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.11%(2020 年 12 月 31 日：0.05%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,210,079.57	0.00
AAA 以下	243,403.85	579,634.30
未评级	0.00	0.00
合计	1,453,483.42	579,634.30

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
--------	-------------------	---------------------



AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过

久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	378,081,604.15	-	-	-	378,081,604.15
结算备付金	1,020,568.43	-	-	-	1,020,568.43
存出保证金	282,535.98	-	-	-	282,535.98
交易性金融资产	-	-	1,453,374.12	900,949,534.66	902,402,908.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	371,216.48	371,216.48
应收利息	-	-	-	64,695.32	64,695.32
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	326,523.42	326,523.42
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	379,384,708.56	-	1,453,374.12	901,711,969.88	1,282,550,052.56
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,019,346.09	1,019,346.09
应付赎回款	-	-	-	11,248,663.38	11,248,663.38
应付管理人报酬	-	-	-	1,516,079.26	1,516,079.26
应付托管费	-	-	-	252,679.89	252,679.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	621,614.39	621,614.39
应交税费	-	-	-	1,307,939.53	1,307,939.53
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	220,182.43	220,182.43
负债总计	-	-	-	16,186,504.97	16,186,504.97
利率敏感度缺口	379,384,708.56	-	1,453,374.12	885,525,464.91	1,266,363,547.59
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	113,822,139.81	-	-	-	113,822,139.81
结算备付金	776,273.45	-	-	-	776,273.45
存出保证金	216,858.94	-	-	-	216,858.94
交易性金融资产	-	-	579,600.00	898,560,116.00	899,139,716.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	101,923,231.55	101,923,231.55
应收利息	-	-	-	16,877.83	16,877.83
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	88,102.04	88,102.04
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	114,815,272.20	-	579,600.00	1,000,588,327.42	1,115,983,199.62
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,206,814.40	1,206,814.40
应付赎回款	-	-	-	3,424,823.71	3,424,823.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,359,860.87	1,359,860.87
应付托管费	-	-	-	226,643.48	226,643.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	657,610.03	657,610.03
应交税费	-	-	-	1,307,941.00	1,307,941.00
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	201,033.61	201,033.61
负债总计	-	-	-	8,384,727.10	8,384,727.10
利率敏感度缺口	114,815,272.20	-	579,600.00	992,203,600.32	1,107,598,472.52

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	900,949,534.66	71.14	898,560,116.00	81.13
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	900,949,534.66	71.14	898,560,116.00	81.13

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	49,475,726.95	56,274,802.17
	2.业绩比较基准下降 5%	-49,475,726.95	-56,274,802.17

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 885,730,334.38 元，属于第二层次的余额为 16,672,574.40 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 884,243,631.47 元，第二层次 14,896,084.53 元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	900,949,534.66	70.25
	其中：股票	900,949,534.66	70.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,453,374.12	0.11
	其中：债券	1,453,374.12	0.11
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	379,102,172.58	29.56
8	其他各项资产	1,044,971.20	0.08
9	合计	1,282,550,052.56	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	4,298,850.00	0.34
C	制造业	664,752,608.81	52.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,151,678.21	0.41
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	64,481,870.55	5.09
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,164,159.27	3.72
J	金融业	89,920,015.78	7.10
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,556,801.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	8,909,349.65	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	5,683,390.52	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	900,949,534.66	71.14

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	331,448	98,735,044.72	7.80
2	000902	新洋丰	5,016,450	78,407,113.50	6.19
3	600036	招商银行	1,103,272	59,786,309.68	4.72
4	002831	裕同科技	1,875,077	55,671,036.13	4.40

5	000906	浙商中拓	4,236,600	54,821,604.00	4.33
6	688516	奥特维	284,633	42,125,684.00	3.33
7	300119	瑞普生物	1,137,900	38,483,778.00	3.04
8	688369	致远互联	588,823	37,625,789.70	2.97
9	603378	亚士创能	624,857	34,379,632.14	2.71
10	300628	亿联网络	379,359	31,790,284.20	2.51
11	002966	苏州银行	4,095,100	30,098,985.00	2.38
12	000333	美的集团	413,900	29,540,043.00	2.33
13	600519	贵州茅台	12,615	25,945,270.50	2.05
14	600089	特变电工	1,898,500	24,395,725.00	1.93
15	000661	长春高新	56,500	21,865,500.00	1.73
16	300476	胜宏科技	766,100	16,739,285.00	1.32
17	688639	华恒生物	336,559	16,151,466.41	1.28
18	603816	顾家家居	192,299	14,860,866.72	1.17
19	688113	联测科技	200,123	13,168,093.40	1.04
20	000725	京东方 A	2,043,900	12,753,936.00	1.01
21	002648	卫星石化	325,060	12,739,101.40	1.01
22	002957	科瑞技术	461,300	11,744,698.00	0.93
23	002050	三花智控	473,800	11,361,724.00	0.90
24	601012	隆基股份	126,000	11,193,840.00	0.88
25	002889	东方嘉盛	417,100	10,556,801.00	0.83
26	603806	福斯特	92,344	9,708,124.72	0.77
27	600755	厦门国贸	1,166,601	9,577,794.21	0.76
28	300416	苏试试验	384,905	8,814,324.50	0.70
29	603236	移远通信	39,130	6,675,969.30	0.53
30	002415	海康威视	100,800	6,313,600.00	0.50
31	600323	瀚蓝环境	259,161	5,647,118.19	0.45
32	002409	雅克科技	68,900	5,580,900.00	0.44
33	300124	汇川技术	74,550	5,536,083.00	0.44
34	002230	科大讯飞	81,200	5,487,496.00	0.43
35	600746	江苏索普	343,600	5,270,824.00	0.42
36	600989	宝丰能源	382,078	5,226,827.04	0.41
37	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.41
38	002901	大博医疗	62,200	4,533,758.00	0.36
39	600583	海油工程	955,300	4,298,850.00	0.34
40	300171	东富龙	93,700	3,808,905.00	0.30
41	600276	恒瑞医药	48,614	3,304,293.58	0.26
42	688099	晶晨股份	27,202	3,052,064.40	0.24
43	300657	弘信电子	173,101	2,850,973.47	0.23
44	600582	天地科技	585,000	2,281,500.00	0.18
45	688083	中望软件	1,837	962,734.96	0.08
46	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.03
47	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.02
48	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.01



49	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
50	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
51	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.01
52	300979	华利集团	925	80,937.50	0.01
53	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
54	688468	科美诊断	3,919	64,663.50	0.01
55	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
56	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
57	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
58	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
59	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
60	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
61	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
62	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
63	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
64	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
65	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
66	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
67	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
68	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
69	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
70	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
71	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
72	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
73	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
74	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
75	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
76	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
77	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
78	300558	贝达药业	100	10,824.00	0.00
79	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
80	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
81	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
82	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
83	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
84	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
85	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
86	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
87	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
88	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
89	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
90	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
91	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
92	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00

93	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
94	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
95	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
96	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
97	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
98	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
99	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
100	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
101	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
102	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
103	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
104	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
105	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
106	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
107	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
108	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
109	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
110	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
111	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600089	特变电工	36,824,372.05	3.32
2	002034	旺能环境	35,435,550.30	3.20
3	000906	浙商中拓	33,567,051.47	3.03
4	002831	裕同科技	32,256,269.39	2.91
5	002966	苏州银行	31,684,493.87	2.86
6	600352	浙江龙盛	31,384,899.43	2.83
7	300119	瑞普生物	29,925,801.54	2.70
8	300628	亿联网络	29,070,183.56	2.62
9	000902	新洋丰	28,707,663.10	2.59
10	000661	长春高新	23,045,088.00	2.08
11	603378	亚士创能	21,577,676.31	1.95
12	600183	生益科技	20,926,975.58	1.89
13	000333	美的集团	20,120,348.29	1.82
14	002463	沪电股份	19,556,573.00	1.77
15	300171	东富龙	17,683,861.93	1.60
16	688113	联测科技	17,296,584.37	1.56

17	600211	西藏药业	17,210,817.06	1.55
18	002648	卫星石化	16,665,292.00	1.50
19	688639	华恒生物	14,958,047.60	1.35
20	002241	歌尔股份	14,479,318.83	1.31

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002034	旺能环境	34,561,221.24	3.12
2	300171	东富龙	33,124,220.88	2.99
3	600352	浙江龙盛	33,061,902.68	2.99
4	002158	汉钟精机	32,052,467.05	2.89
5	601318	中国平安	30,016,447.93	2.71
6	300776	帝尔激光	23,547,573.64	2.13
7	002419	天虹股份	22,373,313.18	2.02
8	000333	美的集团	21,775,708.00	1.97
9	600989	宝丰能源	21,370,859.98	1.93
10	601952	苏垦农发	20,738,694.91	1.87
11	002572	索菲亚	20,618,674.06	1.86
12	600211	西藏药业	20,243,834.00	1.83
13	002142	宁波银行	18,533,568.12	1.67
14	600183	生益科技	17,725,267.51	1.60
15	601968	宝钢包装	17,415,777.81	1.57
16	300919	中伟股份	16,577,476.00	1.50
17	600276	恒瑞医药	16,224,819.00	1.46
18	600089	特变电工	16,066,252.27	1.45
19	000902	新洋丰	15,800,019.89	1.43
20	002463	沪电股份	15,666,390.73	1.41

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	955,421,892.75
卖出股票收入（成交）总额	1,057,069,344.08

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,453,374.12	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,453,374.12	0.11

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	113050	南银转债	12,100	1,209,994.70	0.10
2	127036	三花转债	1,858	243,379.42	0.02

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 2020 年 7 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出责令改正、并处罚款 100 万元的行政处罚决定：1、2019 年 7 月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2、2014 年 12 月至 2019 年 5 月，该中心对某信用卡申请人资信水平调查严重不审慎。

2020 年 9 月 29 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司涉嫌违反法律法规的行为处以责令整改，并处以罚款人民币 120 万元。

2020 年 11 月 27 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司违反规定办理结汇、售汇的行为，作出“责令改正、罚款人民币 55 万元，没收违法所得 128.82 万元人民币”的行政处罚决定。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 7170 万元的行政处罚决定：1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；3、理财产品之间风险隔离不到位；4、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；5、同业投资接受第三方金融机构信用担保；6、理财资金池化运作；7、利用理财产品准备金调节收益；8、高净值客户认定不审慎；9、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；10、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；11、投资集合资金信托计划人数超限；12、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；13、信贷资产非真实转让；14、全权委托业务不规范；15、未按要

求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；16、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；17、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；18、票据转贴现假卖断屡查屡犯；19、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；20、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；21、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；22、理财资金认购商业银行增发的股票；23、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；24、为定制公募基金提供投资顾问；25、为本行承销债券兑付提供资金支持；26、协助发行人以非市场化的价格发行债券；27、瞒报案件信息。

本基金投资招商银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	282,535.98
2	应收证券清算款	371,216.48
3	应收股利	-
4	应收利息	64,695.32
5	应收申购款	326,523.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,044,971.20

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
14,051	43,903.52	169,618,342.08	27.50%	447,270,022.64	72.50%

注：持有人户数含未确权的原持有人户数。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	9,932.46	0.0016%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年1月3日）基金份额总额	3,000,000,000.00
--------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	587,927,737.40
本报告期基金总申购份额	145,377,755.13
减：本报告期基金总赎回份额	116,417,127.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	616,888,364.72

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐轶。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。



## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	11,731,078.96	0.59%	9,384.85	0.60%	-
中信建投	1	48,934,832.02	2.45%	29,361.19	1.89%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	421,127,029.68	21.05%	336,902.16	21.70%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	294,770,140.25	14.74%	235,816.19	15.19%	-
光大证券	1	193,447,015.32	9.67%	154,757.66	9.97%	-
中泰证券	2	94,319,894.90	4.72%	75,455.90	4.86%	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	590,071,146.86	29.50%	472,057.41	30.41%	-
银河证券	1	61,591,592.63	3.08%	49,273.28	3.17%	-
长城证券	1	181,433,874.31	9.07%	123,289.16	7.94%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	102,821,503.47	5.14%	66,006.53	4.25%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为粤开证券股份有限公司,新增交易单元的证券公司为海通证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中信建投证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财达证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	4,763,554.06	75.34%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	728,619.45	11.52%	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	830,853.49	13.14%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加东方财富证券为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-01-21
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
4	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加腾安基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-10
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	上海证券报	2021-03-30
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-04-19

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予科瑞证券投资基金变更注册的文件；
2. 关于科瑞证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告；
3. 《易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
4. 《易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
5. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日