易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 18
§5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
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 18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 18
§6 审计报告 18
6.1 审计意见 18
6.2 形成审计意见的基础 19
6.3 其他信息 19
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 19
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 19
§7 年度财务报表 20
7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 23
7.4 报表附注 25
§8 投资组合报告 58
8.1 期末基金资产组合情况 58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 63

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 66
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 67
8.12 投资组合报告附注 67
§9 基金份额持有人信息 69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 69
§10 开放式基金份额变动 70
§11 重大事件揭示 70
11.1 基金份额持有人大会决议 70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 70
11.4 基金投资策略的改变 70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 71
11.8 其他重大事件 73
§12 备查文件目录 74
12.1 备查文件目录 74
12.2 存放地点 74
12.3 查阅方式 74

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达瑞程混合	
基金主代码	003961	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 15 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,904,301,763.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C
下属分级基金的交易代码	003961	003962
报告期末下属分级基金的份额总额	1,257,779,362.99 份	646,522,400.88 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场因素、估值及流动性因素、政策因素等分析，并重点考虑债券市场情况，确定组合中股票、债券、货币市场工具等资产类别的配置比例。股票投资策略方面，本基金将通过分析行业景气度和行业竞争格局，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置的基础上，本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。债券投资策略方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	胡波
	联系电话	020-85102688	021-61618888
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95528
传真		020-38798812	021-63602540
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	上海市中山东一路12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	上海市北京东路689号
邮政编码		510620	200001
法定代表人		刘晓艳	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C
本期已实现收益	134,197,678.72	41,871,102.78	143,676,504.58	13,521,595.24	28,862,144.95	1,766,884.02
本期利润	637,545,698.46	229,947,511.88	259,864,716.79	30,789,154.63	104,255,610.95	4,019,201.33
加权平均基金份额本期利润	1.0122	1.0165	1.5765	1.7502	0.8299	0.6271
本期加权平均净值利润率	28.51%	28.12%	65.49%	61.85%	64.79%	49.24%
本期基金份额净值增长率	27.74%	27.49%	84.36%	83.99%	92.19%	94.55%
3.1.2 期末数据和指标	**2021 年末**		**2020 年末**		**2019 年末**	
	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C
期末可供分配利润	2,052,625,825.19	1,060,858,798.15	367,066,172.49	96,653,240.87	36,954,082.54	1,256,272.12
期末可供分配基金份额利润	1.6319	1.6409	1.2075	1.2204	0.3074	0.3177
期末基金资产净值	5,070,717,920.09	2,619,412,318.53	959,385,112.80	251,689,053.51	205,767,177.51	6,830,178.99
期末基金份额净值	4.0315	4.0515	3.1559	3.1779	1.7118	1.7272
3.1.3 累计期末指标	**2021 年末**		**2020 年末**		**2019 年末**	
	易方达瑞程	易方达瑞程	易方达瑞程	易方达瑞程	易方达瑞程	易方达瑞程混

	混合 A	混合 C	混合 A	混合 C	混合 A	合 C
基金份额累计净值增长率	303.15%	305.15%	215.59%	217.79%	71.18%	72.72%

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

易方达瑞程混合 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
过去三个月	18.72%	1.18%	1.28%	0.16%	17.44%	1.02%
过去六个月	18.34%	1.27%	1.23%	0.21%	17.11%	1.06%
过去一年	27.74%	1.31%	3.03%	0.24%	24.71%	1.07%
过去三年	352.62%	1.50%	23.36%	0.25%	329.26%	1.25%
过去五年	302.35%	1.33%	28.07%	0.24%	274.28%	1.09%
自基金合同生效起至今	303.15%	1.32%	27.64%	0.24%	275.51%	1.08%

易方达瑞程混合 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
过去三个月	18.66%	1.18%	1.28%	0.16%	17.38%	1.02%
过去六个月	18.22%	1.27%	1.23%	0.21%	16.99%	1.06%
过去一年	27.49%	1.31%	3.03%	0.24%	24.46%	1.07%
过去三年	356.35%	1.50%	23.36%	0.25%	332.99%	1.25%
过去五年	304.38%	1.33%	28.07%	0.24%	276.31%	1.09%
自基金合同生效起至今	305.15%	1.32%	27.64%	0.24%	277.51%	1.08%

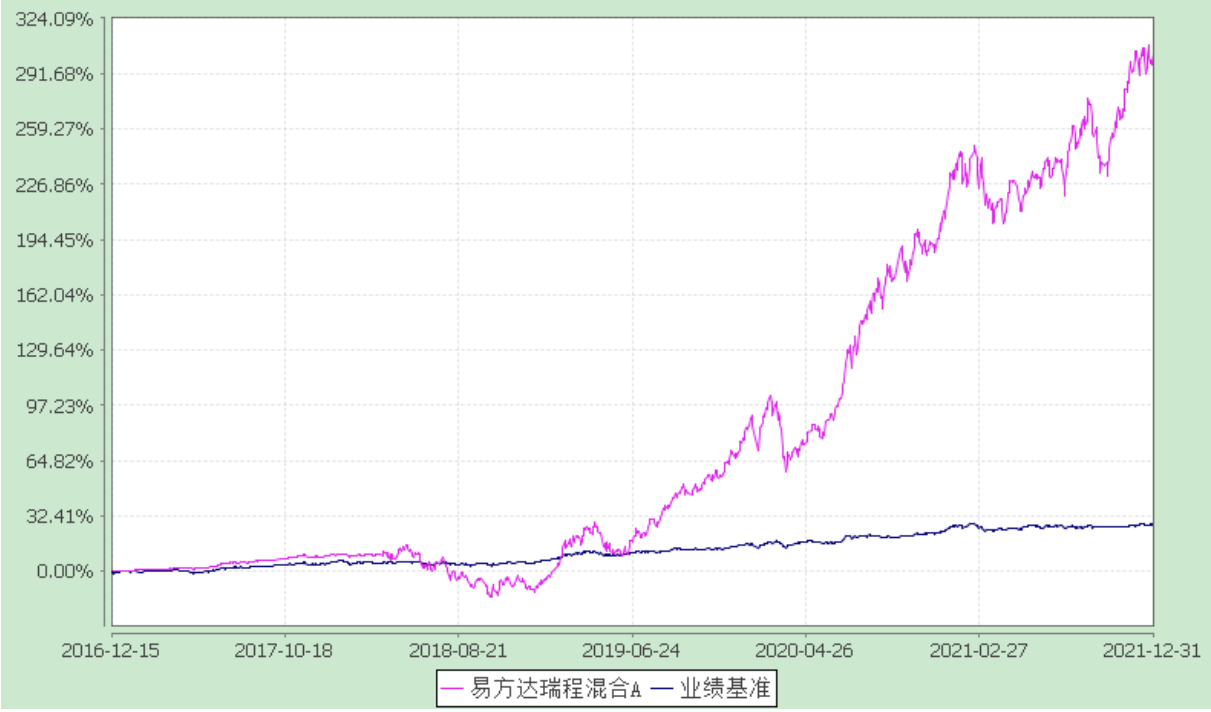
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金

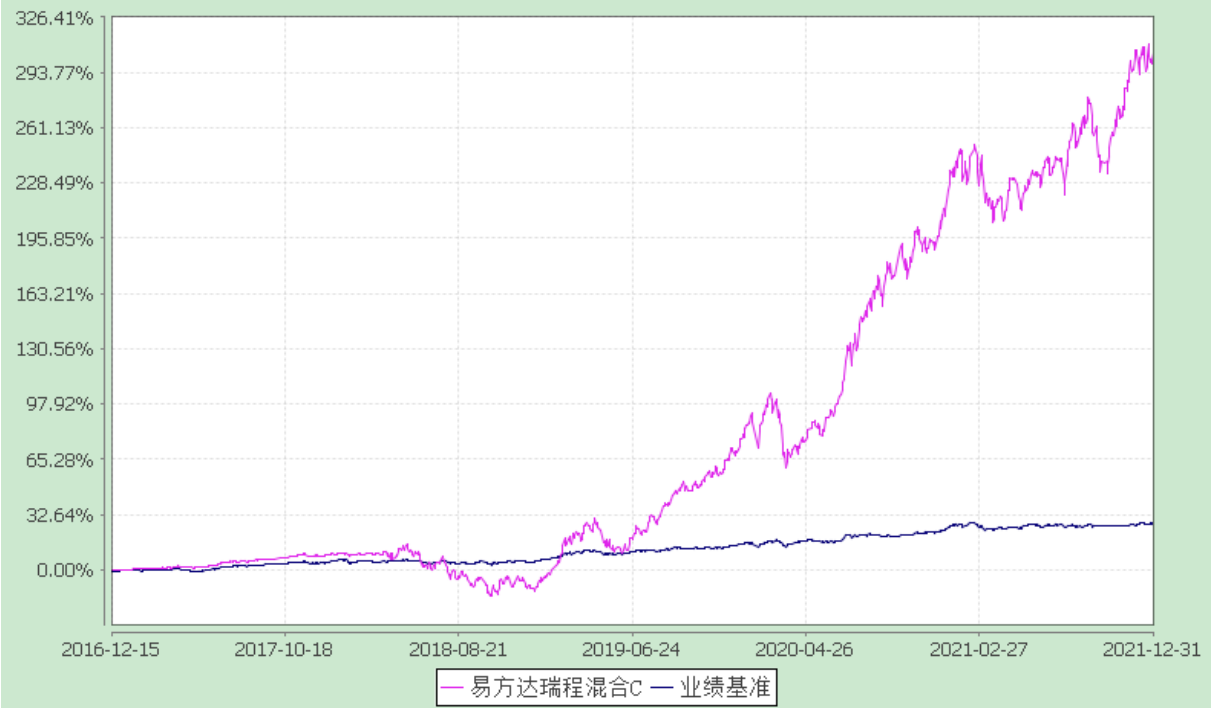
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2016 年 12 月 15 日至 2021 年 12 月 31 日）

易方达瑞程混合 A



易方达瑞程混合 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 303.15%，C 类基金份额净值增

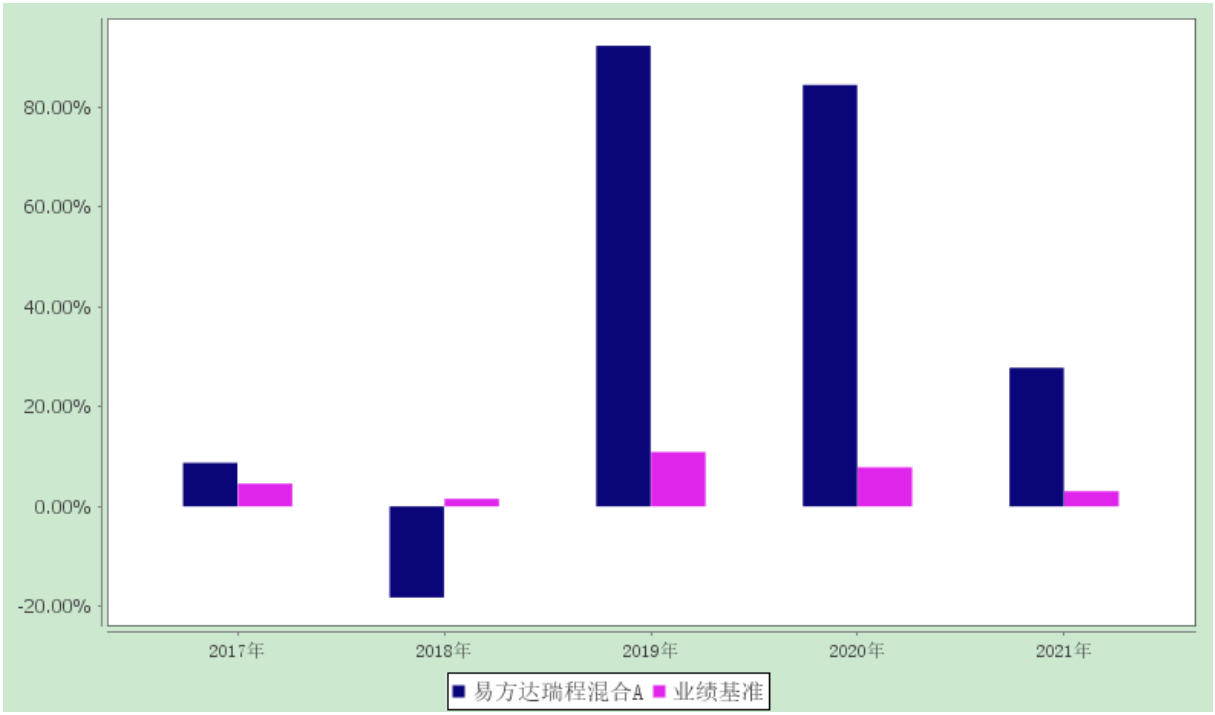
长率为 305.15%，同期业绩比较基准收益率为 27.64%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

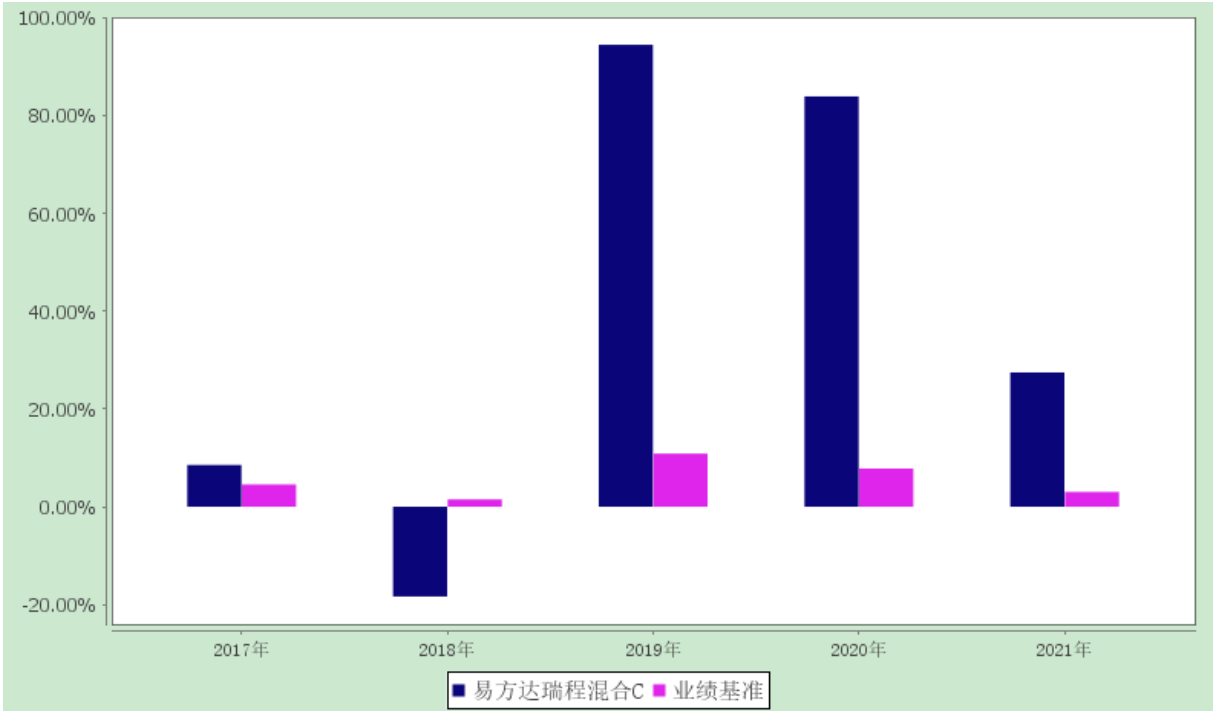
易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达瑞程混合 A



易方达瑞程混合 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，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		
林森	本基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益全策略投资部联席总经理	2017-01-26	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任道富银行风险管理部风险管理经理、外汇利率交易部利率交易员，太平洋资产管理公司（PIMCO）基金管理部基金经理，易方达基金管理有限公司固定收益投资部总经理助理、投资经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、基金经理助理
张凯嶜	本基金的基金经理助理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达岁丰添利债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理助理（自 2016 年 09 月 09 日至 2021 年 02 月 10 日）、易方达投资级信用债债券型证券投资基金的	2021-02-10	-	10 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员

	基金经理助理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理助理、易方达中债 3-5 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理助理、易方达中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理助理、易方达中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理助理、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳健增长混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达平稳增长证券投资基金的基金经理助理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳健回报一年封闭运作混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳健增利混合型证券投资基金的基金经理助理				

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内，林森曾兼任2个私募资产管理计划的投资经理，上述私募资产管理计划已分别于2021年8月23日、2021年9月16日终止。报告期末，林森没有兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，具体按其对产品业绩和投资团队的贡献等情况综合评定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的管控措施、公平交易执行程序和分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

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

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

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的

公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形，公司进一步加强了对投资指令下达、交易执行和反向交易控制等环节的控制措施，同时强化了对相关同反向交易价差及组合收益率差异的事后监测分析，按监管要求完善了相关信息披露，进一步落实对兼任基金经理投资交易行为的规范和监督。本报告期内，相关制度措施执行情况良好，未发现同一基金经理管理公募基金、私募资产管理计划之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 30 次，其中 27 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

债券市场方面，2021 全年在央行对流动性的呵护以及基本面走弱的背景下，债券市场整体表现强势，虽然在一季度、四季度初出现阶段性调整，但全年收益率明显下行。信用利差在 2020 年底经历信用风险事件冲击走阔后，2021 年上半年跟随收益率回落，下半年稳定在较低水平。具体来看，年初收益率借货币政策宽松窗口继续下行。1 月中旬后，税期叠加跨春节因素，资金面有所波动，引发市场对货币政策收紧的担忧，收益率快速上行到年内高位。春节后，资金面恢复宽松，同时权益市场调整导致市场风险偏好下降，收益率开始缓慢下行，并在二季度地方债发行不及预期、机构配置压力加大的助推下，债市“慢牛”行情开启。7 月初，央行超预期降准，叠加房地产市场明显走弱、增长压力渐显，收益率快速向下。10 月初，在进一步降准预期落空、大宗商品大涨、理财监管等因素推动下，收益率出现年内第二波明显调整。但央行在 10 月中下旬通过加大公开市场投放的方式稳定市场，而且对房地产行业的严监管也加剧了市场对经济下行的担忧，收益率重回下行趋势。12 月央行再次降准，1 年期 LPR（贷款市场报价利率）在 2020 年 4 月之后再次下调，市场降息预期走强，收益率进一步下行到年内低点。全年来看，1 年期和 10 年期国债收益率分别下行 25bp 和 40bp。

权益市场方面，全年呈现很强的盈利动量驱动特征。2021 年市场指数平稳增长，上证指数涨幅 4.8%。但是结构性分化巨大、行业轮动迅速，景气度和宏观政策是主要的拐点驱动力。市值行情同样分化巨大，全年中证 500 显著跑赢沪深 300，这也与短期景气度相关性较高。回顾全年，年初延续 2020 年的趋势，蓝筹板块表现良好，但自 2 月中旬开始受美债利率上行等因素影响市场整体回调。5 月随着电动车等行业景气度率先开启高增趋势，以新能源等为代表的成长板块快速崛起，成长与价值板块开始分化。三季度开始，在监管政策频出的扰动下，市场风险偏好受到压制。之后随着能耗双控持续加码，上游原材料价格大幅上涨，供给紧张对以制造业为主的高成长板块形成了较大的成本和需求冲击，甚至影响到了新能源等部分高景气赛道。在此大背景下，只有周期股有较好的表现。年末随着供给政策的纠偏、降准等宽松措施的落地以及中央经济工作会议稳增长的定调，市场整体逐渐回暖。

报告期内，本基金维持较为稳定的权益仓位并坚持自下而上地精选个股。我们维持重仓的行业包括汽车零部件、消费电子、物联网、军工和周期等。

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 4.0315 元，本报告期份额净值增长率为 27.74%，同期业绩比较基准收益率为 3.03%；C 类基金份额净值为 4.0515 元，本报告期份额净值增长率为 27.49%，同期业绩比较基准收益率为 3.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观研究不是我擅长的领域，因此我坚持用自下而上的方法进行投资。

股票方面，我们选股的第一个原则是估值和成长相匹配。市场习惯于线形外推，往往对高景气度公司的长期成长性过于乐观，因此我们倾向于避开市场较为拥挤的领域。

我们选股的第二个原则是更多地从供给侧角度考虑竞争格局，而不是仅仅关注需求侧。制造业的竞争是残酷的，短期需求爆发带来的高景气往往由于狂热的新进入者而难以持续。以汽车零部件行业为例，本组合布局的传统零部件企业都不直接参与汽车的电动化与智能化，因此短期景气度并不高。然而，A 股市场有一批从供给侧角度看格局比较清晰的低估值传统零部件企业。随着电动化和智能化的发展，汽车行业的整体格局有望重塑。传统整车厂和一级供应商的固有关系正在被突破。在整车厂更注重产品迭代速度与成本控制的新形势下，中国的零部件企业有望成为电动化浪潮下的“卖水人”。

从供给侧角度，我们也增加了一些周期股的配置。历史上我们对周期行业涉足较少，因为通过宏观研究对需求作判断超出了我们的能力圈。但是展望未来，周期行业的供需平衡将越来越取决于供给侧，供给侧的政策导向是清晰且明确的。部分周期行业龙头公司在未来的几年内，具备很深的

政策壁垒，很难有新进入者对他们进行挑战。

组合构建上，我们倾向于维持较高的个股分散度。分散投资虽然对提升组合的复合收益率没有帮助，但是大部分市场环境下能降低组合波动，提升组合夏普比率，给投资者带来更好的持有体验。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

（1）培育合规文化、严守合规底线、防控违法违规行为是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，秉持“客户利益至上、实事求是、坚守长期”的核心价值观，树立弘扬“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，促进公司合规文化建设。加大力度持续开展员工合规风控教育培训、强化合规监督考评机制，不断提高员工合规风控意识，深入践行“受人之托、为人理财”的信义义务。

（2）坚持“守底线、保合规、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示；认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示；持续完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

（3）参与新产品设计、新业务拓展工作，持续督促健全公募基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，严格进行合规审查，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

（4）持续深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券基金期货经营机构投资者投诉处理工作指引（试行）》等法律法规和监管政策、自律准则，进一步完善基金销售相关业务规范，加强投资者权益保护、促进长期理性投资。持续优化投资者适当性管理和客户投诉纠纷处理机制，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”职责义务，保障投资者合法权益。

（5）持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，进一步健全信息披露管理工作机制流程，不断推进信息披露文件制作审核的系统化，持续做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

（6）全面落实《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》等最新反洗钱法规与监管要求，

下大力气完善提升洗钱风险管理体系和内控机制：进一步修订制度流程、充实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，健全洗钱风险自评估工作机制方法，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，不断提高反洗钱合规和风险管理水平，推动反洗钱工作以风险为本向纵深发展。

（7）深入贯彻落实《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》《公开募集证券投资基金管理人及从业人员职业操守和道德规范指南》等规定，不断完善业务过程中的廉洁从业管理机制，加强对员工廉洁从业、职业操守和道德规范等方面的教育宣导和培训，努力将廉洁从业、职业操守和道德规范要求渗透落实到业务活动和日常经营的各个环节。

（8）以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、产品运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，坚持不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司内控及合规管理有效性的提升。

（9）不断检讨回顾合规管控框架和机制，促进监察稽核自身制度流程和工具手段的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

（10）继续顺利通过 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，获得 GIPS 鉴证报告，鉴证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达瑞程混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达瑞程混合 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制本托管人复核的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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60468000_G34 号

易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

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

治理层负责监督易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、

故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

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

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

昌华　马婧

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2022 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	22,011,111.70	31,611,058.27

结算备付金		17,104,663.34	6,411,876.40
存出保证金		1,016,103.92	265,222.50
交易性金融资产	7.4.7.2	7,679,028,333.96	1,217,866,301.76
其中：股票投资		7,137,585,701.90	1,049,639,004.94
基金投资		-	-
债券投资		541,442,632.06	168,227,296.82
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	37,999,978.17
应收利息	7.4.7.5	4,518,758.15	848,866.97
应收股利		-	-
应收申购款		22,650,261.41	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		**7,746,329,232.48**	**1,295,003,304.07**
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末** **2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		29,000,000.00	52,000,000.00
应付证券清算款		11,951,786.32	30,325,594.00
应付赎回款		7,798,466.08	-
应付管理人报酬		3,461,170.41	521,449.61
应付托管费		576,861.73	86,908.27
应付销售服务费		381,872.49	33,974.61

应付交易费用	7.4.7.7	2,703,361.21	680,677.56
应交税费		1,902.84	1,541.80
应付利息		-17,641.26	-21,008.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	341,214.04	300,000.00
负债合计		**56,198,993.86**	**83,929,137.76**
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,904,301,763.87	383,196,521.35
未分配利润	7.4.7.10	5,785,828,474.75	827,877,644.96
所有者权益合计		**7,690,130,238.62**	**1,211,074,166.31**
负债和所有者权益总计		**7,746,329,232.48**	**1,295,003,304.07**

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 4.0315 元，C 类基金份额净值 4.0515 元；基金份额总额 1,904,301,763.87 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,257,779,362.99 份，C 类基金份额总额 646,522,400.88 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达瑞程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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		**905,539,300.38**	**296,951,655.16**
1.利息收入		5,700,608.35	1,207,191.88
其中：存款利息收入	7.4.7.11	506,207.54	88,407.26
债券利息收入		4,965,503.03	1,118,784.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		228,897.78	-
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		204,328,159.38	162,282,891.66
其中：股票投资收益	7.4.7.12	142,741,403.84	152,890,185.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	23,312,425.77	2,327,147.05
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	38,274,329.77	7,065,559.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	691,424,428.84	133,455,771.60
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,086,103.81	5,800.02
减：二、费用		**38,046,090.04**	**6,297,783.74**
1．管理人报酬		18,043,254.22	2,643,382.17
2．托管费		3,007,209.05	440,563.84
3．销售服务费		1,604,851.88	98,247.90
4．交易费用	7.4.7.18	12,608,865.17	2,197,003.04
5．利息支出		2,518,068.48	697,674.80
其中：卖出回购金融资产支出		2,518,068.48	697,674.80
6．税金及附加		2,859.13	1,737.61
7．其他费用	7.4.7.19	260,982.11	219,174.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**867,493,210.34**	**290,653,871.42**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**867,493,210.34**	**290,653,871.42**

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达瑞程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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	383,196,521.35	827,877,644.96	1,211,074,166.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	867,493,210.34	867,493,210.34
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）	1,521,105,242.52	4,090,457,619.45	5,611,562,861.97
其中：1.基金申购款	2,166,366,833.17	5,718,162,352.85	7,884,529,186.02
2.基金赎回款	-645,261,590.65	-1,627,704,733.40	-2,272,966,324.05
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）	1,904,301,763.87	5,785,828,474.75	7,690,130,238.62
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	124,157,644.17	88,439,712.33	212,597,356.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	290,653,871.42	290,653,871.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	259,038,877.18	448,784,061.21	707,822,938.39

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	270,195,374.47	465,462,189.24	735,657,563.71
2.基金赎回款	-11,156,497.29	-16,678,128.03	-27,834,625.32
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）	383,196,521.35	827,877,644.96	1,211,074,166.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

易方达瑞程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[2016]2801 号《关于准予易方达瑞程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《易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 700,056,369.95 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.12 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

7.4.2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。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2记账本位币

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

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工

具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可

根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 转融通证券出借业务利息收入，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入转融通证券出借业务利息收入；

(6) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/(损失)：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11基金的收益分配政策

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

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

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

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

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6税项

（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。

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	22,011,111.70	31,611,058.27
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	22,011,111.70	31,611,058.27

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		6,284,519,620.93	7,137,585,701.90	853,066,080.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	432,987,239.76	460,994,632.06	28,007,392.30
	银行间市场	80,365,200.00	80,448,000.00	82,800.00
	合计	513,352,439.76	541,442,632.06	28,090,192.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,797,872,060.69	7,679,028,333.96	881,156,273.27
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		862,847,713.69	1,049,639,004.94	186,791,291.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	165,286,743.64	168,227,296.82	2,940,553.18
	银行间市场	-	-	-
	合计	165,286,743.64	168,227,296.82	2,940,553.18
资产支持证券		-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,028,134,457.33	1,217,866,301.76	189,731,844.43

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,003.51	2,468.03
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	7,697.00	2,885.30
应收债券利息	4,502,600.34	843,394.34
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	457.30	119.30
合计	4,518,758.15	848,866.97

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,702,418.22	680,677.56
银行间市场应付交易费用	942.99	-
合计	2,703,361.21	680,677.56

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,214.04	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	335,000.00	300,000.00
合计	341,214.04	300,000.00

7.4.7.9 实收基金

易方达瑞程混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	303,996,183.83	303,996,183.83
本期申购	1,404,248,763.20	1,404,248,763.20
本期赎回（以“-”号填列）	-450,465,584.04	-450,465,584.04
本期末	1,257,779,362.99	1,257,779,362.99

易方达瑞程混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	79,200,337.52	79,200,337.52

本期申购	762,118,069.97	762,118,069.97
本期赎回（以“-”号填列）	-194,796,006.61	-194,796,006.61
本期末	646,522,400.88	646,522,400.88

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

易方达瑞程混合 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	367,066,172.49	288,322,756.48	655,388,928.97
本期利润	134,197,678.72	503,348,019.74	637,545,698.46
本期基金份额交易产生的变动数	1,551,361,973.98	968,641,955.69	2,520,003,929.67
其中：基金申购款	2,287,925,071.90	1,375,028,268.01	3,662,953,339.91
基金赎回款	-736,563,097.92	-406,386,312.32	-1,142,949,410.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,052,625,825.19	1,760,312,731.91	3,812,938,557.10

易方达瑞程混合 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	96,653,240.87	75,835,475.12	172,488,715.99
本期利润	41,871,102.78	188,076,409.10	229,947,511.88
本期基金份额交易产生的变动数	922,334,454.50	648,119,235.28	1,570,453,689.78
其中：基金申购款	1,242,605,373.89	812,603,639.05	2,055,209,012.94
基金赎回款	-320,270,919.39	-164,484,403.77	-484,755,323.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,060,858,798.15	912,031,119.50	1,972,889,917.65

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	234,560.70	33,610.75
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	259,807.20	53,097.77
其他	11,839.64	1,698.74
合计	506,207.54	88,407.26

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,144,934,344.55	570,437,404.34
减：卖出股票成本总额	3,002,192,940.71	417,547,219.09
买卖股票差价收入	142,741,403.84	152,890,185.25

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	589,108,802.29	162,733,320.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	562,997,881.65	159,544,442.47
减：应收利息总额	2,798,494.87	861,731.06
买卖债券差价收入	23,312,425.77	2,327,147.05

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日

股票投资产生的股利收益	38,274,329.77	7,065,559.36
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	38,274,329.77	7,065,559.36

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	691,424,428.84	133,455,771.60
——股票投资	666,274,789.72	130,296,555.64
——债券投资	25,149,639.12	3,159,215.96
——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	691,424,428.84	133,455,771.60

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	4,086,103.81	5,800.02
其他	-	-
合计	4,086,103.81	5,800.02

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	12,608,365.17	2,197,003.04
银行间市场交易费用	500.00	-
合计	12,608,865.17	2,197,003.04

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	95,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	8,782.11	1,974.38
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	260,982.11	219,174.38

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东

珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

注：1.广东省广晟资产经营有限公司自 2021 年 3 月 12 日起将名称变更为广东省广晟控股集团有限公司；盈峰控股集团有限公司自 2021 年 7 月 26 日起将名称变更为盈峰集团有限公司。2.以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,043,254.22	2,643,382.17
其中：支付销售机构的客户维护费	427,866.55	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 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、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,007,209.05	440,563.84

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,322,492.16	1,322,492.16
合计	-	1,322,492.16	1,322,492.16
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达瑞程混合A	易方达瑞程混合C	合计
易方达基金管理有限公司	-	97,245.86	97,245.86
合计	-	97,245.86	97,245.86

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 0.20%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.20%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达瑞程混合 A

无。

易方达瑞程混合 C

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行-活期存款	22,011,111.70	234,560.70	31,611,058.27	33,610.75

注：本基金的上述银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	301038	深水规院	新股网下发行	2,660	17,768.80
广发证券	605033	美邦股份	新股网下发行	423	5,367.87
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 12 月 31 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
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

易方达瑞程混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达瑞程混合 C

本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股流通	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-

				受限						
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股流通受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润	2021-10-19	2022-04-26	新股	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-

	材料			流通受限						
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股流通受限	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新股流通受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	新股流通受限	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	新股流通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	新股流通受限	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新股流通受限	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股流通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-

301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新股流通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	新股流通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股流通受限	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-01-05	新股流通受限	57.58	57.58	37,440	2,155,795.20	2,155,795.20	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-07-05	新股流通受限	57.58	57.58	87,363	5,030,361.54	5,030,361.54	-
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股流通	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-

				受限						
688511	天微电子	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
688733	壹石通	2021-08-10	2022-02-17	新股流通受限	15.49	75.36	3,409	52,805.41	256,902.24	-
688767	博拓生物	2021-09-01	2022-03-08	新股流通受限	34.55	66.38	2,220	76,701.00	147,363.60	-
688786	悦安新材	2021-08-18	2022-02-28	新股流通受限	11.76	54.01	1,513	17,792.88	81,717.13	-
688789	宏华数科	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
688799	华纳药厂	2021-07-05	2022-01-13	新股流通受限	30.82	40.73	1,917	59,081.94	78,079.41	-
871245	威博液压	2021-12-24	2022-01-06	新股流通受限	9.68	9.68	200	1,936.00	1,936.00	-
603179	新泉股份	2021-09-07	2022-03-07	大宗交易流通受限	27.75	41.05	450,000	12,487,500.00	18,472,500.00	-
603596	伯特利	2021-07-27	2022-01-27	大宗交易流通受限	32.99	67.12	400,000	13,196,000.00	26,848,000.00	-
603666	亿嘉和	2021-08-25	2022-02-25	大宗交易流通受限	53.82	71.64	250,000	13,455,000.00	17,910,000.00	-
688128	中国电研	2021-12-15	2022-06-15	大宗交易流通受限	30.12	26.30	200,000	6,024,000.00	5,260,000.00	-
300729	乐歌股份	2021-10-12	2022-05-05	非公开发行流通受限	18.08	27.38	1,106,195	20,000,005.60	30,287,619.10	-
601117	中国化学	2021-09-08	2022-03-07	非公开发	8.50	11.43	7,058,824	60,000,004.00	80,682,358.32	-

				行流通受限						
688390	固德威	2021-09-22	2022-03-17	询价转让流通受限	300.02	426.01	43,061	12,919,161.22	18,344,416.61	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021-12-29	2022-01-14	新发流通受限	100.00	100.00	49,290	4,928,956.79	4,928,956.79	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 29,000,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 2.00%(2020 年 12 月 31 日：8.90%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31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	392,398,489.52	61,258,621.72
合计	392,398,489.52	61,258,621.72

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31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

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31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

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	46,465,316.85	5,743,714.40
AAA 以下	107,081,426.03	102,068,355.04
未评级	0.00	0.00
合计	153,546,742.88	107,812,069.44

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31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

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押

品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	22,011,111.70	-	-	-	22,011,111.70
结算备付金	17,104,663.34	-	-	-	17,104,663.34
存出保证金	1,016,103.92	-	-	-	1,016,103.92
交易性金融资产	388,049,427.30	124,420,562.59	28,972,642.17	7,137,585,701.90	7,679,028,333.96
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	-	-	-	4,518,758.15	4,518,758.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	22,650,261.41	22,650,261.41
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	428,181,306.26	124,420,562.59	28,972,642.17	7,164,754,721.46	7,746,329,232.48
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	29,000,000.00	-	-	-	29,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	11,951,786.32	11,951,786.32
应付赎回款	-	-	-	7,798,466.08	7,798,466.08
应付管理人报酬	-	-	-	3,461,170.41	3,461,170.41
应付托管费	-	-	-	576,861.73	576,861.73
应付销售服务费	-	-	-	381,872.49	381,872.49
应付交易费用	-	-	-	2,703,361.21	2,703,361.21
应交税费	-	-	-	1,902.84	1,902.84
应付利息	-	-	-	-17,641.26	-17,641.26
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	341,214.04	341,214.04
负债总计	29,000,000.00	-	-	27,198,993.86	56,198,993.86
利率敏感度缺口	399,181,306.26	124,420,562.59	28,972,642.17	7,137,555,727.60	7,690,130,238.62
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	31,611,058.27	-	-	-	31,611,058.27
结算备付金	6,411,876.40	-	-	-	6,411,876.40
存出保证金	265,222.50	-	-	-	265,222.50
交易性金融资产	69,271,410.00	6,229,736.32	92,726,150.50	1,049,639,004.94	1,217,866,301.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	37,999,978.17	37,999,978.17
应收利息	-	-	-	848,866.97	848,866.97
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	107,559,567.17	6,229,736.32	92,726,150.50	1,088,487,850.08	1,295,003,304.07
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	52,000,000.00	-	-	-	52,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	30,325,594.00	30,325,594.00
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	521,449.61	521,449.61
应付托管费	-	-	-	86,908.27	86,908.27
应付销售服务费	-	-	-	33,974.61	33,974.61
应付交易费用	-	-	-	680,677.56	680,677.56
应交税费	-	-	-	1,541.80	1,541.80
应付利息	-	-	-	-21,008.09	-21,008.09
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	300,000.00	300,000.00
负债总计	52,000,000.00	-	-	31,929,137.76	83,929,137.76
利率敏感度缺口	55,559,567.17	6,229,736.32	92,726,150.50	1,056,558,712.32	1,211,074,166.31

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	559,666.03	101,912.37
	2.市场利率上升 25 个基点	-558,220.13	-101,713.22

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	7,137,585,701.90	92.81	1,049,639,004.94	86.67
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	7,137,585,701.90	92.81	1,049,639,004.94	86.67

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,342,175,820.17	316,794,887.29
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,342,175,820.17	-316,794,887.29

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 7,076,300,349.16 元，属于第二层次的余额为 602,727,984.80 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 1,108,148,890.67 元，第二层次 109,717,411.09 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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）根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号－金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号－金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号－套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公开募集证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

（3）除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,137,585,701.90	92.14
	其中：股票	7,137,585,701.90	92.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	541,442,632.06	6.99
	其中：债券	541,442,632.06	6.99
	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	39,115,775.04	0.50
8	其他各项资产	28,185,123.48	0.36
9	合计	7,746,329,232.48	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,615,839,559.23	86.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	93,952,678.31	1.22
F	批发和零售业	168,328.64	0.00

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	278,329,707.44	3.62
J	金融业	14,775,994.00	0.19
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	134,443,590.82	1.75
N	水利、环境和公共设施管理业	44,659.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	7,137,585,701.90	92.81

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600438	通威股份	13,926,700	626,144,432.00	8.14
2	002241	歌尔股份	9,312,418	503,801,813.80	6.55
3	600089	特变电工	18,267,741	386,728,076.97	5.03
4	601799	星宇股份	1,592,498	325,267,716.50	4.23
5	603666	亿嘉和	3,977,084	297,888,550.08	3.87
6	600219	南山铝业	60,407,562	284,519,617.02	3.70
7	603179	新泉股份	4,971,198	214,149,949.44	2.78
8	603236	移远通信	985,684	200,980,967.60	2.61
9	300682	朗新科技	5,390,402	199,606,586.06	2.60
10	603712	七一二	4,054,100	175,542,530.00	2.28
11	002206	海利得	18,110,100	160,817,688.00	2.09
12	603997	继峰股份	9,851,279	158,408,566.32	2.06
13	000887	中鼎股份	6,902,000	150,532,620.00	1.96
14	600585	海螺水泥	3,684,400	148,481,320.00	1.93
15	002080	中材科技	4,251,334	144,630,382.68	1.88
16	603596	伯特利	2,091,298	144,562,340.80	1.88
17	300138	晨光生物	8,469,463	141,440,032.10	1.84

18	603730	岱美股份	5,963,021	139,057,649.72	1.81
19	603018	华设集团	16,071,315	134,356,193.40	1.75
20	603897	长城科技	2,662,418	132,694,913.12	1.73
21	600933	爱柯迪	6,857,551	132,213,583.28	1.72
22	603681	永冠新材	3,081,480	121,102,164.00	1.57
23	603348	文灿股份	1,934,363	112,986,142.83	1.47
24	300394	天孚通信	3,053,900	111,772,740.00	1.45
25	601689	拓普集团	1,956,740	103,707,220.00	1.35
26	002831	裕同科技	3,036,400	102,296,316.00	1.33
27	002897	意华股份	1,773,516	100,398,740.76	1.31
28	600210	紫江企业	10,835,900	99,473,562.00	1.29
29	601117	中国化学	8,163,724	93,941,158.32	1.22
30	300580	贝斯特	3,251,600	83,045,864.00	1.08
31	600888	新疆众和	9,236,700	76,387,509.00	0.99
32	300733	西菱动力	2,889,292	75,930,593.76	0.99
33	300709	精研科技	1,188,183	71,231,570.85	0.93
34	603444	吉比特	164,846	69,540,285.10	0.90
35	300258	精锻科技	5,354,766	68,594,552.46	0.89
36	002595	豪迈科技	2,458,303	68,242,491.28	0.89
37	601058	赛轮轮胎	4,485,100	66,334,629.00	0.86
38	605068	明新旭腾	1,823,350	65,914,102.50	0.86
39	600817	宇通重工	4,133,074	56,251,137.14	0.73
40	300433	蓝思科技	2,447,000	56,232,060.00	0.73
41	688080	映翰通	592,791	51,987,770.70	0.68
42	002444	巨星科技	1,666,303	50,838,904.53	0.66
43	603995	甬金股份	868,800	50,268,768.00	0.65
44	002318	久立特材	2,673,300	47,798,604.00	0.62
45	601702	华峰铝业	3,855,800	47,503,456.00	0.62
46	002851	麦格米特	1,184,000	37,911,680.00	0.49
47	600507	方大特钢	4,787,893	37,345,565.40	0.49
48	300729	乐歌股份	1,258,855	34,775,823.10	0.45
49	688128	中国电研	1,135,334	32,908,473.04	0.43
50	300566	激智科技	1,134,100	32,231,122.00	0.42
51	002110	三钢闽光	4,538,800	30,863,840.00	0.40
52	000733	振华科技	229,900	28,571,972.00	0.37
53	600066	宇通客车	2,323,093	25,600,484.86	0.33
54	000977	浪潮信息	587,000	21,032,210.00	0.27
55	000581	威孚高科	936,800	20,178,672.00	0.26
56	688390	固德威	43,061	18,344,416.61	0.24
57	300726	宏达电子	177,300	17,740,638.00	0.23
58	601128	常熟银行	2,235,400	14,775,994.00	0.19
59	688330	宏力达	125,160	14,225,685.60	0.18
60	601717	郑煤机	1,181,300	13,691,267.00	0.18
61	688299	长阳科技	275,592	9,011,858.40	0.12

62	605133	嵘泰股份	312,600	8,974,746.00	0.12
63	603678	火炬电子	114,576	8,667,674.40	0.11
64	002498	汉缆股份	1,545,100	7,988,167.00	0.10
65	600801	华新水泥	386,800	7,465,240.00	0.10
66	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	0.09
67	002782	可立克	401,400	7,173,018.00	0.09
68	603005	晶方科技	127,600	7,029,484.00	0.09
69	301030	仕净科技	197,859	6,396,585.45	0.08
70	601636	旗滨集团	351,900	6,017,490.00	0.08
71	603861	白云电器	519,300	5,894,055.00	0.08
72	002430	杭氧股份	151,200	4,537,512.00	0.06
73	603916	苏博特	137,920	3,552,819.20	0.05
74	688656	浩欧博	42,733	2,692,179.00	0.04
75	300870	欧陆通	27,302	2,286,815.52	0.03
76	300452	山河药辅	77,300	1,692,870.00	0.02
77	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.02
78	688389	普门科技	51,056	1,174,288.00	0.02
79	603416	信捷电气	24,007	1,142,973.27	0.01
80	688698	伟创电气	28,600	767,052.00	0.01
81	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.00
82	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.00
83	688733	壹石通	3,409	256,902.24	0.00
84	688767	博拓生物	2,220	147,363.60	0.00
85	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
86	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
87	688786	悦安新材	1,513	81,717.13	0.00
88	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.00
89	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.00
90	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
91	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
92	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
93	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
94	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
95	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
96	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
97	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
98	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
99	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
100	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
101	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
102	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
103	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
104	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
105	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00

106	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
107	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
108	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
109	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
110	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
111	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
112	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
113	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
114	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
115	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
116	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
117	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
118	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
119	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
120	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
121	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
122	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
123	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
124	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
125	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
126	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
127	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
128	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
129	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
130	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
131	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
132	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
133	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
134	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
135	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
136	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
137	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
138	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
139	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
140	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
141	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
142	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
143	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
144	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
145	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
146	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
147	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
148	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
149	301059	金三江	259	4,998.70	0.00

150	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
151	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
152	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
153	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
154	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
155	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
156	871245	威博液压	200	1,936.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600438	通威股份	646,459,614.80	53.38
2	600089	特变电工	390,654,990.07	32.26
3	002241	歌尔股份	350,219,802.50	28.92
4	601799	星宇股份	322,941,100.39	26.67
5	600219	南山铝业	306,026,886.95	25.27
6	603666	亿嘉和	225,451,034.61	18.62
7	603179	新泉股份	179,308,980.33	14.81
8	002206	海利得	156,948,105.86	12.96
9	600585	海螺水泥	150,533,338.17	12.43
10	603712	七一二	146,329,481.19	12.08
11	603236	移远通信	144,117,615.38	11.90
12	000887	中鼎股份	137,513,394.26	11.35
13	603897	长城科技	136,109,895.10	11.24
14	300682	朗新科技	130,142,493.23	10.75
15	603444	吉比特	129,553,954.79	10.70
16	300138	晨光生物	123,264,844.34	10.18
17	600933	爱柯迪	122,923,504.26	10.15
18	601636	旗滨集团	120,541,664.87	9.95
19	601117	中国化学	118,821,557.25	9.81
20	603997	继峰股份	117,505,951.48	9.70
21	601689	拓普集团	115,565,964.22	9.54
22	603730	岱美股份	112,250,117.29	9.27
23	603018	华设集团	111,908,781.70	9.24
24	300433	蓝思科技	110,700,087.52	9.14
25	600210	紫江企业	104,882,243.34	8.66
26	300394	天孚通信	101,194,151.47	8.36
27	603596	伯特利	93,347,740.67	7.71
28	603681	永冠新材	93,146,401.93	7.69

29	600888	新疆众和	91,750,613.61	7.58
30	002831	裕同科技	91,133,538.23	7.53
31	601600	中国铝业	89,176,074.64	7.36
32	000002	万科 A	88,568,722.04	7.31
33	002080	中材科技	87,419,761.38	7.22
34	000961	中南建设	86,638,767.70	7.15
35	002318	久立特材	83,370,007.18	6.88
36	002897	意华股份	81,110,052.37	6.70
37	002444	巨星科技	80,878,565.41	6.68
38	603348	文灿股份	80,693,141.80	6.66
39	300580	贝斯特	78,486,762.27	6.48
40	300258	精锻科技	74,681,008.32	6.17
41	002375	亚厦股份	72,158,038.76	5.96
42	605068	明新旭腾	70,123,781.27	5.79
43	002595	豪迈科技	68,467,671.07	5.65
44	300733	西菱动力	68,228,747.31	5.63
45	600031	三一重工	66,852,988.68	5.52
46	300709	精研科技	62,190,641.91	5.14
47	601012	隆基股份	61,682,503.16	5.09
48	000656	金科股份	60,948,202.05	5.03
49	601717	郑煤机	60,485,350.24	4.99
50	300014	亿纬锂能	57,264,430.93	4.73
51	601877	正泰电器	56,127,925.06	4.63
52	603063	禾望电气	56,123,173.38	4.63
53	300274	阳光电源	55,544,919.17	4.59
54	601058	赛轮轮胎	52,302,895.87	4.32
55	002851	麦格米特	49,788,968.40	4.11
56	300726	宏达电子	49,521,449.73	4.09
57	601702	华峰铝业	47,004,301.96	3.88
58	603005	晶方科技	46,547,966.34	3.84
59	688080	映翰通	46,161,427.97	3.81
60	603995	甬金股份	44,884,487.22	3.71
61	601899	紫金矿业	44,866,902.84	3.70
62	300729	乐歌股份	44,501,299.70	3.67
63	002463	沪电股份	41,427,124.24	3.42
64	603876	鼎胜新材	40,120,542.00	3.31
65	600352	浙江龙盛	40,042,592.25	3.31
66	600817	宇通重工	38,420,611.38	3.17
67	002081	金螳螂	38,357,639.25	3.17
68	600507	方大特钢	36,822,411.48	3.04
69	603416	信捷电气	36,440,572.15	3.01
70	688408	中信博	36,414,360.99	3.01
71	605288	凯迪股份	35,296,392.40	2.91
72	300566	激智科技	35,252,031.35	2.91

73	688128	中国电研	33,028,951.59	2.73
74	600183	生益科技	31,924,823.00	2.64
75	002110	三钢闽光	31,335,328.70	2.59
76	688390	固德威	28,256,627.25	2.33

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

8.4.2 累计卖出金额超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	300274	阳光电源	184,161,780.65	15.21
2	601012	隆基股份	144,703,247.97	11.95
3	601877	正泰电器	97,018,008.87	8.01
4	601636	旗滨集团	88,640,780.23	7.32
5	300014	亿纬锂能	87,169,117.58	7.20
6	000002	万科 A	84,964,275.00	7.02
7	603416	信捷电气	72,548,033.60	5.99
8	601600	中国铝业	67,108,573.48	5.54
9	688390	固德威	65,400,020.61	5.40
10	601117	中国化学	64,160,593.81	5.30
11	300433	蓝思科技	63,200,028.83	5.22
12	002375	亚厦股份	63,067,828.64	5.21
13	000961	中南建设	61,537,747.52	5.08
14	000656	金科股份	60,918,310.16	5.03
15	603444	吉比特	60,173,568.56	4.97
16	600183	生益科技	58,191,672.00	4.80
17	603063	禾望电气	57,174,956.20	4.72
18	688408	中信博	53,027,405.95	4.38
19	600031	三一重工	49,702,426.74	4.10
20	002241	歌尔股份	49,164,404.61	4.06
21	002318	久立特材	48,362,570.77	3.99
22	002463	沪电股份	48,069,998.89	3.97
23	601717	郑煤机	45,412,772.10	3.75
24	601899	紫金矿业	45,086,969.46	3.72
25	688516	奥特维	42,237,897.77	3.49
26	601799	星宇股份	41,891,194.90	3.46
27	601966	玲珑轮胎	41,723,346.67	3.45
28	300726	宏达电子	41,586,292.58	3.43
29	603876	鼎胜新材	41,471,641.24	3.42
30	600933	爱柯迪	40,579,145.05	3.35
31	603005	晶方科技	40,326,352.81	3.33

32	600660	福耀玻璃	38,676,655.46	3.19
33	002078	太阳纸业	38,494,743.90	3.18
34	603313	梦百合	34,220,717.64	2.83
35	605288	凯迪股份	33,978,971.20	2.81
36	600352	浙江龙盛	33,602,435.30	2.77
37	601689	拓普集团	32,727,291.00	2.70
38	002081	金螳螂	32,194,178.14	2.66
39	000651	格力电器	32,174,095.64	2.66
40	002444	巨星科技	29,979,187.98	2.48
41	300737	科顺股份	28,824,828.23	2.38
42	603018	华设集团	28,188,998.32	2.33
43	000333	美的集团	27,125,433.00	2.24
44	600219	南山铝业	25,349,951.00	2.09

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,423,864,847.95
卖出股票收入（成交）总额	3,144,934,344.55

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	250,963,928.80	3.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	137,085,498.50	1.78
	其中：政策性金融债	137,085,498.50	1.78
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）	153,393,204.76	1.99
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	541,442,632.06	7.04

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019658	21 国债 10	1,060,000	105,841,000.00	1.38
2	019664	21 国债 16	960,720	96,110,428.80	1.25
3	190214	19 国开 14	800,000	80,448,000.00	1.05
4	018006	国开 1702	563,950	56,637,498.50	0.74
5	123083	朗新转债	149,337	38,524,465.89	0.50

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,016,103.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	4,518,758.15
5	应收申购款	22,650,261.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,185,123.48

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123083	朗新转债	38,524,465.89	0.50
2	113549	白电转债	22,843,248.00	0.30
3	113044	大秦转债	14,802,854.40	0.19
4	123107	温氏转债	10,915,292.68	0.14
5	127018	本钢转债	10,190,980.80	0.13
6	110072	广汇转债	8,654,646.00	0.11
7	113542	好客转债	7,297,527.60	0.09
8	127019	国城转债	6,506,505.20	0.08
9	113624	正川转债	5,790,753.50	0.08
10	132014	18 中化 EB	3,428,698.30	0.04
11	128127	文科转债	2,571,996.00	0.03
12	132018	G 三峡 EB1	2,143,268.00	0.03
13	113519	长久转债	1,939,578.00	0.03
14	123076	强力转债	1,896,128.00	0.02
15	128108	蓝帆转债	1,763,903.70	0.02
16	113620	傲农转债	1,737,042.80	0.02
17	110076	华海转债	1,211,956.20	0.02
18	113597	佳力转债	644,806.50	0.01

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603179	新泉股份	18,472,500.00	0.24	大宗交易流通受限
2	603666	亿嘉和	17,910,000.00	0.23	大宗交易流通受限

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东减持或者特定股东减持，采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%；前款交易的受让方在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达瑞程混合 A	32,156	39,114.92	984,964,432.35	78.31%	272,814,930.64	21.69%
易方达瑞程混合 C	18,692	34,588.19	528,693,895.89	81.78%	117,828,504.99	18.22%
合计	50,848	37,450.87	1,513,658,328.24	79.49%	390,643,435.63	20.51%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达瑞程混合 A	3,453,049.07	0.2745%
	易方达瑞程混合 C	462,112.53	0.0715%
	合计	3,915,161.60	0.2056%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达瑞程混合 A	10~50
	易方达瑞程混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达瑞程混合 A	>100
	易方达瑞程混合 C	0

	合计	>100

§10开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达瑞程混合 A	易方达瑞程混合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 15 日）基金份额总额	700,022,049.85	34,320.10
本报告期期初基金份额总额	303,996,183.83	79,200,337.52
本报告期基金总申购份额	1,404,248,763.20	762,118,069.97
减：本报告期基金总赎回份额	450,465,584.04	194,796,006.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,257,779,362.99	646,522,400.88

§11重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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；2021 年 7 月 17 日发布公告，自 2021 年 7 月 15 日起陈丽园女士不再担任公司副总经理级高级管理人员；2021 年 7 月 24 日发布公告，自 2021 年 7 月 24 日起聘任萧楠先生担任公司副总经理级高级管理人员，聘任管勇先生担任公司首席信息官；2021 年 7 月 30 日发布公告，自 2021 年 7 月 30 日起聘任杨冬梅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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 5 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 95,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	1,380,090,005.92	12.27%	1,104,070.59	13.22%	-
开源证券	1	221,554,477.59	1.97%	177,243.75	2.12%	-
平安证券	1	720,701,350.39	6.41%	432,428.76	5.18%	-
申万宏源	3	1,905,507,830.94	16.94%	1,524,407.66	18.25%	-
天风证券	1	1,516,124,570.44	13.48%	1,212,896.37	14.52%	-
信达证券	1	907,086,596.22	8.06%	544,251.93	6.52%	-
招商证券	1	2,098,824,058.93	18.66%	1,679,059.27	20.10%	-
中金公司	1	360,048,324.58	3.20%	216,029.00	2.59%	-
中泰证券	1	1,242,630,732.97	11.05%	745,578.52	8.93%	-
中信建投	1	894,859,927.33	7.96%	715,891.35	8.57%	-
中信证券	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华泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、信达证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

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服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

1） 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2） 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	132,809,141.60	10.58%	2,717,300,000.00	9.88%	-	-
开源证券	19,757,802.30	1.57%	69,000,000.00	0.25%	-	-
平安证券	16,999,950.53	1.35%	-	-	-	-
申万宏源	247,085,201.18	19.68%	6,670,158,000.00	24.26%	-	-
天风证券	294,426,722.82	23.45%	2,134,704,000.00	7.76%	-	-
信达证券	40,197,785.90	3.20%	2,391,000,000.00	8.70%	-	-
招商证券	244,420,655.30	19.46%	6,400,500,000.00	23.28%	-	-
中金公司	61,672,126.30	4.91%	1,171,000,000.00	4.26%	-	-
中泰证券	114,268,103.10	9.10%	5,223,000,000.00	19.00%	-	-
中信建投	84,102,138.90	6.70%	716,320,000.00	2.61%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配新泉股份（603179）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配蓝思科技（300433）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-09
3	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	证券时报	2021-01-21
4	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
5	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-10
6	易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金在网上直销系统恢复个人客户的申购、转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-09
7	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	证券时报	2021-03-30
8	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
9	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	证券时报	2021-04-19
10	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-17
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	证券时报	2021-07-20
12	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
13	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
14	易方达基金管理有限公司关于南京分公司营业场所变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-28
15	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-30

16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	证券时报	2021-08-28
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配中国化学（601117）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-10
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配乐歌股份（300729）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-10-14
19	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	证券时报	2021-10-27
20	易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金开放日常定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-04
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-15
22	易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-17
23	易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购及大额转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-22
24	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金单笔赎回最低份额及最低持有份额限制的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-29

§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瑞程灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；

2.《易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3.《易方达瑞程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

二〇二二年三月三十日