

易方达易百智能量化策略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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48

§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
11.1 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.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达易百智能量化策略混合	
基金主代码	005437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 24 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	94,563,058.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
下属分级基金的交易代码	005437	005438
报告期末下属分级基金的份额总额	71,364,704.90 份	23,198,353.93 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要依托于百度提供的特色数据及其数据处理能力,通过大数据挖掘和分析技术,结合基金管理人自主研发的量化策略进行投资组合管理,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要借助百度在人工智能技术和算法方面的优势,同时结合其特有的互联网大数据,对证券市场相关数据进行深度分析,在海外成熟的多因子量化选股框架下扩充因子维度,对股票超额收益进行预测,并据此筛选具有投资价值的股票构建投资组合。同时,本基金也可应用定向增发套利与大宗交易套利等多种量化套利策略,根据各策略的预期收益、风险及其所使用的市场环境,发现和捕捉因市场波动及无效定价带来的价差机会,力争获取超越业绩比较基准的投资回报。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×65%+中债新综合指数(财富)收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金,理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张南	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66594319
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
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）	北京市西城区复兴门内大街1 号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	刘连舸

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
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）	
	易方达易百智能量化策 略混合 A	易方达易百智能量化策略 混合 C
本期已实现收益	2,075,683.84	-432,891.96
本期利润	7,349,033.91	2,587,958.75
加权平均基金份额本期利润	0.1308	0.1771

本期加权平均净值利润率	10.01%	13.89%
本期基金份额净值增长率	4.30%	4.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	易方达易百智能量化策略 混合 A	易方达易百智能量化策略混 合 C
期末可供分配利润	28,726,044.17	9,005,028.91
期末可供分配基金份额利润	0.4025	0.3882
期末基金资产净值	100,090,749.07	32,203,382.84
期末基金份额净值	1.4025	1.3882
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	易方达易百智能量化策 略混合 A	易方达易百智能量化策略 混合 C
基金份额累计净值增长率	40.25%	38.82%

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

易方达易百智能量化策略混合 A

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	7.36%	1.28%	-1.24%	0.52%	8.60%	0.76%
过去三个月	12.84%	0.97%	2.69%	0.64%	10.15%	0.33%
过去六个月	4.30%	1.25%	0.91%	0.86%	3.39%	0.39%
过去一年	30.36%	1.30%	17.52%	0.86%	12.84%	0.44%
过去三年	56.48%	1.28%	36.82%	0.88%	19.66%	0.40%
自基金合同生效起至今	40.25%	1.25%	19.07%	0.87%	21.18%	0.38%

易方达易百智能量化策略混合 C

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	7.34%	1.28%	-1.24%	0.52%	8.58%	0.76%
过去三个月	12.76%	0.97%	2.69%	0.64%	10.07%	0.33%
过去六个月	4.16%	1.25%	0.91%	0.86%	3.25%	0.39%

过去一年	29.98%	1.30%	17.52%	0.86%	12.46%	0.44%
过去三年	55.11%	1.28%	36.82%	0.88%	18.29%	0.40%
自基金合同生效起至今	38.82%	1.25%	19.07%	0.87%	19.75%	0.38%

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

易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 1 月 24 日至 2021 年 6 月 30 日)

易方达易百智能量化策略混合 A



易方达易百智能量化策略混合 C



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 40.25%，C 类基金份额净值增长率为 38.82%，同期业绩比较基准收益率为 19.07%。

§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		
官泽帆	本基金的基金经理、易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金的基金经理、易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经	2018-01-24	2021-03-20	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商基金管理有限公司投资开发工程师，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司量化研究员、基金经理助

	理、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金的基金经理				理，易方达基金管理有限公司量化研究员、投资经理、基金经理助理。
殷明	本基金的基金经理	2021-03-20	-	5 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，国盛证券有限责任公司研究所金融工程分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员。
徐德晖	本基金的基金经理助理、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金的基金经理助理、易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、量化研究员	2020-04-30	-	4 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司指数与量化研究员。

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的

单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 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

本报告期内，全球经济伴随着新冠疫情的有效控制开始逐步恢复，虽然复苏过程中依然存在一些波折，但经济总体向好的趋势已然明朗。另一方面，由于我国新冠疫情爆发较欧美国家更早，且我国对疫情的控制更为有效，导致国内的经济复苏和欧美等西方国家出现了一定的时间差，这也间接导致无论是我国面临的经济状况，还是采取的财政和货币政策，都需要独立于西方国家看待。上半年，由于全球经济的强劲复苏，通胀预期持续升温，由此导致输入性通胀水平提升，PPI 维持高位，中游制造企业成本居高不下。在此背景下，央行降准的动作更多可以理解为一种对下半年经济可能回落的预防性行为。

上半年权益市场表现可以以春节和三月底两个时间点切分为三部分：春节前，市场延续了去年对于高确定性盈利公司的偏好，这部分具有长期确定性的龙头公司估值进一步上升，并在春节前达到历史高峰；春节后，随着美债收益率大幅攀升，北上资金开始回流美国，流动性收紧后前期的高估值股票开始承压，市场微观结构开始内部调整；三月底以来，随着国内财政和货币政策进一步明朗，“紧信用，稳货币”政策的不断落地验证，市场风险偏好逐步上升，随着一季报的陆续落地，一批高成长性的业绩优秀的细分赛道优质公司开始享受估值溢价。总体来看，整个上半年市场风格多变，在这种情况下，借助量化模型可以规避人性中“追涨杀跌”的不理性情绪，更加科学地进行资产配置。

报告期内本基金继续借助量化选股模型指导投资，坚守模型驱动和深度研究驱动投资的理念，捕捉市场对个股的非有效定价机会，精选基本面良好、估值性价比较高且兼具一定成长性的标的。我们同时也借助了交易大数据、另类数据等信息，进一步提升量化选股模型的选股能力。在风格极致变化的市场中，量化模型可以最大化发挥其优势，一方面可以克服非理性情绪，另一方面，今年市场整体的“广度”足够宽，量化模型可以充分发挥其广度优势，精选出一批市场还未充分关注的优质公司，适度进行逆向投资，进可攻退可守，在控制好回撤的前提下，力争带给投资人优良的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.4025 元，本报告期份额净值增长率为 4.30%，同

期业绩比较基准收益率为 0.91%；C 类基金份额净值为 1.3882 元，本报告期份额净值增长率为 4.16%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%，年化跟踪误差 10.43%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，对宏观经济最重要的影响变量依然是经济增速、通胀预期、社融、消费恢复水平、国内外财政与货币政策取向等。每个因素都可能影响市场的风险偏好和企业盈利水平，在分子和分母两端对市场造成冲击。总体来看，国内经济水平依然比较稳健，虽然还存在一些结构性问题，但总体上风险可控。政策面上，我国对疫情的控制非常有效，今年财政和货币政策都还预留有一定空间。资金面上，北上资金持续流入，为整体 A 股的估值提供了一定支撑。我们相信下半年市场依然存在结构性投资机会，需要基金管理人充分理解各种变量对选股策略的影响。因此，我们从自上而下以及自下而上两个角度进行了深入研究，通过量化模型紧密跟踪相关数据，快速准确地做出投资决策。同时，我们依然会坚持在大数据、机器学习、另类数据中的深入研究，充分利用另类因子和市场因子对选股模型进行增强，力争为投资者创造持续稳定的超额收益。

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

易方达易百智能量化策略混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达易百智能量化策略混合 C: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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达易百智能量化策略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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：易方达易百智能量化策略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	7,004,397.60	4,515,068.93
结算备付金		1,423,036.37	100,860.40
存出保证金		60,920.05	60,126.91
交易性金融资产	6.4.7.2	124,232,230.45	70,311,155.33
其中：股票投资		124,232,230.45	70,311,155.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	10,027.07
应收利息	6.4.7.5	1,195.76	539.68
应收股利		-	-
应收申购款		6,842.49	17,045.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		132,728,622.72	75,014,823.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		182,242.32	487,934.52
应付管理人报酬		158,410.28	94,238.47
应付托管费		26,401.71	15,706.42
应付销售服务费		7,926.51	1,553.56
应付交易费用	6.4.7.7	-	20,259.19
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	59,509.99	120,116.79
负债合计		434,490.81	739,808.95
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	94,563,058.83	55,274,636.61
未分配利润	6.4.7.10	37,731,073.08	19,000,377.76

所有者权益合计		132,294,131.91	74,275,014.37
负债和所有者权益总计		132,728,622.72	75,014,823.32

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.4025 元，C 类基金份额净值 1.3882 元；基金份额总额 94,563,058.83 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 71,364,704.90 份，C 类基金份额总额 23,198,353.93 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达易百智能量化策略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
一、收入		11,543,629.89	23,794,399.15
1.利息收入		23,724.39	62,934.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,724.39	62,892.79
债券利息收入		-	41.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,196,410.22	30,621,348.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,343,274.42	29,249,167.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	16,139.06
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	853,135.80	1,356,041.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	8,294,200.78	-6,927,251.58
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	29,294.50	37,367.99
减：二、费用		1,606,637.23	3,646,601.54
1. 管理人报酬		681,898.20	1,674,023.06
2. 托管费		113,649.62	279,003.83
3. 销售服务费		27,041.52	6,742.60
4. 交易费用	6.4.7.18	700,661.61	1,572,286.98
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.14
7. 其他费用	6.4.7.19	83,386.28	114,544.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,936,992.66	20,147,797.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,936,992.66	20,147,797.61

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达易百智能量化策略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）	55,274,636.61	19,000,377.76	74,275,014.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,936,992.66	9,936,992.66
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）	39,288,422.22	8,793,702.66	48,082,124.88
其中：1.基金申购款	62,816,724.79	16,780,750.81	79,597,475.60
2.基金赎回款	-23,528,302.57	-7,987,048.15	-31,515,350.72
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）	94,563,058.83	37,731,073.08	132,294,131.91
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）	332,080,176.29	-8,238,172.56	323,842,003.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,147,797.61	20,147,797.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-189,709,879.55	-1,131,199.73	-190,841,079.28

值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	5,275,955.30	-125,351.08	5,150,604.22
2.基金赎回款	-194,985,834.85	-1,005,848.65	-195,991,683.50
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）	142,370,296.74	10,778,425.32	153,148,722.06

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

易方达易百智能量化策略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[2017]2163号《关于准予易方达易百智能量化策略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《易方达易百智能量化策略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，《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年1月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为794,754,696.47份基金份额，其中认购资金利息折合449,820.67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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及

本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取

得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	活期存款	7,004,397.60
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	7,004,397.60	

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	112,679,684.87	124,232,230.45	11,552,545.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	112,679,684.87	124,232,230.45	11,552,545.58

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	594.83
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	576.27
应收债券利息	-
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	24.66
合计	1,195.76

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

本基金本报告期末无应付交易费用。

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	2.62
应付证券出借违约金	-
预提费用	59,507.37
合计	59,509.99

6.4.7.9 实收基金

易方达易百智能量化策略混合 A

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	50,814,226.45	50,814,226.45
本期申购	38,295,178.98	38,295,178.98
本期赎回（以“-”号填列）	-17,744,700.53	-17,744,700.53
本期末	71,364,704.90	71,364,704.90

易方达易百智能量化策略混合 C

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	4,460,410.16	4,460,410.16
本期申购	24,521,545.81	24,521,545.81
本期赎回（以“-”号填列）	-5,783,602.04	-5,783,602.04
本期末	23,198,353.93	23,198,353.93

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

易方达易百智能量化策略混合 A

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	22,055,725.10	-4,539,578.27	17,516,146.83
本期利润	2,075,683.84	5,273,350.07	7,349,033.91
本期基金份额交易产生的变动数	9,220,759.69	-5,359,896.26	3,860,863.43
其中：基金申购款	17,350,772.14	-7,306,964.14	10,043,808.00
基金赎回款	-8,130,012.45	1,947,067.88	-6,182,944.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,352,168.63	-4,626,124.46	28,726,044.17

易方达易百智能量化策略混合 C

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	1,880,201.20	-395,970.27	1,484,230.93
本期利润	-432,891.96	3,020,850.71	2,587,958.75
本期基金份额交易产生的变动数	9,055,906.58	-4,123,067.35	4,932,839.23

其中：基金申购款	11,619,602.57	-4,882,659.76	6,736,942.81
基金赎回款	-2,563,695.99	759,592.41	-1,804,103.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,503,215.82	-1,498,186.91	9,005,028.91

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	16,808.46
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	6,529.79
其他	386.14
合计	23,724.39

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	574,507,306.01
减：卖出股票成本总额	572,164,031.59
买卖股票差价收入	2,343,274.42

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益。

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	853,135.80
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	853,135.80

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	8,294,200.78
——股票投资	8,294,200.78

——债券投资	-
——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	8,294,200.78

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	29,294.50
其他	-
合计	29,294.50

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	700,661.61
银行间市场交易费用	-
合计	700,661.61

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	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,278.91
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	83,386.28

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
中国银行股份有限公司	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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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	681,898.20	1,674,023.06
其中：支付销售机构的客户维护费	216,834.71	816,811.24

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	113,649.62	279,003.83

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

6.4.10.2.3 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		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	21,984.75	21,984.75
中国银行	-	1,024.30	1,024.30
合计	-	23,009.05	23,009.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,556.01	1,556.01
中国银行	-	1,615.30	1,615.30
广发证券	-	12.09	12.09
合计	-	3,183.40	3,183.40

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30 %，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付。

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

份额单位：份

项目	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	
	易方达易百智能 化策略混合A	易方达易百智能 化策略混合C	易方达易百智能 化策略混合A	易方达易百智能 化策略混合C
报告期初持有的基 金份额	-	-	-	-
报告期间申购/买入 总份额	23,782,305.37	-	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基 金份额	23,782,305.37	-	-	-
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	33.3250%	-	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

易方达易百智能量化策略混合 A

无。

易方达易百智能量化策略混合 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	7,004,397.60	16,808.46	9,244,820.54	57,142.30

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国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

易方达易百智能量化策略混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达易百智能量化策略混合 C

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
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	197	2,531.45	5,082.60	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	377	4,727.58	10,514.53	-
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	434	3,315.76	16,852.22	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	253	3,478.75	8,343.94	-
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	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-

				受限						
60528 7	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 流通 受限	31.56	31.56	349	11,014 .44	11,014 .44	-
68807 0	纵横 股份	2021-0 2-02	2021-0 8-10	新股 流通 受限	23.16	34.47	1,148	26,587 .68	39,571 .56	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
60046 0	士兰微	2021-06 -30	重大事项停牌	56.35	2021-0 7-01	59.49	800	45,580.00	45,080.00	-

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 0.00%(2020 年 12 月 31 日：0.00%)。

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	上年度末
--------	-----	------

	2021年6月30日	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	0.00	0.00
AAA 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	7,004,397.60	-	-	-	7,004,397.60
结算备付金	1,423,036.37	-	-	-	1,423,036.37
存出保证金	60,920.05	-	-	-	60,920.05
交易性金融资产	-	-	-	124,232,230.45	124,232,230.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,195.76	1,195.76
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	6,842.49	6,842.49
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,488,354.02	-	-	124,240,268.70	132,728,622.72
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	182,242.32	182,242.32
应付管理人报酬	-	-	-	158,410.28	158,410.28
应付托管费	-	-	-	26,401.71	26,401.71
应付销售服务费	-	-	-	7,926.51	7,926.51
应付交易费用	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	59,509.99	59,509.99
负债总计	-	-	-	434,490.81	434,490.81
利率敏感度缺口	8,488,354.02	-	-	123,805,777.89	132,294,131.91
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	4,515,068.93	-	-	-	4,515,068.93
结算备付金	100,860.40	-	-	-	100,860.40
存出保证金	60,126.91	-	-	-	60,126.91
交易性金融资产	-	-	-	70,311,155.33	70,311,155.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,027.07	10,027.07
应收利息	-	-	-	539.68	539.68
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	17,045.00	17,045.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,676,056.24	-	-	70,338,767.08	75,014,823.32
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	487,934.52	487,934.52
应付管理人报酬	-	-	-	94,238.47	94,238.47
应付托管费	-	-	-	15,706.42	15,706.42
应付销售服务费	-	-	-	1,553.56	1,553.56
应付交易费用	-	-	-	20,259.19	20,259.19
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	120,116.79	120,116.79
负债总计	-	-	-	739,808.95	739,808.95
利率敏感度缺口	4,676,056.24	-	-	69,598,958.13	74,275,014.37

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	124,232,230.45	93.91	70,311,155.33	94.66
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	124,232,230.45	93.91	70,311,155.33	94.66

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%	8,873,027.65	5,284,250.39
	2.业绩比较基准下降 5%	-8,873,027.65	-5,284,250.39

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 118,864,194.23 元，属于第二层次的余额为 5,368,036.22 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次 69,216,747.11 元，第二层次 1,094,408.22 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	124,232,230.45	93.60
	其中：股票	124,232,230.45	93.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	8,427,433.97	6.35
8	其他各项资产	68,958.30	0.05
9	合计	132,728,622.72	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	854,016.00	0.65
C	制造业	94,295,301.84	71.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,337,351.21	4.03
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	1,937,125.90	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	387,858.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,041,728.88	7.59
J	金融业	8,826,045.48	6.67
K	房地产业	632,688.00	0.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	282,305.70	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	1,626,795.00	1.23
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	124,232,230.45	93.91

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	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	3.89
2	300638	广和通	43,910	2,050,597.00	1.55
3	000001	平安银行	88,100	1,992,822.00	1.51
4	601009	南京银行	170,704	1,795,806.08	1.36
5	600926	杭州银行	107,000	1,578,250.00	1.19
6	688366	昊海生科	7,234	1,514,076.20	1.14
7	300274	阳光电源	12,700	1,461,262.00	1.10
8	300137	先河环保	170,200	1,390,534.00	1.05
9	300474	景嘉微	13,700	1,341,504.00	1.01
10	300502	新易盛	42,765	1,336,406.25	1.01
11	300623	捷捷微电	34,500	1,305,135.00	0.99
12	688188	柏楚电子	2,976	1,297,536.00	0.98
13	603678	火炬电子	18,700	1,262,250.00	0.95
14	002139	拓邦股份	67,900	1,221,521.00	0.92
15	002402	和而泰	50,400	1,208,088.00	0.91
16	688036	传音控股	5,766	1,207,977.00	0.91
17	002396	星网锐捷	56,500	1,206,275.00	0.91
18	600884	杉杉股份	51,100	1,191,652.00	0.90
19	000725	京东方 A	186,200	1,161,888.00	0.88
20	002179	中航光电	14,200	1,122,084.00	0.85
21	002623	亚玛顿	26,400	1,116,456.00	0.84
22	002612	朗姿股份	20,500	1,107,410.00	0.84
23	300782	卓胜微	2,060	1,107,250.00	0.84
24	002461	珠江啤酒	101,200	1,107,128.00	0.84
25	300034	钢研高纳	34,100	1,098,361.00	0.83
26	300223	北京君正	10,800	1,089,936.00	0.82
27	688608	恒玄科技	3,389	1,074,007.99	0.81
28	000963	华东医药	22,900	1,053,629.00	0.80
29	300593	新雷能	23,858	1,036,630.10	0.78
30	000977	浪潮信息	36,300	1,021,119.00	0.77
31	002415	海康威视	15,800	1,019,100.00	0.77
32	300142	沃森生物	16,500	1,018,050.00	0.77
33	300627	华测导航	29,800	1,016,478.00	0.77
34	000733	振华科技	16,600	1,013,762.00	0.77
35	300122	智飞生物	5,400	1,008,342.00	0.76
36	300768	迪普科技	25,800	996,654.00	0.75
37	600919	江苏银行	139,800	992,580.00	0.75

38	688139	海尔生物	9,299	977,324.90	0.74
39	688018	乐鑫科技	4,182	976,162.44	0.74
40	601633	长城汽车	22,300	972,057.00	0.73
41	300394	天孚通信	38,060	963,679.20	0.73
42	002025	航天电器	19,029	954,684.93	0.72
43	000063	中兴通讯	28,700	953,701.00	0.72
44	688029	南微医学	3,032	945,044.08	0.71
45	300642	透景生命	10,950	939,619.50	0.71
46	688007	光峰科技	22,386	937,525.68	0.71
47	002049	紫光国微	6,000	925,140.00	0.70
48	688099	晶晨股份	8,182	918,020.40	0.69
49	000066	中国长城	62,600	913,960.00	0.69
50	688396	华润微	10,012	911,292.24	0.69
51	300613	富瀚微	5,748	895,998.24	0.68
52	300628	亿联网络	10,600	888,280.00	0.67
53	688363	华熙生物	3,186	885,261.96	0.67
54	002373	千方科技	51,300	856,710.00	0.65
55	002407	多氟多	24,100	856,514.00	0.65
56	600188	兖州煤业	55,600	854,016.00	0.65
57	000739	普洛药业	28,800	846,720.00	0.64
58	000830	鲁西化工	45,200	846,596.00	0.64
59	002414	高德红外	30,400	838,432.00	0.63
60	002920	德赛西威	7,600	836,608.00	0.63
61	002677	浙江美大	45,500	831,740.00	0.63
62	688016	心脉医疗	1,822	828,299.42	0.63
63	002648	卫星石化	21,100	826,909.00	0.63
64	300747	锐科激光	7,200	821,232.00	0.62
65	000933	神火股份	86,700	819,315.00	0.62
66	300692	中环环保	104,700	817,707.00	0.62
67	600584	长电科技	21,500	810,120.00	0.61
68	002573	清新环境	156,800	809,088.00	0.61
69	688169	石头科技	636	801,996.00	0.61
70	603986	兆易创新	4,200	789,180.00	0.60
71	600760	中航沈飞	12,980	782,694.00	0.59
72	002459	晶澳科技	15,800	774,200.00	0.59
73	603659	璞泰来	5,640	770,424.00	0.58
74	300679	电连技术	26,300	757,966.00	0.57
75	300031	宝通科技	47,900	754,904.00	0.57
76	300369	绿盟科技	46,900	748,055.00	0.57
77	688065	凯赛生物	7,098	744,509.22	0.56
78	601838	成都银行	58,700	741,968.00	0.56
79	688122	西部超导	11,343	735,820.41	0.56
80	688200	华峰测控	1,552	734,608.16	0.56
81	000596	古井贡酒	3,000	718,500.00	0.54

82	688019	安集科技	2,300	715,300.00	0.54
83	688599	天合光能	24,661	699,139.35	0.53
84	002268	卫士通	35,600	693,488.00	0.52
85	600893	航发动力	13,000	691,470.00	0.52
86	300383	光环新网	48,000	690,720.00	0.52
87	002745	木林森	51,500	690,100.00	0.52
88	300601	康泰生物	4,600	685,400.00	0.52
89	300762	上海瀚讯	24,100	680,825.00	0.51
90	300450	先导智能	11,320	680,784.80	0.51
91	300073	当升科技	12,100	679,899.00	0.51
92	002138	顺络电子	17,400	674,598.00	0.51
93	300680	隆盛科技	24,980	668,215.00	0.51
94	002145	中核钛白	51,400	665,630.00	0.50
95	601377	兴业证券	68,800	664,608.00	0.50
96	000661	长春高新	1,700	657,900.00	0.50
97	300207	欣旺达	20,100	654,456.00	0.49
98	600223	鲁商发展	39,200	632,688.00	0.48
99	300896	爱美客	800	631,104.00	0.48
100	600096	云天化	44,400	623,376.00	0.47
101	003022	联泓新科	20,300	623,210.00	0.47
102	300037	新宙邦	6,200	620,620.00	0.47
103	002833	弘亚数控	15,700	608,375.00	0.46
104	603369	今世缘	11,100	601,176.00	0.45
105	000026	飞亚达	43,000	598,560.00	0.45
106	002762	金发拉比	38,200	584,460.00	0.44
107	603290	斯达半导	1,800	576,000.00	0.44
108	000550	江铃汽车	24,400	571,692.00	0.43
109	300850	新强联	6,500	569,985.00	0.43
110	300196	长海股份	33,200	569,712.00	0.43
111	300308	中际旭创	14,700	566,244.00	0.43
112	002966	苏州银行	76,700	563,745.00	0.43
113	002709	天赐材料	5,000	532,900.00	0.40
114	688006	杭可科技	6,243	530,655.00	0.40
115	688126	沪硅产业	18,113	528,537.34	0.40
116	002821	凯莱英	1,400	521,640.00	0.39
117	688008	澜起科技	8,286	516,880.68	0.39
118	688012	中微公司	3,083	511,531.36	0.39
119	600779	水井坊	4,000	505,400.00	0.38
120	300769	德方纳米	2,400	496,056.00	0.37
121	688208	道通科技	5,693	495,234.07	0.37
122	600732	爱旭股份	34,100	474,672.00	0.36
123	002372	伟星新材	22,500	465,075.00	0.35
124	000650	仁和药业	42,400	463,008.00	0.35
125	601689	拓普集团	12,100	452,903.00	0.34

126	002497	雅化集团	19,700	448,766.00	0.34
127	600171	上海贝岭	14,000	426,020.00	0.32
128	300624	万兴科技	7,200	421,776.00	0.32
129	300327	中颖电子	4,800	409,104.00	0.31
130	688696	极米科技	483	401,856.00	0.30
131	600141	兴发集团	21,200	399,196.00	0.30
132	601788	光大证券	22,300	398,947.00	0.30
133	300363	博腾股份	4,700	395,364.00	0.30
134	601919	中远海控	12,700	387,858.00	0.29
135	000625	长安汽车	14,600	383,688.00	0.29
136	002900	哈三联	11,400	379,278.00	0.29
137	603806	福斯特	3,600	378,468.00	0.29
138	002291	星期六	19,540	366,961.20	0.28
139	300036	超图软件	16,400	358,504.00	0.27
140	688005	容百科技	2,819	341,662.80	0.26
141	688390	固德威	969	323,646.00	0.24
142	603589	口子窖	4,600	311,374.00	0.24
143	688202	美迪西	543	282,305.70	0.21
144	002531	天顺风能	29,700	256,905.00	0.19
145	603026	石大胜华	1,500	243,075.00	0.18
146	301015	百洋医药	4,332	235,763.90	0.18
147	000301	东方盛虹	10,200	213,180.00	0.16
148	002129	中环股份	5,400	208,440.00	0.16
149	603218	日月股份	7,000	189,560.00	0.14
150	600483	福能股份	17,700	185,673.00	0.14
151	600522	中天科技	16,200	162,000.00	0.12
152	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.12
153	688111	金山办公	398	157,130.40	0.12
154	300663	科蓝软件	4,000	153,640.00	0.12
155	300631	久吾高科	6,100	149,206.00	0.11
156	603893	瑞芯微	1,000	139,460.00	0.11
157	002371	北方华创	500	138,690.00	0.10
158	300543	朗科智能	7,400	113,072.00	0.09
159	688536	思瑞浦	200	110,200.00	0.08
160	301016	雷尔伟	2,527	106,444.30	0.08
161	300661	圣邦股份	400	101,092.00	0.08
162	300390	天华超净	1,700	81,651.00	0.06
163	002812	恩捷股份	300	70,230.00	0.05
164	300458	全志科技	800	70,128.00	0.05
165	603236	移远通信	400	68,244.00	0.05
166	300408	三环集团	1,500	63,630.00	0.05
167	002236	大华股份	3,000	63,300.00	0.05
168	300719	安达维尔	4,100	62,976.00	0.05
169	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.05

170	600132	重庆啤酒	300	59,385.00	0.04
171	600438	通威股份	1,300	56,251.00	0.04
172	601012	隆基股份	560	49,750.40	0.04
173	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.04
174	600460	士兰微	800	45,080.00	0.03
175	600426	华鲁恒升	1,400	43,330.00	0.03
176	603313	梦百合	1,397	41,979.85	0.03
177	688070	纵横股份	1,148	39,571.56	0.03
178	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
179	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
180	001207	联科科技	682	22,581.02	0.02
181	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
182	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
183	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
184	301009	可靠股份	377	10,514.53	0.01
185	603308	应流股份	400	8,260.00	0.01
186	300956	英力股份	197	5,082.60	0.00
187	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
188	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
189	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	000001	平安银行	5,762,701.52	7.76
2	002142	宁波银行	4,451,584.00	5.99
3	002966	苏州银行	4,173,811.00	5.62
4	601166	兴业银行	4,157,280.00	5.60
5	600905	三峡能源	3,436,527.95	4.63
6	600926	杭州银行	3,416,285.75	4.60
7	000725	京东方 A	3,232,070.00	4.35
8	300122	智飞生物	3,141,737.00	4.23
9	601939	建设银行	3,107,662.00	4.18
10	600036	招商银行	2,989,376.00	4.02
11	002918	蒙娜丽莎	2,980,800.00	4.01
12	000661	长春高新	2,826,401.00	3.81
13	300628	亿联网络	2,730,535.75	3.68
14	000568	泸州老窖	2,701,677.00	3.64
15	601009	南京银行	2,531,820.84	3.41

16	002034	旺能环境	2,512,799.00	3.38
17	600919	江苏银行	2,494,309.00	3.36
18	300638	广和通	2,458,150.30	3.31
19	601788	光大证券	2,457,120.00	3.31
20	000333	美的集团	2,440,232.00	3.29
21	600438	通威股份	2,428,712.00	3.27
22	300031	宝通科技	2,406,198.47	3.24
23	300137	先河环保	2,381,151.00	3.21
24	002050	三花智控	2,362,815.00	3.18
25	002415	海康威视	2,339,282.00	3.15
26	002705	新宝股份	2,322,327.36	3.13
27	300747	锐科激光	2,292,965.00	3.09
28	601233	桐昆股份	2,273,843.00	3.06
29	002677	浙江美大	2,237,814.00	3.01
30	300677	英科医疗	2,226,152.00	3.00
31	002493	荣盛石化	2,214,803.00	2.98
32	601398	工商银行	2,207,023.00	2.97
33	002043	兔宝宝	2,154,997.56	2.90
34	002461	珠江啤酒	2,152,356.00	2.90
35	600031	三一重工	2,149,575.00	2.89
36	000963	华东医药	2,142,391.00	2.88
37	603986	兆易创新	2,137,366.13	2.88
38	002648	卫星石化	2,137,004.80	2.88
39	300474	景嘉微	2,106,283.00	2.84
40	601995	中金公司	2,099,127.00	2.83
41	601377	兴业证券	2,086,688.00	2.81
42	300450	先导智能	2,077,495.05	2.80
43	002138	顺络电子	2,065,288.80	2.78
44	000830	鲁西化工	2,057,855.00	2.77
45	000425	徐工机械	2,054,272.00	2.77
46	300593	新雷能	2,035,513.92	2.74
47	300394	天孚通信	2,026,202.00	2.73
48	000932	华菱钢铁	2,014,517.00	2.71
49	300782	卓胜微	2,007,007.20	2.70
50	002414	高德红外	1,988,431.00	2.68
51	002367	康力电梯	1,984,923.00	2.67
52	002833	弘亚数控	1,961,935.00	2.64
53	002110	三钢闽光	1,959,940.00	2.64
54	002372	伟星新材	1,955,126.00	2.63
55	601012	隆基股份	1,944,108.00	2.62
56	002139	拓邦股份	1,930,093.00	2.60
57	300274	阳光电源	1,928,264.00	2.60
58	002353	杰瑞股份	1,899,986.00	2.56
59	300762	上海瀚讯	1,891,851.40	2.55

60	002032	苏泊尔	1,885,427.00	2.54
61	000858	五粮液	1,872,337.00	2.52
62	300502	新易盛	1,853,443.40	2.50
63	600519	贵州茅台	1,850,234.00	2.49
64	600176	中国巨石	1,844,777.72	2.48
65	002541	鸿路钢构	1,819,092.38	2.45
66	600346	恒力石化	1,814,484.00	2.44
67	002867	周大生	1,787,144.88	2.41
68	300601	康泰生物	1,786,496.00	2.41
69	000157	中联重科	1,776,630.00	2.39
70	300680	隆盛科技	1,770,557.00	2.38
71	002179	中航光电	1,747,011.00	2.35
72	002597	金禾实业	1,743,008.00	2.35
73	000928	中钢国际	1,733,191.00	2.33
74	002821	凯莱英	1,730,792.00	2.33
75	603378	亚士创能	1,717,652.52	2.31
76	002007	华兰生物	1,677,312.00	2.26
77	002459	晶澳科技	1,664,665.00	2.24
78	002402	和而泰	1,655,878.00	2.23
79	300059	东方财富	1,628,209.00	2.19
80	000703	恒逸石化	1,607,031.00	2.16
81	000807	云铝股份	1,595,699.00	2.15
82	002623	亚玛顿	1,593,197.00	2.14
83	688366	昊海生科	1,590,747.57	2.14
84	002938	鹏鼎控股	1,585,018.00	2.13
85	000825	太钢不锈	1,583,883.00	2.13
86	002396	星网锐捷	1,574,632.00	2.12
87	002573	清新环境	1,568,986.00	2.11
88	603313	梦百合	1,564,107.18	2.11
89	000002	万科 A	1,560,204.90	2.10
90	300408	三环集团	1,550,581.00	2.09
91	600483	福能股份	1,550,059.92	2.09
92	002049	紫光国微	1,545,189.00	2.08
93	000538	云南白药	1,543,500.00	2.08
94	000596	古井贡酒	1,543,204.00	2.08
95	688122	西部超导	1,536,729.25	2.07
96	600219	南山铝业	1,532,083.00	2.06
97	000998	隆平高科	1,529,398.00	2.06
98	603659	璞泰来	1,523,205.55	2.05
99	002745	木林森	1,517,844.00	2.04
100	002612	朗姿股份	1,512,758.00	2.04
101	300627	华测导航	1,510,656.00	2.03
102	688016	心脉医疗	1,507,864.10	2.03
103	002624	完美世界	1,507,124.60	2.03

104	300037	新宙邦	1,503,772.00	2.02
105	300692	中环环保	1,503,292.40	2.02
106	002304	洋河股份	1,496,247.00	2.01
107	000739	普洛药业	1,492,869.00	2.01
108	300750	宁德时代	1,490,545.00	2.01
109	300034	钢研高纳	1,488,119.31	2.00

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	600036	招商银行	6,769,545.46	9.11
2	600519	贵州茅台	5,176,523.00	6.97
3	002142	宁波银行	4,714,894.00	6.35
4	000001	平安银行	4,276,091.00	5.76
5	601166	兴业银行	4,259,352.00	5.73
6	601318	中国平安	3,727,747.00	5.02
7	601939	建设银行	3,566,203.17	4.80
8	002966	苏州银行	3,562,569.00	4.80
9	000333	美的集团	3,511,705.00	4.73
10	000858	五粮液	3,160,363.01	4.25
11	002918	蒙娜丽莎	2,980,115.00	4.01
12	601012	隆基股份	2,829,114.60	3.81
13	603882	金域医学	2,768,237.80	3.73
14	601688	华泰证券	2,698,676.00	3.63
15	600031	三一重工	2,688,630.28	3.62
16	000568	泸州老窖	2,647,193.00	3.56
17	002034	旺能环境	2,582,876.00	3.48
18	603501	韦尔股份	2,553,995.00	3.44
19	002050	三花智控	2,386,507.00	3.21
20	600438	通威股份	2,365,802.00	3.19
21	600887	伊利股份	2,297,453.00	3.09
22	601233	桐昆股份	2,197,988.00	2.96
23	002705	新宝股份	2,196,969.00	2.96
24	601398	工商银行	2,188,311.00	2.95
25	300122	智飞生物	2,186,985.00	2.94
26	002493	荣盛石化	2,146,403.00	2.89
27	601995	中金公司	2,106,129.82	2.84
28	300677	英科医疗	2,098,779.00	2.83
29	002043	兔宝宝	2,098,131.98	2.82
30	000425	徐工机械	2,038,868.00	2.75
31	601211	国泰君安	2,025,127.08	2.73

32	601788	光大证券	2,013,462.00	2.71
33	002353	杰瑞股份	1,994,087.71	2.68
34	002110	三钢闽光	1,988,433.00	2.68
35	000928	中钢国际	1,943,180.23	2.62
36	000725	京东方 A	1,936,570.00	2.61
37	000932	华菱钢铁	1,932,312.00	2.60
38	601888	中国中免	1,914,776.00	2.58
39	002007	华兰生物	1,913,866.00	2.58
40	603378	亚士创能	1,906,676.35	2.57
41	002367	康力电梯	1,896,354.00	2.55
42	600176	中国巨石	1,887,791.85	2.54
43	002541	鸿路钢构	1,882,938.67	2.54
44	603260	合盛硅业	1,878,059.59	2.53
45	300628	亿联网络	1,875,183.00	2.52
46	603313	梦百合	1,862,693.00	2.51
47	600998	九州通	1,848,276.80	2.49
48	600298	安琪酵母	1,833,562.00	2.47
49	000661	长春高新	1,832,221.00	2.47
50	002032	苏泊尔	1,829,482.42	2.46
51	601678	滨化股份	1,770,002.40	2.38
52	600905	三峡能源	1,750,680.00	2.36
53	000807	云铝股份	1,732,476.97	2.33
54	601186	中国铁建	1,710,024.00	2.30
55	600919	江苏银行	1,708,192.00	2.30
56	002597	金禾实业	1,699,588.00	2.29
57	002867	周大生	1,686,930.00	2.27
58	300747	锐科激光	1,660,757.00	2.24
59	000157	中联重科	1,656,050.00	2.23
60	600926	杭州银行	1,644,010.00	2.21
61	002938	鹏鼎控股	1,631,325.00	2.20
62	000002	万科 A	1,622,481.00	2.18
63	603986	兆易创新	1,620,524.40	2.18
64	000538	云南白药	1,613,141.00	2.17
65	000825	太钢不锈	1,612,378.00	2.17
66	600875	东方电气	1,608,725.00	2.17
67	600346	恒力石化	1,597,126.00	2.15
68	600019	宝钢股份	1,589,613.00	2.14
69	300031	宝通科技	1,582,813.00	2.13
70	000703	恒逸石化	1,529,859.15	2.06
71	300450	先导智能	1,508,617.00	2.03
72	002648	卫星石化	1,491,368.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	617,790,905.93
卖出股票收入（成交）总额	574,507,306.01

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 12 月 28 日，南京银行因“未按规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；未按规定报送账户开户资料；未按规定开立账户使用；未按规定加强特约商户与受理终端管理；违规占压财政资金”的违法违规行为，被中国人民银行南京分行处以警告，并处罚款 736 万元，没收违法所得人民币 208778.02 元。

2020 年 10 月 16 日，中国银保监会宁波银保监局对平安银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 100 万元的行政处罚决定：贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等。

2021 年 5 月 10 日，中国银行保监会上海监督局对平安银行股份有限公司资金运营中心的如下违法违规行为作出责令整改，并处罚共计 300 万元的行政处罚决定：1、2016 年 5 月，该中心违规向未取得土地使用权证的房地产项目提供融资。2、2017 年 3 月，该中心违规向土地储备项目提供融资。3、2017 年 3 月，该中心违规提供政府性融资。4、2016 年 5 月至 2018 年 5 月，该中心黄金份额租赁款违规用于证券交易所股票质押回购。5、2018 年 1 月，该中心虚增存款。6、2016 年 1 月至 2019 年 8 月，该中心向黄金产业链外企业提供实物黄金租赁。

2021 年 5 月 18 日，中国银保监会深圳监管局对平安银行信用卡中心的如下违法违规行为作出处罚 40 万元的行政处罚决定：未对申领首张信用卡的客户进行亲访亲签。

2021 年 5 月 28 日，中国银保监会云南监管局对平安银行股份有限公司的如下违法违规行为做出罚款 210 万元的行政处罚决定：利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资；流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单；固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品。

2021 年 1 月 12 日，中国人民银行杭州中心支行针对杭州银行股份有限公司存在的 1. 经收的海关税款存在延压情况；2. 零余额账户退库资金存在被占压情况，根据《金融违法行为处罚办法》，给予警告，并处罚款 25 万元。

2021 年 5 月 18 日，中国银保监会浙江监管针对杭州银行股份有限公司存在的“一、房地产项目融资业务不审慎；二、流动资金贷款管理不审慎，资金被挪用于支付土地出让金；三、授信投放不审慎，超额投放；四、理财资金管理不审慎，回流借款人母公司挪用于支付土地出让保证金；五、

个人经营贷款管理不审慎，资金挪用于购房；六、个人消费贷款管理不审慎，资金挪用于购房。”违法违规事实，对杭州银行罚款 250 万元。

本基金投资南京银行、平安银行、杭州银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除南京银行、平安银行、杭州银行外，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	60,920.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,195.76
5	应收申购款	6,842.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,958.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	3.89	新股流通受限

§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

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
易方达易百智能量化策略混合 A	951	75,041.75	36,753,793.05	51.50%	34,610,911.85	48.50%
易方达易百智能量化策略混合 C	447	51,897.88	19,692,567.78	84.89%	3,505,786.15	15.11%
合计	1,398	67,641.67	56,446,360.83	59.69%	38,116,698.00	40.31%

8.2 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	易方达易百智能量化策略混合 A	47,112.09	0.0660%
	易方达易百智能量化策略混合 C	1.00	0.0000%
	合计	47,113.09	0.0498%

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	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	易方达易百智能量化策略混合 A	0
	易方达易百智能量化策略混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达易百智能量化策略混合 A	0~10
	易方达易百智能量化策略混合 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达易百智能量化策略混合	易方达易百智能量化策略混合
----	---------------	---------------

	A	C
基金合同生效日（2018 年 1 月 24 日）基金份额总额	785,605,733.86	9,148,962.61
本报告期期初基金份额总额	50,814,226.45	4,460,410.16
本报告期基金总申购份额	38,295,178.98	24,521,545.81
减：本报告期基金总赎回份额	17,744,700.53	5,783,602.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	71,364,704.90	23,198,353.93

§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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，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	
中金财富	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	1,122,900,459.16	94.54%	6,378.88	32.96%	-

广发证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	5	64,870,590.86	5.46%	12,974.58	67.04%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增交易单元的证券公司为长江证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、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
中金财富	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

华安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

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	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	2021-01-11
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	中国证券报	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	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	2021-01-23
4	易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证	中国证券报、基金管理人	2021-03-20

	券投资基金基金经理变更公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
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	中国证券报	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	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	2021-04-02
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第一季度报告提示性公告	中国证券报	2021-04-19

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021年04月21日~2021年06月30日	-	23,782,305.37	-	23,782,305.37	25.15%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；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>							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达易百智能量化策略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。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日