

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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 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合规守信情况的说明.....	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
§ 5	托管人报告.....	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§ 6	审计报告.....	17
6.1	审计意见.....	17
6.2	形成审计意见的基础.....	18
6.3	管理层和治理层对财务报表的责任.....	18
6.4	注册会计师对财务报表审计的责任.....	18
§ 7	年度财务报表.....	19
7.1	资产负债表.....	19
7.2	利润表.....	21
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4	报表附注.....	24
§ 8	投资组合报告.....	55
8.1	期末基金资产组合情况.....	55
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	56
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.....	57
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.....	78

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	79
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	79
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	79
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	79
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	79
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12	投资组合报告附注	79
§ 9	基金份额持有人信息	80
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
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	80
§ 10	开放式基金份额变动	81
§ 11	重大事件揭示	81
11.1	基金份额持有人大会决议	81
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	81
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4	基金投资策略的改变	82
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	82
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	82
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8	其他重大事件	85
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	86
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	86
§ 13	备查文件目录	86
13.1	备查文件目录	86
13.2	存放地点	87
13.3	查阅方式	87

§ 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	117,216,933.33 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	67,738,996.30 份	49,477,937.03 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	010-66596688
	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荣粤道 188号6层	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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	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	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	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	10,021,324.37	3,225,130.70	59,453,678.23	2,301,740.36	54,097,457.27	766,217.51
本期利润	11,095,523.39	1,685,883.26	46,535,400.64	1,630,485.68	105,570,536.85	1,499,437.89
加权平均基金份额本期利润	0.1805	0.0544	0.3250	0.3515	0.2431	0.2425
本期加权平均净值利润率	12.65%	3.72%	30.89%	31.29%	27.57%	27.58%
本期基金份额净值增长率	9.41%	9.09%	37.88%	37.47%	30.23%	29.86%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	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	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	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	31,922,279.20	22,462,478.91	17,516,146.83	1,484,230.93	-18,916,871.15	-346,030.70
期末可供分配基金份额利润	0.4713	0.4540	0.3447	0.3328	-0.0579	-0.0634
期末基金资产净值	99,661,275.50	71,940,415.94	68,330,373.28	5,944,641.09	318,553,169.50	5,288,834.23
期末基金份额净值	1.4713	1.4540	1.3447	1.3328	0.9753	0.9695

3.1.3 累计 期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	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	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	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	47.13%	45.40%	34.47%	33.28%	-2.47%	-3.05%

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
过去三个月	-3.22%	1.56%	1.42%	0.51%	-4.64%	1.05%
过去六个月	4.91%	1.80%	-2.52%	0.66%	7.43%	1.14%
过去一年	9.41%	1.55%	-1.60%	0.76%	11.01%	0.79%
过去三年	96.46%	1.38%	46.27%	0.83%	50.19%	0.55%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	47.13%	1.33%	16.06%	0.85%	31.07%	0.48%

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
过去三个月	-3.29%	1.56%	1.42%	0.51%	-4.71%	1.05%
过去六个月	4.74%	1.80%	-2.52%	0.66%	7.26%	1.14%
过去一年	9.09%	1.55%	-1.60%	0.76%	10.69%	0.79%
过去三年	94.75%	1.38%	46.27%	0.83%	48.48%	0.55%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	45.40%	1.33%	16.06%	0.85%	29.34%	0.48%

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 12 月 31 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



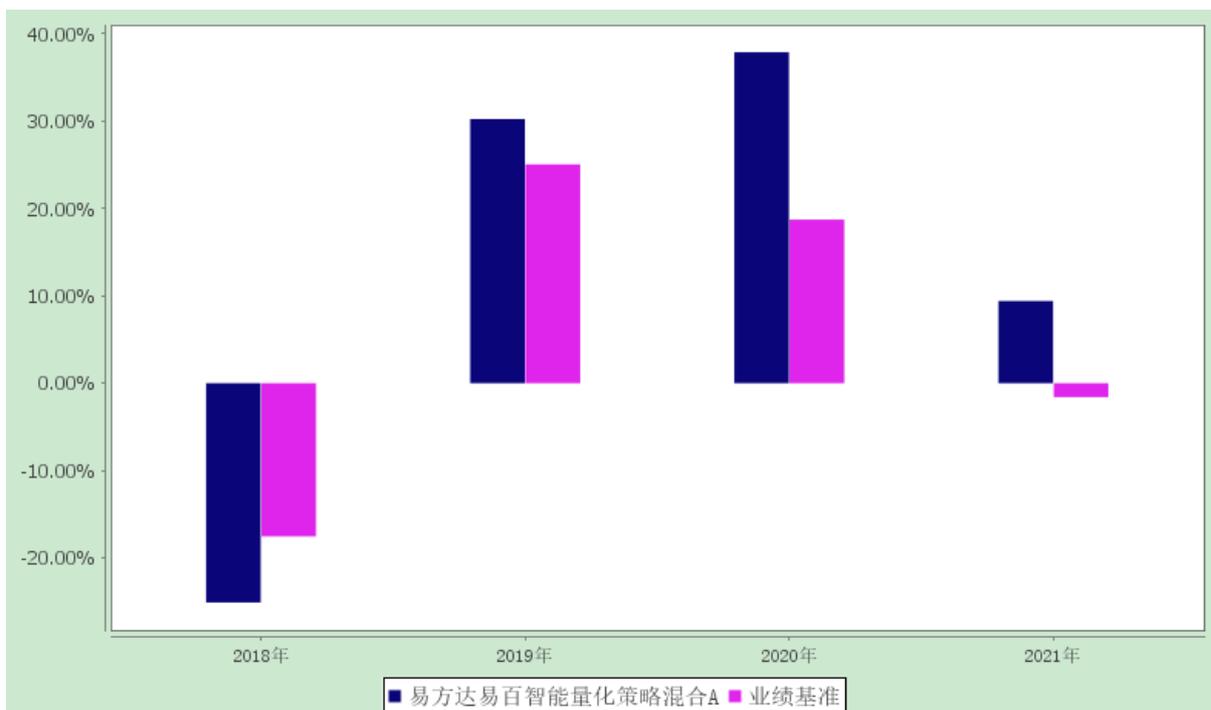
注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 47.13%，C 类基金份额净值增长率为 45.40%，同期业绩比较基准收益率为 16.06%。

3.2.3 自基金合同生效以来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

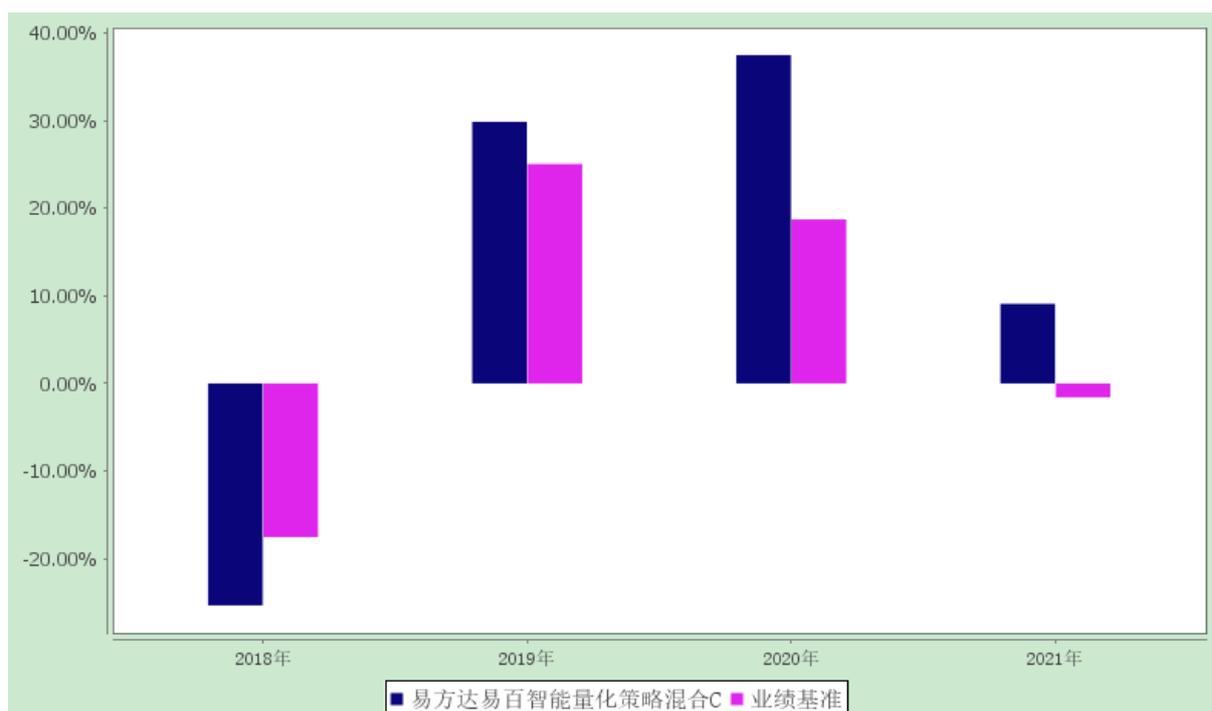
易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来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：本基金合同生效日为 2018 年 1 月 24 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

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		
官泽帆	本基金的基金经理、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金的基金经理（自 2016 年 09 月 24 日至 2021 年 09 月 03 日）、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（自 2017 年 12 月 19 日至 2021 年 09 月 03 日）、易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金的基金经理	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（自 2020 年 04 月 30 日至 2021 年 09 月 06 日）、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金的基金经理助理（自 2020 年 04 月 30 日至 2021 年 09 月 06 日）、量化研究员	2020-04-30	2021-09-07	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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 and 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。

4.3.3 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

本报告期内，经济基本面的核心矛盾是在全球疫情继续蔓延的背景下，以及各国不同的防疫政策下，经济各部门如何展现出持续发展的韧性。在此背景下，各国纷纷通过更为宽松的货币政策保障企业的生产和居民的生活。受此影响，PPI 长期高位运行，煤炭、钢铁、化工等大宗商品价格大幅波动，同时我们还面临“碳中和”的目标，在“双控”、“限电”背景下，这一矛盾更加激化。然而，中央经济会议及时明确了纠偏的方向，强调了传统能源和可再生能源协调发展的必要性，明确了“稳增长”的目标，为市场注入了强心剂。

全年权益市场表现可以以春节前后、三月底和九月中旬三个时间点切分为四部分：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，并在春节前达到高峰；春节后，随着美债收益率大幅攀升，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；三月底到九月中旬，随着国内财政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；九月中旬后，随着“能耗双控”和“限电”政策的纠偏，市场重新回到低估值风格。总体来看，全年市场风格多变，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，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、兼具一定成长性标的。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，保持风格的平衡，在控制好回撤的前提下，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 1.4713 元，本报告期份额净值增长率为 9.41%，同期业绩比较基准收益率为-1.60%；C 类基金份额净值为 1.4540 元，本报告期份额净值增长率为 9.09%，同期业绩比较基准收益率为-1.60%。

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 2022 年，我们会继续对资产定价的分子和分母端保持紧密关注。在分子端，我们重点关注去年高增长的景气行业能否延续高增长，去年因疫情和原材料价格上涨的受损行业能否迎来盈利的修复；在分母端，我们重点关注“稳增长”预期下，信贷数据能否逐步落地，在美国加息缩表预期的

环境下流动性是否会发生变化等。我们相信 2022 年市场依然会存在结构性投资机会，需要基金管理人做好紧密跟踪，持续发掘这些机会。我们将继续从自上而下以及自下而上两个角度进行深入研究，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，为投资者创造持续稳定的超额收益。

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（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 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 25225 号

易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了易方达易百智能量化策略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)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达易百智能量化策略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 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

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

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达易百智能量化策略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易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

陈熹 陈轶杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

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 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	10,355,574.76	4,515,068.93

结算备付金		1,173,843.02	100,860.40
存出保证金		58,175.06	60,126.91
交易性金融资产	7.4.7.2	160,340,859.03	70,311,155.33
其中：股票投资		160,340,859.03	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		535,088.78	10,027.07
应收利息	7.4.7.5	1,483.20	539.68
应收股利		-	-
应收申购款		50,124.39	17,045.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		172,515,148.24	75,014,823.32
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		-	-
应付证券清算款		369,590.42	-
应付赎回款		100,929.01	487,934.52
应付管理人报酬		226,100.96	94,238.47
应付托管费		37,683.50	15,706.42
应付销售服务费		19,147.03	1,553.56

应付交易费用	7.4.7.7	-	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	7.4.7.8	160,005.88	120,116.79
负债合计		913,456.80	739,808.95
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	117,216,933.33	55,274,636.61
未分配利润	7.4.7.10	54,384,758.11	19,000,377.76
所有者权益合计		171,601,691.44	74,275,014.37
负债和所有者权益总计		172,515,148.24	75,014,823.32

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.4713 元，C 类基金份额净值 1.4540 元；基金份额总额 117,216,933.33 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 67,738,996.30 份，C 类基金份额总额 49,477,937.03 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	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
一、收入		17,008,260.92	53,198,797.20
1.利息收入		50,674.79	76,990.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	50,674.79	76,949.31
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）		17,306,313.80	66,639,770.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	16,304,309.20	64,749,105.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	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	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,002,004.60	1,874,525.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-465,048.42	-13,589,532.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	116,320.75	71,568.26
减：二、费用		4,226,854.27	5,032,910.88
1. 管理人报酬		1,989,155.30	2,378,317.48
2. 托管费		331,525.84	396,386.24
3. 销售服务费		135,360.62	15,596.35
4. 交易费用	7.4.7.18	1,562,511.62	2,073,772.38
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	7.4.7.19	208,300.89	168,838.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,781,406.65	48,165,886.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,781,406.65	48,165,886.32

7.3 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 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）	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）	-	12,781,406.65	12,781,406.65
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）	61,942,296.72	22,602,973.70	84,545,270.42
其中：1.基金申购款	120,110,213.48	48,260,358.49	168,370,571.97
2.基金赎回款	-58,167,916.76	-25,657,384.79	-83,825,301.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	117,216,933.33	54,384,758.11	171,601,691.44
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）	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）	-	48,165,886.32	48,165,886.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-276,805,539.68	-20,927,336.00	-297,732,875.68

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	14,116,220.70	2,002,786.20	16,119,006.90
2.基金赎回款	-290,921,760.38	-22,930,122.20	-313,851,882.58
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）	55,274,636.61	19,000,377.76	74,275,014.37

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。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 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；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	10,355,574.76	4,515,068.93
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	10,355,574.76	4,515,068.93

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	157,547,562.65	160,340,859.03	2,793,296.38
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		157,547,562.65	160,340,859.03	2,793,296.38
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		67,052,810.53	70,311,155.33	3,258,344.80
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		67,052,810.53	70,311,155.33	3,258,344.80

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	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日

应收活期存款利息	929.10	467.18
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	528.00	45.40
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	26.10	27.10
合计	1,483.20	539.68

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	-	20,259.19
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	-	20,259.19

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	5.88	116.79
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	160,000.00	120,000.00
合计	160,005.88	120,116.79

7.4.7.9 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12月31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	54,701,431.67	54,701,431.67
本期赎回（以“-”号填列）	-37,776,661.82	-37,776,661.82
本期末	67,738,996.30	67,738,996.30

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12月31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	65,408,781.81	65,408,781.81
本期赎回（以“-”号填列）	-20,391,254.94	-20,391,254.94
本期末	49,477,937.03	49,477,937.03

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	10,021,324.37	1,074,199.02	11,095,523.39
本期基金份额交易产生的变动数	8,041,246.16	-4,730,637.18	3,310,608.98
其中：基金申购款	26,500,717.75	-6,958,236.25	19,542,481.50
基金赎回款	-18,459,471.59	2,227,599.07	-16,231,872.52

本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,118,295.63	-8,196,016.43	31,922,279.20

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	3,225,130.70	-1,539,247.44	1,685,883.26
本期基金份额交易产生的变动数	23,296,215.45	-4,003,850.73	19,292,364.72
其中：基金申购款	33,872,705.52	-5,154,828.53	28,717,876.99
基金赎回款	-10,576,490.07	1,150,977.80	-9,425,512.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,401,547.35	-5,939,068.44	22,462,478.91

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	35,132.69	67,504.96
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	14,555.47	8,017.94
其他	986.63	1,426.41
合计	50,674.79	76,949.31

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
卖出股票成交总额	1,297,946,125.95	898,339,796.49
减：卖出股票成本总额	1,281,641,816.75	833,590,690.63

买卖股票差价收入	16,304,309.20	64,749,105.86
----------	---------------	---------------

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	177,981.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	161,800.00
减：应收利息总额	-	42.56
买卖债券差价收入	-	16,139.06

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
股票投资产生的股利收益	1,002,004.60	1,874,525.62
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	1,002,004.60	1,874,525.62

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	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
1.交易性金融资产	-465,048.42	-13,589,532.27
——股票投资	-465,048.42	-13,589,532.27
——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	-465,048.42	-13,589,532.27

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
基金赎回费收入	116,320.75	71,568.26
其他	-	-
合计	116,320.75	71,568.26

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
交易所市场交易费用	1,562,511.62	2,073,772.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,562,511.62	2,073,772.38

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	11,100.89	11,638.29
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00

其他	1,200.00	1,200.00
合计	208,300.89	168,838.29

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	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
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	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
当期发生的基金应支付的管理费	1,989,155.30	2,378,317.48
其中：支付销售机构的客户维护费	489,738.62	1,147,438.41

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	331,525.84	396,386.24

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。

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	-	76,136.59	76,136.59
中国银行	-	2,331.41	2,331.41
广发证券	-	34.38	34.38
合计	-	78,502.38	78,502.38
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	-	4,526.70	4,526.70
中国银行	-	3,472.79	3,472.79
广发证券	-	26.64	26.64
合计	-	8,026.13	8,026.13

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。

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

份额单位：份

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	
	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	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
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	35.1087%	-	-	-

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。

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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	
	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	10,355,574.76	35,132.69	4,515,068.93	67,504.96
-----------	---------------	-----------	--------------	-----------

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。

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
中银国际	600941	中国移动	新股网上 发行	1,000	57,580.00
中银国际	601728	中国电信	新股网上 发行	30,000	135,900.00
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
中银国际证 券股份有限 公司	600919	江苏银行	配股	40,950	187,960.50

注：中银国际证券股份有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方。

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。

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	305	3,629.50	13,862.25	-
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	198	3,569.94	12,420.54	-
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	562	2,984.22	7,587.00	-

301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股 流通 受限	14.14	89.87	331	4,680.34	29,746.97	-
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	182	4,011.28	10,242.96	-
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	623	4,336.08	7,793.73	-
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	742	3,064.46	9,616.32	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股 流通 受限	19.34	32.92	164	3,171.76	5,398.88	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股 流通 受限	60.64	234.74	70	4,244.80	16,431.80	-
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	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-

				受限						
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 受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
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	2021-10-19	2022-04-28	新股	33.16	24.67	212	7,029.92	5,230.04	-

	股份			流通受限						
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	201	3,841.11	13,653.93	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股流通受限	10.45	11.22	727	7,597.15	8,156.94	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	新股流通受限	36.50	31.31	232	8,468.00	7,263.92	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	58.08	49.85	127	7,376.16	6,330.95	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	新股流通受限	79.60	78.53	65	5,174.00	5,104.45	-
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	225	6,257.25	7,006.50	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	新股流通受限	26.91	43.36	230	6,189.30	9,972.80	-
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	248	5,629.60	12,156.96	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	12.37	19.23	580	7,174.60	11,153.40	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	新股流通受限	12.03	17.12	679	8,168.37	11,624.48	-
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	228	5,966.76	10,228.08	-

301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股 流通 受限	60.66	96.75	153	9,280.98	14,802.75	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新股 流通 受限	39.08	52.13	138	5,393.04	7,193.94	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	新股 流通 受限	116.88	116.08	93	10,869.84	10,795.44	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股 流通 受限	43.99	50.77	98	4,311.02	4,975.46	-
301180	万祥科技	2021-11-09	2022-05-16	新股 流通 受限	12.20	22.72	572	6,978.40	12,995.84	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	新股 流通 受限	27.12	30.58	234	6,346.08	7,155.72	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	新股 流通 受限	66.18	56.62	121	8,007.78	6,851.02	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股 流通 受限	27.85	27.46	210	5,848.50	5,766.60	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股 流通 受限	30.73	29.14	175	5,377.75	5,099.50	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股 流通 受限	21.76	29.20	255	5,548.80	7,446.00	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股 流通 受限	29.28	32.00	216	6,324.48	6,912.00	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股 流通 受限	25.80	33.65	348	8,978.40	11,710.20	-
600941	中国移动	2021-12-27	2022-01-05	新股 流通 受限	57.58	57.58	1,000	57,580.00	57,580.00	-
688187	时代电气	2021-08-30	2022-03-07	新股 流通 受限	31.38	76.65	3,047	95,614.86	233,552.55	-
688206	概伦电子	2021-12-20	2022-06-28	新股 流通	28.28	33.01	2,560	72,396.80	84,505.60	-

				受限						
688212	澳华 内镜	2021-11-08	2022-05-16	新股 流通 受限	22.50	32.82	2,238	50,355.00	73,451.16	-
688262	国芯 科技	2021-12-28	2022-01-06	新股 流通 受限	41.98	41.98	1,682	70,610.36	70,610.36	-

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为 0，无抵押债券。

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 0.00%(2020 年 12 月 31 日：0.00%)。

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	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。

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	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。

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同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险管理，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	10,355,574.76	-	-	-	10,355,574.76
结算备付金	1,173,843.02	-	-	-	1,173,843.02
存出保证金	58,175.06	-	-	-	58,175.06
交易性金融资产	-	-	-	160,340,859.03	160,340,859.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	535,088.78	535,088.78
应收利息	-	-	-	1,483.20	1,483.20
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	50,124.39	50,124.39
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,587,592.84	-	-	160,927,555.40	172,515,148.24
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	-	-	-	369,590.42	369,590.42

应付赎回款	-	-	-	100,929.01	100,929.01
应付管理人报酬	-	-	-	226,100.96	226,100.96
应付托管费	-	-	-	37,683.50	37,683.50
应付销售服务费	-	-	-	19,147.03	19,147.03
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	-	-	-	160,005.88	160,005.88
负债总计	-	-	-	913,456.80	913,456.80
利率敏感度缺口	11,587,592.84	-	-	160,014,098.60	171,601,691.44
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。

7.4.13.4.1.2 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。

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	160,340,859.03	93.44	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	160,340,859.03	93.44	70,311,155.33	94.66

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%	8,889,637.92	5,284,250.39
	2.业绩比较基准下降 5%	-8,889,637.92	-5,284,250.39

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 159,193,593.04 元，属于第二层次的余额为 1,147,265.99 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 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	160,340,859.03	92.94
	其中：股票	160,340,859.03	92.94
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	11,529,417.78	6.68
8	其他各项资产	644,871.43	0.37
9	合计	172,515,148.24	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	2,902,862.00	1.69
C	制造业	126,272,825.02	73.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,852,053.13	5.74
E	建筑业	9,412,778.99	5.49
F	批发和零售业	793,731.72	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	476,718.00	0.28
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	2,993,722.42	1.74
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,241,977.00	1.89
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,457,520.45	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	1,408,317.88	0.82
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	0.01
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	1,497,168.00	0.87
	合计	160,340,859.03	93.44

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	605117	德业股份	7,427	2,033,438.33	1.18
2	601800	中国交建	230,800	1,980,264.00	1.15
3	600801	华新水泥	94,600	1,825,780.00	1.06
4	002108	沧州明珠	204,700	1,600,754.00	0.93
5	300082	奥克股份	99,300	1,534,185.00	0.89
6	600673	东阳光	168,600	1,497,168.00	0.87
7	601669	中国电建	180,300	1,456,824.00	0.85
8	600905	三峡能源	193,863	1,455,911.13	0.85
9	603801	志邦家居	47,700	1,451,034.00	0.85
10	002594	比亚迪	5,400	1,447,848.00	0.84
11	002918	蒙娜丽莎	49,200	1,408,596.00	0.82
12	600483	福能股份	85,300	1,388,684.00	0.81
13	601636	旗滨集团	80,400	1,374,840.00	0.80
14	688200	华峰测控	2,593	1,327,356.70	0.77
15	603667	五洲新春	74,871	1,303,504.11	0.76
16	601012	隆基股份	14,900	1,284,380.00	0.75
17	002407	多氟多	28,400	1,277,716.00	0.74
18	002056	横店东磁	67,600	1,275,612.00	0.74
19	002756	永兴材料	8,600	1,272,972.00	0.74
20	603456	九洲药业	22,500	1,265,850.00	0.74
21	688536	思瑞浦	1,645	1,263,360.00	0.74
22	688518	联赢激光	25,549	1,258,799.23	0.73
23	300982	苏文电能	16,200	1,192,158.00	0.69
24	605305	中际联合	12,200	1,174,738.00	0.68
25	002897	意华股份	20,700	1,171,827.00	0.68
26	688600	皖仪科技	54,725	1,171,115.00	0.68
27	000928	中钢国际	124,400	1,156,920.00	0.67
28	002459	晶澳科技	12,400	1,149,480.00	0.67
29	600111	北方稀土	25,000	1,145,000.00	0.67
30	600348	华阳股份	96,400	1,142,340.00	0.67
31	688390	固德威	2,465	1,132,864.70	0.66
32	688559	海目星	18,634	1,112,636.14	0.65
33	600499	科达制造	44,000	1,092,080.00	0.64
34	002326	永太科技	21,300	1,090,773.00	0.64
35	300661	圣邦股份	3,500	1,081,500.00	0.63
36	600585	海螺水泥	26,800	1,080,040.00	0.63
37	688017	绿的谐波	6,158	1,074,940.48	0.63
38	300699	光威复材	12,500	1,056,000.00	0.62

39	002572	索菲亚	47,300	1,050,060.00	0.61
40	002534	杭锅股份	32,900	1,042,601.00	0.61
41	300487	蓝晓科技	10,500	1,032,675.00	0.60
42	601677	明泰铝业	23,000	1,014,070.00	0.59
43	002371	北方华创	2,900	1,006,358.00	0.59
44	002837	英维克	24,600	1,005,894.00	0.59
45	600460	士兰微	18,500	1,002,700.00	0.58
46	688378	奥来德	12,511	1,002,131.10	0.58
47	688300	联瑞新材	9,035	1,001,710.45	0.58
48	603906	龙蟠科技	26,996	999,931.84	0.58
49	000671	阳光城	326,800	986,936.00	0.58
50	601868	中国能建	358,700	979,251.00	0.57
51	688063	派能科技	4,933	971,801.00	0.57
52	300355	蒙草生态	178,400	963,360.00	0.56
53	002850	科达利	6,000	962,040.00	0.56
54	002026	山东威达	52,000	957,320.00	0.56
55	603290	斯达半导	2,510	956,310.00	0.56
56	601633	长城汽车	19,700	956,238.00	0.56
57	603078	江化微	35,900	954,222.00	0.56
58	603688	石英股份	15,100	952,961.00	0.56
59	300390	天华超净	11,760	952,560.00	0.56
60	300763	锦浪科技	4,100	949,355.00	0.55
61	300682	朗新科技	25,500	944,265.00	0.55
62	300207	欣旺达	22,200	935,952.00	0.55
63	600011	华能国际	95,400	924,426.00	0.54
64	688598	金博股份	2,599	922,748.96	0.54
65	600188	兖矿能源	39,200	922,376.00	0.54
66	300432	富临精工	31,300	920,220.00	0.54
67	688772	珠海冠宇	18,816	915,398.40	0.53
68	300041	回天新材	48,500	899,190.00	0.52
69	002541	鸿路钢构	16,600	888,764.00	0.52
70	002518	科士达	35,300	886,030.00	0.52
71	603379	三美股份	38,800	883,864.00	0.52
72	600110	诺德股份	55,000	877,250.00	0.51
73	300363	博腾股份	9,700	867,665.00	0.51
74	002941	新疆交建	71,600	865,644.00	0.50
75	003038	鑫铂股份	11,600	858,052.00	0.50
76	603198	迎驾贡酒	12,200	847,290.00	0.49
77	002335	科华数据	23,300	847,188.00	0.49
78	300438	鹏辉能源	17,900	845,596.00	0.49
79	002135	东南网架	73,100	845,036.00	0.49
80	688116	天奈科技	5,632	840,801.28	0.49
81	002245	蔚蓝锂芯	30,100	828,051.00	0.48
82	300831	派瑞股份	41,900	827,525.00	0.48

83	688006	杭可科技	7,687	826,967.46	0.48
84	600027	华电国际	154,300	825,505.00	0.48
85	603008	喜临门	21,000	819,630.00	0.48
86	002233	塔牌集团	77,400	818,892.00	0.48
87	688345	博力威	13,662	814,255.20	0.47
88	600338	西藏珠峰	21,500	809,690.00	0.47
89	300014	亿纬锂能	6,800	803,624.00	0.47
90	603063	禾望电气	19,800	798,138.00	0.47
91	300953	震裕科技	6,100	796,477.00	0.46
92	601179	中国西电	143,300	795,315.00	0.46
93	000799	酒鬼酒	3,700	786,250.00	0.46
94	603105	芯能科技	47,300	786,126.00	0.46
95	688202	美迪西	1,614	783,742.26	0.46
96	002539	云图控股	57,400	761,698.00	0.44
97	300327	中颖电子	11,120	755,048.00	0.44
98	300737	科顺股份	46,400	754,000.00	0.44
99	002497	雅化集团	26,300	753,758.00	0.44
100	688516	奥特维	3,056	750,920.32	0.44
101	688233	神工股份	8,470	747,054.00	0.44
102	002091	江苏国泰	54,200	744,166.00	0.43
103	002139	拓邦股份	39,700	741,993.00	0.43
104	688599	天合光能	9,370	739,293.00	0.43
105	000656	金科股份	163,200	731,136.00	0.43
106	605111	新洁能	4,100	730,210.00	0.43
107	002060	粤水电	129,800	720,390.00	0.42
108	301071	力量钻石	2,500	716,750.00	0.42
109	300725	药石科技	5,000	710,850.00	0.41
110	300751	迈为股份	1,100	706,530.00	0.41
111	000400	许继电气	26,400	689,040.00	0.40
112	002466	天齐锂业	6,300	674,100.00	0.39
113	600320	振华重工	177,600	669,552.00	0.39
114	601778	晶科科技	78,100	666,193.00	0.39
115	301018	申菱环境	25,100	664,648.00	0.39
116	002821	凯莱英	1,500	652,500.00	0.38
117	688388	嘉元科技	5,102	640,556.10	0.37
118	603396	金辰股份	5,200	639,600.00	0.37
119	002372	伟星新材	26,200	637,184.00	0.37
120	603520	司太立	9,700	630,500.00	0.37
121	000811	冰轮环境	40,900	629,451.00	0.37
122	600995	文山电力	31,300	621,931.00	0.36
123	001979	招商蛇口	46,500	620,310.00	0.36
124	300776	帝尔激光	2,400	614,160.00	0.36
125	300286	安科瑞	18,500	613,830.00	0.36
126	603127	昭衍新药	5,300	611,779.00	0.36

127	601222	林洋能源	50,300	610,139.00	0.36
128	688097	博众精工	12,948	604,153.68	0.35
129	300655	晶瑞电材	14,400	601,632.00	0.35
130	600170	上海建工	166,700	600,120.00	0.35
131	600487	亨通光电	39,600	598,752.00	0.35
132	600132	重庆啤酒	3,900	590,148.00	0.34
133	300850	新强联	3,300	589,083.00	0.34
134	002053	云南能投	62,200	589,034.00	0.34
135	002126	银轮股份	46,500	584,040.00	0.34
136	600496	精工钢构	135,100	575,526.00	0.34
137	300118	东方日升	17,700	574,719.00	0.33
138	300316	晶盛机电	8,200	569,900.00	0.33
139	600406	国电南瑞	14,200	568,426.00	0.33
140	002032	苏泊尔	9,100	566,384.00	0.33
141	600732	爱旭股份	24,200	565,312.00	0.33
142	000762	西藏矿业	10,600	563,178.00	0.33
143	603693	江苏新能	19,500	554,970.00	0.32
144	002483	润邦股份	68,599	554,279.92	0.32
145	600779	水井坊	4,600	551,954.00	0.32
146	002438	江苏神通	26,500	543,515.00	0.32
147	300593	新雷能	9,958	541,516.04	0.32
148	000591	太阳能	47,800	535,360.00	0.31
149	000875	吉电股份	57,600	523,584.00	0.31
150	002028	思源电气	10,600	521,626.00	0.30
151	601016	节能风电	79,000	514,290.00	0.30
152	600021	上海电力	40,100	514,082.00	0.30
153	600163	中闽能源	57,500	504,275.00	0.29
154	688499	利元亨	1,636	479,348.00	0.28
155	002120	韵达股份	23,300	476,718.00	0.28
156	603020	爱普股份	33,500	476,370.00	0.28
157	603799	华友钴业	4,300	474,333.00	0.28
158	603369	今世缘	8,700	473,280.00	0.28
159	300274	阳光电源	3,200	466,560.00	0.27
160	603596	伯特利	6,700	466,320.00	0.27
161	000301	东方盛虹	24,100	466,094.00	0.27
162	002988	豪美新材	22,600	465,786.00	0.27
163	688301	奕瑞科技	932	463,110.80	0.27
164	603179	新泉股份	10,600	458,768.00	0.27
165	605020	永和股份	14,900	457,430.00	0.27
166	603833	欧派家居	3,100	457,250.00	0.27
167	600048	保利发展	29,100	454,833.00	0.27
168	300394	天孚通信	12,300	450,180.00	0.26
169	300712	永福股份	8,200	449,688.00	0.26
170	002508	老板电器	12,470	449,169.40	0.26

171	600383	金地集团	34,600	448,762.00	0.26
172	603589	口子窖	6,300	446,481.00	0.26
173	688005	容百科技	3,787	437,701.46	0.26
174	002791	坚朗五金	2,400	435,816.00	0.25
175	600298	安琪酵母	7,000	422,520.00	0.25
176	600863	内蒙华电	106,800	420,792.00	0.25
177	002531	天顺风能	21,600	418,824.00	0.24
178	688100	威胜信息	12,157	418,565.51	0.24
179	601126	四方股份	19,900	415,910.00	0.24
180	688408	中信博	2,315	408,620.65	0.24
181	600882	妙可蓝多	7,100	397,600.00	0.23
182	300707	威唐工业	18,900	386,505.00	0.23
183	002266	浙富控股	54,100	385,192.00	0.22
184	600025	华能水电	56,200	370,358.00	0.22
185	300957	贝泰妮	1,900	365,332.00	0.21
186	600312	平高电气	39,500	359,055.00	0.21
187	002906	华阳集团	6,100	335,256.00	0.20
188	688128	中国电研	10,568	312,390.08	0.18
189	002191	劲嘉股份	20,500	310,165.00	0.18
190	603818	曲美家居	21,700	307,923.00	0.18
191	002472	双环传动	11,000	303,380.00	0.18
192	605005	合兴股份	12,700	302,133.00	0.18
193	300499	高澜股份	19,100	301,398.00	0.18
194	300586	美联新材	21,600	295,056.00	0.17
195	000887	中鼎股份	13,500	294,435.00	0.17
196	600010	包钢股份	101,600	283,464.00	0.17
197	000739	普洛药业	8,000	280,720.00	0.16
198	600884	杉杉股份	8,500	278,545.00	0.16
199	603727	博迈科	13,400	274,968.00	0.16
200	688356	键凯科技	807	272,063.91	0.16
201	603666	亿嘉和	3,600	270,432.00	0.16
202	300450	先导智能	3,620	269,219.40	0.16
203	002487	大金重工	6,700	259,625.00	0.15
204	688187	时代电气	3,047	233,552.55	0.14
205	300569	天能重工	13,400	200,196.00	0.12
206	603605	珀莱雅	900	187,479.00	0.11
207	002557	洽洽食品	2,600	159,536.00	0.09
208	002049	紫光国微	700	157,500.00	0.09
209	603659	璞泰来	940	150,973.40	0.09
210	600199	金种子酒	8,200	138,662.00	0.08
211	300035	中科电气	4,500	136,125.00	0.08
212	002202	金风科技	8,100	133,407.00	0.08
213	300443	金雷股份	2,200	127,072.00	0.07
214	605222	起帆电缆	4,100	106,559.00	0.06

215	688206	概伦电子	2,560	84,505.60	0.05
216	688212	澳华内镜	2,238	73,451.16	0.04
217	688262	国芯科技	1,682	70,610.36	0.04
218	600941	中国移动	1,000	57,580.00	0.03
219	688707	振华新材	960	48,364.80	0.03
220	603806	福斯特	300	39,165.00	0.02
221	603345	安井食品	200	34,156.00	0.02
222	603588	高能环境	1,900	33,383.00	0.02
223	000543	皖能电力	5,700	31,692.00	0.02
224	301029	怡合达	331	29,746.97	0.02
225	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
226	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
227	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.01
228	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
229	301050	雷电微力	70	16,431.80	0.01
230	301155	海力风电	153	14,802.75	0.01
231	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
232	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.01
233	300994	久祺股份	305	13,862.25	0.01
234	301089	拓新药业	201	13,653.93	0.01
235	002158	汉钟精机	500	13,315.00	0.01
236	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
237	301180	万祥科技	572	12,995.84	0.01
238	301026	浩通科技	198	12,420.54	0.01
239	301118	恒光股份	248	12,156.96	0.01
240	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
241	301211	亨迪药业	348	11,710.20	0.01
242	301127	天源环保	679	11,624.48	0.01
243	301126	达嘉维康	580	11,153.40	0.01
244	301177	迪阿股份	93	10,795.44	0.01
245	301035	润丰股份	182	10,242.96	0.01
246	301138	华研精机	228	10,228.08	0.01
247	301101	明月镜片	230	9,972.80	0.01
248	301048	金鹰重工	742	9,616.32	0.01
249	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.01
250	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.01
251	301078	孩子王	756	9,177.84	0.01
252	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.01
253	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
254	301090	华润材料	727	8,156.94	0.00
255	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
256	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
257	301039	中集车辆	623	7,793.73	0.00
258	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00

259	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
260	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
261	301028	东亚机械	562	7,587.00	0.00
262	301198	喜悦智行	255	7,446.00	0.00
263	301091	深城交	232	7,263.92	0.00
264	301168	通灵股份	138	7,193.94	0.00
265	301182	凯旺科技	234	7,155.72	0.00
266	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
267	301100	风光股份	225	7,006.50	0.00
268	301199	迈赫股份	216	6,912.00	0.00
269	301189	奥尼电子	121	6,851.02	0.00
270	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
271	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
272	301093	华兰股份	127	6,330.95	0.00
273	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
274	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
275	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
276	301190	善水科技	210	5,766.60	0.00
277	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
278	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
279	301049	超越科技	164	5,398.88	0.00
280	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
281	301088	戎美股份	212	5,230.04	0.00
282	301096	百诚医药	65	5,104.45	0.00
283	301193	家联科技	175	5,099.50	0.00
284	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
285	301179	泽宇智能	98	4,975.46	0.00
286	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
287	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
288	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
289	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
290	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
291	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	000001	平安银行	8,877,660.52	11.95
2	601166	兴业银行	6,483,102.34	8.73

3	000799	酒鬼酒	5,913,564.00	7.96
4	600438	通威股份	5,497,340.00	7.40
5	300628	亿联网络	5,453,006.75	7.34
6	000568	泸州老窖	5,331,381.00	7.18
7	300274	阳光电源	5,329,447.00	7.18
8	002594	比亚迪	5,282,212.26	7.11
9	002918	蒙娜丽莎	4,832,168.00	6.51
10	002142	宁波银行	4,602,225.00	6.20
11	601012	隆基股份	4,557,134.60	6.14
12	603806	福斯特	4,437,868.20	5.97
13	300037	新宙邦	4,422,494.00	5.95
14	600926	杭州银行	4,381,574.75	5.90
15	002821	凯莱英	4,373,341.00	5.89
16	600036	招商银行	4,304,494.00	5.80
17	000858	五粮液	4,285,467.00	5.77
18	688202	美迪西	4,272,797.78	5.75
19	002966	苏州银行	4,173,811.00	5.62
20	300059	东方财富	4,171,355.00	5.62
21	603127	昭衍新药	4,056,752.00	5.46
22	300982	苏文电能	4,051,424.00	5.45
23	300750	宁德时代	4,018,742.00	5.41
24	600887	伊利股份	3,992,868.00	5.38
25	300450	先导智能	3,974,175.05	5.35
26	300638	广和通	3,962,174.40	5.33
27	003022	联泓新科	3,861,351.10	5.20
28	300122	智飞生物	3,818,117.00	5.14
29	300957	贝泰妮	3,765,319.31	5.07
30	688200	华峰测控	3,764,914.27	5.07
31	600483	福能股份	3,746,869.92	5.04
32	600809	山西汾酒	3,743,521.96	5.04
33	002371	北方华创	3,728,409.00	5.02
34	688363	华熙生物	3,704,244.25	4.99
35	601636	旗滨集团	3,670,390.00	4.94
36	600188	兖矿能源	3,660,039.00	4.93
37	601633	长城汽车	3,630,307.98	4.89
38	600132	重庆啤酒	3,611,628.00	4.86
39	300014	亿纬锂能	3,599,528.00	4.85
40	600673	东阳光	3,572,616.00	4.81
41	603799	华友钴业	3,564,539.00	4.80
42	300474	景嘉微	3,541,923.00	4.77
43	000301	东方盛虹	3,535,459.00	4.76
44	688188	柏楚电子	3,525,890.40	4.75
45	300207	欣旺达	3,507,932.00	4.72
46	688536	思瑞浦	3,465,264.05	4.67

47	002032	苏泊尔	3,448,142.00	4.64
48	000928	中钢国际	3,440,473.97	4.63
49	600905	三峡能源	3,436,527.95	4.63
50	000650	仁和药业	3,430,943.00	4.62
51	603986	兆易创新	3,413,349.13	4.60
52	603260	合盛硅业	3,410,065.00	4.59
53	600031	三一重工	3,377,584.00	4.55
54	002139	拓邦股份	3,366,810.00	4.53
55	600338	西藏珠峰	3,363,965.00	4.53
56	300751	迈为股份	3,355,992.00	4.52
57	600801	华新水泥	3,347,682.00	4.51
58	300082	奥克股份	3,341,405.00	4.50
59	603659	璞泰来	3,329,215.55	4.48
60	600600	青岛啤酒	3,325,479.54	4.48
61	300762	上海瀚讯	3,318,832.20	4.47
62	000725	京东方 A	3,299,499.00	4.44
63	603906	龙蟠科技	3,283,883.76	4.42
64	300394	天孚通信	3,280,202.00	4.42
65	000825	太钢不锈	3,255,492.00	4.38
66	300850	新强联	3,247,810.00	4.37
67	300896	爱美客	3,242,553.00	4.37
68	605117	德业股份	3,217,676.19	4.33
69	002372	伟星新材	3,216,460.00	4.33
70	300432	富临精工	3,216,335.00	4.33
71	000333	美的集团	3,216,180.96	4.33
72	002091	江苏国泰	3,204,261.00	4.31
73	600585	海螺水泥	3,185,050.00	4.29
74	000932	华菱钢铁	3,184,321.00	4.29
75	002407	多氟多	3,167,252.00	4.26
76	601009	南京银行	3,137,112.84	4.22
77	688598	金博股份	3,114,892.72	4.19
78	601939	建设银行	3,107,662.00	4.18
79	601800	中国交建	3,094,020.00	4.17
80	603589	口子窖	3,089,395.00	4.16
81	688006	杭可科技	3,062,267.02	4.12
82	002623	亚玛顿	3,052,705.00	4.11
83	002049	紫光国微	3,050,431.00	4.11
84	002108	沧州明珠	3,034,791.00	4.09
85	601677	明泰铝业	3,028,172.00	4.08
86	688390	固德威	3,026,817.04	4.08
87	002709	天赐材料	3,026,729.00	4.08
88	300073	当升科技	3,019,954.00	4.07
89	300390	天华超净	3,017,705.20	4.06
90	300724	捷佳伟创	3,012,084.00	4.06

91	000596	古井贡酒	3,010,585.00	4.05
92	002245	蔚蓝锂芯	3,008,435.00	4.05
93	002812	恩捷股份	3,006,871.00	4.05
94	688696	极米科技	3,006,650.06	4.05
95	600884	杉杉股份	3,001,131.00	4.04
96	600111	北方稀土	2,997,588.00	4.04
97	600779	水井坊	2,995,169.00	4.03
98	300593	新雷能	2,995,091.92	4.03
99	300347	泰格医药	2,990,997.00	4.03
100	688366	昊海生科	2,987,475.23	4.02
101	688063	派能科技	2,986,347.13	4.02
102	600919	江苏银行	2,983,401.00	4.02
103	300035	中科电气	2,983,360.00	4.02
104	002459	晶澳科技	2,976,061.00	4.01
105	688301	奕瑞科技	2,974,625.07	4.00
106	300759	康龙化成	2,959,209.76	3.98
107	300502	新易盛	2,954,573.40	3.98
108	600460	士兰微	2,942,969.00	3.96
109	688378	奥来德	2,890,730.70	3.89
110	002304	洋河股份	2,886,248.00	3.89
111	002129	中环股份	2,870,056.01	3.86
112	002138	顺络电子	2,865,500.80	3.86
113	600110	诺德股份	2,853,011.99	3.84
114	002541	鸿路钢构	2,845,151.38	3.83
115	002648	卫星化学	2,842,674.80	3.83
116	300408	三环集团	2,842,496.74	3.83
117	000661	长春高新	2,826,401.00	3.81
118	688012	中微公司	2,814,388.51	3.79
119	300782	卓胜微	2,811,932.20	3.79
120	002402	和而泰	2,797,663.00	3.77
121	688065	凯赛生物	2,775,692.34	3.74
122	601233	桐昆股份	2,774,087.00	3.73
123	603667	五洲新春	2,748,152.03	3.70
124	300613	富瀚微	2,748,052.00	3.70
125	300725	药石科技	2,732,091.00	3.68
126	601995	中金公司	2,728,583.00	3.67
127	300763	锦浪科技	2,727,627.00	3.67
128	002497	雅化集团	2,726,276.00	3.67
129	688388	嘉元科技	2,715,539.93	3.66
130	002271	东方雨虹	2,713,662.00	3.65
131	000807	云铝股份	2,704,921.00	3.64
132	002833	弘亚数控	2,697,750.00	3.63
133	688005	容百科技	2,667,886.95	3.59
134	000768	中航西飞	2,664,542.00	3.59

135	300487	蓝晓科技	2,661,681.00	3.58
136	300627	华测导航	2,657,584.00	3.58
137	600383	金地集团	2,654,539.00	3.57
138	300680	隆盛科技	2,649,573.60	3.57
139	300737	科顺股份	2,636,938.00	3.55
140	603198	迎驾贡酒	2,636,640.00	3.55
141	603369	今世缘	2,628,807.00	3.54
142	002531	天顺风能	2,627,531.00	3.54
143	600348	华阳股份	2,615,937.00	3.52
144	000830	鲁西化工	2,610,383.19	3.51
145	601377	兴业证券	2,588,176.00	3.48
146	002414	高德红外	2,586,371.00	3.48
147	605020	永和股份	2,578,954.40	3.47
148	000739	普洛药业	2,572,871.00	3.46
149	300747	锐科激光	2,559,876.00	3.45
150	002557	洽洽食品	2,554,365.16	3.44
151	600048	保利发展	2,516,079.00	3.39
152	002034	旺能环境	2,512,799.00	3.38
153	300363	博腾股份	2,511,198.00	3.38
154	688599	天合光能	2,499,494.48	3.37
155	601155	新城控股	2,494,777.00	3.36
156	000625	长安汽车	2,491,193.40	3.35
157	002056	横店东磁	2,481,284.00	3.34
158	002539	云图控股	2,480,189.00	3.34
159	002335	科华数据	2,476,740.00	3.33
160	600760	中航沈飞	2,472,815.29	3.33
161	601788	光大证券	2,457,120.00	3.31
162	603379	三美股份	2,434,083.00	3.28
163	300623	捷捷微电	2,423,270.50	3.26
164	600409	三友化工	2,422,403.56	3.26
165	688169	石头科技	2,421,606.52	3.26
166	300031	宝通科技	2,406,198.47	3.24
167	688396	华润微	2,405,747.61	3.24
168	600298	安琪酵母	2,398,118.00	3.23
169	300496	中科创达	2,389,714.48	3.22
170	600027	华电国际	2,383,925.00	3.21
171	300137	先河环保	2,381,151.00	3.21
172	002601	龙佰集团	2,372,121.00	3.19
173	688099	晶晨股份	2,370,231.57	3.19
174	002050	三花智控	2,362,815.00	3.18
175	002415	海康威视	2,351,945.00	3.17
176	000656	金科股份	2,346,005.00	3.16
177	002597	金禾实业	2,336,804.00	3.15
178	603688	石英股份	2,330,863.59	3.14

179	002518	科士达	2,329,529.00	3.14
180	688116	天奈科技	2,329,472.49	3.14
181	002705	新宝股份	2,322,327.36	3.13
182	002179	中航光电	2,320,897.00	3.12
183	002460	赣锋锂业	2,318,780.00	3.12
184	002837	英维克	2,309,377.00	3.11
185	000762	西藏矿业	2,302,518.00	3.10
186	688499	利元亨	2,302,455.07	3.10
187	688122	西部超导	2,301,236.14	3.10
188	002756	永兴材料	2,289,837.00	3.08
189	002920	德赛西威	2,250,075.00	3.03
190	600596	新安股份	2,244,376.00	3.02
191	002677	浙江美大	2,237,814.00	3.01
192	603893	瑞芯微	2,230,891.00	3.00
193	300631	久吾高科	2,230,034.00	3.00
194	300677	英科医疗	2,226,152.00	3.00
195	603456	九洲药业	2,223,310.00	2.99
196	002867	周大生	2,221,124.88	2.99
197	002493	荣盛石化	2,214,803.00	2.98
198	688126	沪硅产业	2,207,758.56	2.97
199	601398	工商银行	2,207,023.00	2.97
200	603185	上机数控	2,195,743.18	2.96
201	601669	中国电建	2,181,992.00	2.94
202	300568	星源材质	2,177,894.00	2.93
203	605305	中际联合	2,173,056.92	2.93
204	601318	中国平安	2,158,197.00	2.91
205	688733	壹石通	2,155,516.87	2.90
206	002043	兔宝宝	2,154,997.56	2.90
207	002461	珠江啤酒	2,152,356.00	2.90
208	000963	华东医药	2,142,391.00	2.88
209	000630	铜陵有色	2,139,517.00	2.88
210	300821	东岳硅材	2,134,521.00	2.87
211	688029	南微医学	2,132,315.74	2.87
212	603993	洛阳钼业	2,119,088.00	2.85
213	301040	中环海陆	2,106,513.13	2.84
214	603236	移远通信	2,105,672.60	2.83
215	603313	梦百合	2,099,161.18	2.83
216	002396	星网锐捷	2,083,636.00	2.81
217	601100	恒立液压	2,081,670.00	2.80
218	688559	海目星	2,075,330.57	2.79
219	300642	透景生命	2,071,455.00	2.79
220	000425	徐工机械	2,054,272.00	2.77
221	300661	圣邦股份	2,049,946.86	2.76
222	600096	云天化	2,025,642.00	2.73

223	002326	永太科技	2,021,863.00	2.72
224	000933	神火股份	2,013,699.00	2.71
225	300415	伊之密	2,001,387.00	2.69
226	688037	芯源微	1,998,107.91	2.69
227	600773	西藏城投	1,990,760.00	2.68
228	002367	康力电梯	1,984,923.00	2.67
229	002466	天齐锂业	1,982,223.00	2.67
230	600011	华能国际	1,975,944.00	2.66
231	300679	电连技术	1,972,454.00	2.66
232	600141	兴发集团	1,960,805.00	2.64
233	002110	三钢闽光	1,959,940.00	2.64
234	603396	金辰股份	1,931,723.00	2.60
235	300772	运达股份	1,915,405.00	2.58
236	600958	东方证券	1,911,059.00	2.57
237	300142	沃森生物	1,908,000.00	2.57
238	688777	中控技术	1,902,060.85	2.56
239	300034	钢研高纳	1,901,157.31	2.56
240	002353	杰瑞股份	1,899,986.00	2.56
241	002230	科大讯飞	1,884,956.00	2.54
242	603290	斯达半导	1,874,735.20	2.52
243	300223	北京君正	1,870,529.00	2.52
244	001979	招商蛇口	1,867,908.40	2.51
245	000983	山西焦煤	1,864,265.00	2.51
246	300558	贝达药业	1,862,811.00	2.51
247	603520	司太立	1,856,164.00	2.50
248	300316	晶盛机电	1,852,289.00	2.49
249	600519	贵州茅台	1,850,234.00	2.49
250	002340	格林美	1,845,646.00	2.48
251	600176	中国巨石	1,844,777.72	2.48
252	000902	新洋丰	1,816,826.00	2.45
253	002727	一心堂	1,815,221.00	2.44
254	600346	恒力石化	1,814,484.00	2.44
255	600456	宝钛股份	1,814,315.00	2.44
256	600160	巨化股份	1,814,015.00	2.44
257	688516	奥特维	1,811,707.61	2.44
258	300369	绿盟科技	1,792,263.00	2.41
259	688139	海尔生物	1,791,733.63	2.41
260	300601	康泰生物	1,786,496.00	2.41
261	000671	阳光城	1,782,977.00	2.40
262	600893	航发动力	1,778,223.00	2.39
263	000157	中联重科	1,776,630.00	2.39
264	688608	恒玄科技	1,768,587.80	2.38
265	600863	内蒙华电	1,763,092.00	2.37
266	688017	绿的谐波	1,757,952.58	2.37

267	300327	中颖电子	1,757,589.00	2.37
268	300129	泰胜风能	1,757,268.00	2.37
269	688016	心脉医疗	1,747,027.14	2.35
270	603612	索通发展	1,744,530.00	2.35
271	601225	陕西煤业	1,739,350.08	2.34
272	688699	明微电子	1,738,965.51	2.34
273	601222	林洋能源	1,736,797.00	2.34
274	002850	科达利	1,733,912.00	2.33
275	688018	乐鑫科技	1,732,417.53	2.33
276	300827	上能电气	1,720,371.00	2.32
277	603378	亚士创能	1,717,652.52	2.31
278	300699	光威复材	1,698,946.00	2.29
279	300015	爱尔眼科	1,686,115.00	2.27
280	600025	华能水电	1,683,903.00	2.27
281	603288	海天味业	1,682,542.20	2.27
282	000155	川能动力	1,681,238.00	2.26
283	002007	华兰生物	1,677,312.00	2.26
284	601390	中国中铁	1,670,694.00	2.25
285	300769	德方纳米	1,666,061.40	2.24
286	600732	爱旭股份	1,665,793.89	2.24
287	600961	株冶集团	1,664,327.00	2.24
288	603678	火炬电子	1,660,281.00	2.24
289	601865	福莱特	1,659,732.00	2.23
290	002233	塔牌集团	1,648,355.00	2.22
291	002028	思源电气	1,648,094.00	2.22
292	300438	鹏辉能源	1,642,601.00	2.21
293	688356	键凯科技	1,634,034.73	2.20
294	601658	邮储银行	1,631,747.00	2.20
295	002815	崇达技术	1,624,008.00	2.19
296	300454	深信服	1,623,766.00	2.19
297	002026	山东威达	1,618,550.00	2.18
298	300693	盛弘股份	1,612,771.00	2.17
299	000703	恒逸石化	1,607,031.00	2.16
300	300655	晶瑞电材	1,603,009.00	2.16
301	688111	金山办公	1,603,005.56	2.16
302	002092	中泰化学	1,600,289.00	2.15
303	600378	昊华科技	1,598,727.00	2.15
304	601058	赛轮轮胎	1,597,749.00	2.15
305	688233	神工股份	1,597,141.17	2.15
306	605111	新洁能	1,590,042.00	2.14
307	603501	韦尔股份	1,589,826.00	2.14
308	688408	中信博	1,589,536.07	2.14
309	002612	朗姿股份	1,587,681.00	2.14
310	600171	上海贝岭	1,585,859.00	2.14

311	002938	鹏鼎控股	1,585,018.00	2.13
312	603218	日月股份	1,582,256.00	2.13
313	600499	科达制造	1,576,393.00	2.12
314	002442	龙星化工	1,575,742.00	2.12
315	002573	清新环境	1,568,986.00	2.11
316	688508	芯朋微	1,568,253.59	2.11
317	603026	石大胜华	1,566,655.00	2.11
318	300346	南大光电	1,565,690.00	2.11
319	600711	盛屯矿业	1,563,169.00	2.10
320	300726	宏达电子	1,562,589.98	2.10
321	000002	万科 A	1,560,204.90	2.10
322	002572	索菲亚	1,558,806.00	2.10
323	601615	明阳智能	1,557,197.00	2.10
324	002120	韵达股份	1,557,003.00	2.10
325	603995	甬金股份	1,555,142.00	2.09
326	600399	抚顺特钢	1,553,465.00	2.09
327	002240	盛新锂能	1,548,709.00	2.09
328	002472	双环传动	1,546,382.00	2.08
329	002791	坚朗五金	1,544,587.00	2.08
330	000538	云南白药	1,543,500.00	2.08
331	688357	建龙微纳	1,541,274.87	2.08
332	603816	顾家家居	1,538,060.00	2.07
333	600004	白云机场	1,532,958.00	2.06
334	600219	南山铝业	1,532,083.00	2.06
335	002832	比音勒芬	1,529,642.00	2.06
336	000998	隆平高科	1,529,398.00	2.06
337	002895	川恒股份	1,519,667.00	2.05
338	002745	木林森	1,517,844.00	2.04
339	002624	完美世界	1,507,124.60	2.03
340	300692	中环环保	1,503,292.40	2.02
341	688036	传音控股	1,501,409.34	2.02
342	000733	振华科技	1,500,160.67	2.02
343	688007	光峰科技	1,495,264.51	2.01

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	000001	平安银行	9,295,236.00	12.51
2	600036	招商银行	8,079,403.46	10.88

3	600905	三峡能源	6,829,740.00	9.20
4	601166	兴业银行	6,585,185.00	8.87
5	300274	阳光电源	5,849,620.54	7.88
6	000858	五粮液	5,524,788.01	7.44
7	300628	亿联网络	5,524,252.00	7.44
8	600887	伊利股份	5,389,242.00	7.26
9	000568	泸州老窖	5,275,926.00	7.10
10	600438	通威股份	5,267,682.38	7.09
11	600519	贵州茅台	5,176,523.00	6.97
12	000799	酒鬼酒	4,880,396.00	6.57
13	002142	宁波银行	4,865,998.00	6.55
14	603806	福斯特	4,811,137.00	6.48
15	300638	广和通	4,677,114.94	6.30
16	300037	新宙邦	4,515,003.00	6.08
17	300474	景嘉微	4,485,808.00	6.04
18	601318	中国平安	4,473,610.00	6.02
19	002594	比亚迪	4,391,091.00	5.91
20	600600	青岛啤酒	4,341,435.50	5.85
21	000333	美的集团	4,247,326.00	5.72
22	601012	隆基股份	4,200,307.00	5.66
23	003022	联泓新科	4,189,497.00	5.64
24	002966	苏州银行	4,130,692.00	5.56
25	600926	杭州银行	4,102,348.00	5.52
26	300450	先导智能	4,038,934.00	5.44
27	300750	宁德时代	3,961,250.36	5.33
28	603659	璞泰来	3,898,297.00	5.25
29	600031	三一重工	3,885,679.28	5.23
30	300059	东方财富	3,852,290.32	5.19
31	300122	智飞生物	3,799,836.00	5.12
32	600884	杉杉股份	3,765,914.96	5.07
33	688188	柏楚电子	3,751,999.94	5.05
34	600809	山西汾酒	3,665,952.20	4.94
35	603260	合盛硅业	3,639,434.59	4.90
36	002918	蒙娜丽莎	3,585,477.00	4.83
37	002821	凯莱英	3,581,825.00	4.82
38	601939	建设银行	3,566,203.17	4.80
39	603986	兆易创新	3,524,949.40	4.75
40	600188	兖矿能源	3,476,839.00	4.68
41	300073	当升科技	3,441,540.46	4.63
42	300850	新强联	3,410,089.00	4.59
43	002623	亚玛顿	3,378,407.19	4.55
44	600132	重庆啤酒	3,326,407.00	4.48
45	002709	天赐材料	3,299,305.80	4.44
46	688363	华熙生物	3,294,650.08	4.44

47	000650	仁和药业	3,294,350.00	4.44
48	000825	太钢不锈	3,258,710.00	4.39
49	688366	昊海生科	3,257,642.55	4.39
50	603127	昭衍新药	3,254,833.00	4.38
51	601100	恒立液压	3,233,816.00	4.35
52	603993	洛阳钼业	3,222,960.00	4.34
53	300762	上海瀚讯	3,208,758.00	4.32
54	300957	贝泰妮	3,200,935.00	4.31
55	601677	明泰铝业	3,196,217.00	4.30
56	600919	江苏银行	3,179,042.00	4.28
57	601009	南京银行	3,167,851.00	4.27
58	300613	富瀚微	3,163,185.08	4.26
59	000725	京东方 A	3,162,341.00	4.26
60	688202	美迪西	3,129,418.68	4.21
61	000932	华菱钢铁	3,128,367.00	4.21
62	601633	长城汽车	3,101,383.00	4.18
63	300680	隆盛科技	3,100,962.80	4.17
64	688012	中微公司	3,084,782.19	4.15
65	002049	紫光国微	3,084,289.00	4.15
66	300035	中科电气	3,072,475.00	4.14
67	600338	西藏珠峰	3,041,418.00	4.09
68	000301	东方盛虹	3,022,821.00	4.07
69	601678	滨化股份	3,016,162.40	4.06
70	688065	凯赛生物	3,009,615.47	4.05
71	300982	苏文电能	3,005,762.39	4.05
72	603799	华友钴业	2,989,201.00	4.02
73	600298	安琪酵母	2,988,237.00	4.02
74	300502	新易盛	2,977,847.48	4.01
75	300896	爱美客	2,965,843.00	3.99
76	688301	奕瑞科技	2,949,939.62	3.97
77	002129	中环股份	2,947,503.00	3.97
78	002402	和而泰	2,942,651.00	3.96
79	002648	卫星化学	2,934,122.00	3.95
80	002371	北方华创	2,914,557.00	3.92
81	002812	恩捷股份	2,911,191.00	3.92
82	000596	古井贡酒	2,902,589.00	3.91
83	603501	韦尔股份	2,901,436.00	3.91
84	300394	天孚通信	2,898,284.62	3.90
85	300408	三环集团	2,873,549.00	3.87
86	002138	顺络电子	2,868,914.90	3.86
87	600141	兴发集团	2,828,126.00	3.81
88	002459	晶澳科技	2,826,491.00	3.81
89	300593	新雷能	2,806,797.00	3.78
90	300627	华测导航	2,804,383.20	3.78

91	002032	苏泊尔	2,796,606.42	3.77
92	600483	福能股份	2,796,193.00	3.76
93	002139	拓邦股份	2,794,237.48	3.76
94	600760	中航沈飞	2,792,442.60	3.76
95	000807	云铝股份	2,787,357.97	3.75
96	300782	卓胜微	2,773,033.60	3.73
97	603882	金域医学	2,768,237.80	3.73
98	300347	泰格医药	2,764,113.00	3.72
99	000830	鲁西化工	2,750,005.00	3.70
100	002304	洋河股份	2,731,394.00	3.68
101	688696	极米科技	2,727,663.90	3.67
102	688599	天合光能	2,725,837.10	3.67
103	601995	中金公司	2,715,487.82	3.66
104	688122	西部超导	2,715,182.53	3.66
105	300207	欣旺达	2,713,823.00	3.65
106	002271	东方雨虹	2,710,629.00	3.65
107	601233	桐昆股份	2,699,909.00	3.64
108	600096	云天化	2,699,246.00	3.63
109	601688	华泰证券	2,698,676.00	3.63
110	601888	中国中免	2,697,698.00	3.63
111	300034	钢研高纳	2,681,107.00	3.61
112	002531	天顺风能	2,666,124.00	3.59
113	300747	锐科激光	2,651,379.00	3.57
114	300751	迈为股份	2,648,056.60	3.57
115	688396	华润微	2,644,541.11	3.56
116	300724	捷佳伟创	2,644,348.52	3.56
117	300759	康龙化成	2,622,411.00	3.53
118	000768	中航西飞	2,613,308.00	3.52
119	688099	晶晨股份	2,607,983.32	3.51
120	002833	弘亚数控	2,607,412.40	3.51
121	688200	华峰测控	2,604,800.12	3.51
122	000625	长安汽车	2,600,081.20	3.50
123	002034	旺能环境	2,582,876.00	3.48
124	300623	捷捷微电	2,572,568.50	3.46
125	002372	伟星新材	2,568,402.63	3.46
126	603589	口子窖	2,564,766.00	3.45
127	300769	德方纳米	2,550,809.00	3.43
128	601377	兴业证券	2,519,856.00	3.39
129	300631	久吾高科	2,495,031.00	3.36
130	688006	杭可科技	2,480,865.16	3.34
131	000661	长春高新	2,477,790.00	3.34
132	688536	思瑞浦	2,477,759.45	3.34
133	300014	亿纬锂能	2,462,958.00	3.32
134	000928	中钢国际	2,458,363.23	3.31

135	002179	中航光电	2,447,767.00	3.30
136	300137	先河环保	2,436,810.00	3.28
137	301040	中环海陆	2,422,649.80	3.26
138	002414	高德红外	2,420,431.00	3.26
139	603313	梦百合	2,418,498.47	3.26
140	300390	天华超净	2,413,657.00	3.25
141	300223	北京君正	2,409,552.00	3.24
142	601155	新城控股	2,404,005.00	3.24
143	002415	海康威视	2,389,296.00	3.22
144	002050	三花智控	2,386,507.00	3.21
145	601788	光大证券	2,378,186.00	3.20
146	002557	洽洽食品	2,374,067.82	3.20
147	688598	金博股份	2,367,740.13	3.19
148	600779	水井坊	2,341,558.00	3.15
149	300031	宝通科技	2,330,631.00	3.14
150	000739	普洛药业	2,317,311.37	3.12
151	002497	雅化集团	2,314,085.00	3.12
152	002597	金禾实业	2,307,323.00	3.11
153	600773	西藏城投	2,306,698.00	3.11
154	688169	石头科技	2,306,036.47	3.10
155	300679	电连技术	2,297,522.00	3.09
156	603906	龙蟠科技	2,292,320.78	3.09
157	688388	嘉元科技	2,287,193.37	3.08
158	002601	龙佰集团	2,282,708.00	3.07
159	002396	星网锐捷	2,266,784.00	3.05
160	002091	江苏国泰	2,253,897.00	3.03
161	600409	三友化工	2,253,194.62	3.03
162	688037	芯源微	2,247,630.56	3.03
163	688390	固德威	2,242,609.49	3.02
164	600383	金地集团	2,212,953.00	2.98
165	601636	旗滨集团	2,203,805.00	2.97
166	603369	今世缘	2,203,584.00	2.97
167	002920	德赛西威	2,202,038.00	2.96
168	002705	新宝股份	2,196,969.00	2.96
169	600596	新安股份	2,194,328.20	2.95
170	300496	中科创达	2,190,861.12	2.95
171	601398	工商银行	2,188,311.00	2.95
172	688005	容百科技	2,176,225.70	2.93
173	002677	浙江美大	2,173,916.00	2.93
174	688126	沪硅产业	2,168,758.69	2.92
175	002493	荣盛石化	2,146,403.00	2.89
176	601390	中国中铁	2,143,566.00	2.89
177	600958	东方证券	2,133,837.00	2.87
178	002867	周大生	2,111,950.00	2.84

179	688029	南微医学	2,107,754.36	2.84
180	300432	富临精工	2,104,272.00	2.83
181	688733	壹石通	2,103,736.22	2.83
182	300677	英科医疗	2,098,779.00	2.83
183	002043	兔宝宝	2,098,131.98	2.82
184	002407	多氟多	2,089,299.00	2.81
185	002245	蔚蓝锂芯	2,086,958.00	2.81
186	600048	保利发展	2,063,982.00	2.78
187	688018	乐鑫科技	2,055,226.35	2.77
188	603893	瑞芯微	2,052,208.00	2.76
189	002461	珠江啤酒	2,042,739.00	2.75
190	600585	海螺水泥	2,040,238.00	2.75
191	000425	徐工机械	2,038,868.00	2.75
192	000733	振华科技	2,038,310.12	2.74
193	000963	华东医药	2,036,464.00	2.74
194	600110	诺德股份	2,027,003.00	2.73
195	601211	国泰君安	2,025,127.08	2.73
196	300737	科顺股份	2,018,154.00	2.72
197	300642	透景生命	2,017,387.00	2.72
198	600673	东阳光	1,996,628.00	2.69
199	300772	运达股份	1,994,835.00	2.69
200	002353	杰瑞股份	1,994,087.71	2.68
201	002460	赣锋锂业	1,993,466.00	2.68
202	002110	三钢闽光	1,988,433.00	2.68
203	300415	伊之密	1,980,696.42	2.67
204	002541	鸿路钢构	1,972,015.67	2.66
205	600875	东方电气	1,964,795.00	2.65
206	603678	火炬电子	1,959,458.30	2.64
207	600460	士兰微	1,958,960.00	2.64
208	601919	中远海控	1,940,256.90	2.61
209	600456	宝钛股份	1,928,784.00	2.60
210	002007	华兰生物	1,913,866.00	2.58
211	600111	北方稀土	1,908,473.00	2.57
212	300568	星源材质	1,907,350.79	2.57
213	603378	亚士创能	1,906,676.35	2.57
214	688139	海尔生物	1,904,899.31	2.56
215	603688	石英股份	1,902,282.84	2.56
216	603185	上机数控	1,896,450.00	2.55
217	002367	康力电梯	1,896,354.00	2.55
218	688608	恒玄科技	1,894,970.26	2.55
219	600176	中国巨石	1,887,791.85	2.54
220	688499	利元亨	1,884,653.72	2.54
221	002230	科大讯飞	1,875,438.00	2.52
222	688777	中控技术	1,872,802.39	2.52

223	000762	西藏矿业	1,863,824.00	2.51
224	300129	泰胜风能	1,857,702.00	2.50
225	000630	铜陵有色	1,854,989.00	2.50
226	603236	移远通信	1,850,181.10	2.49
227	600998	九州通	1,848,276.80	2.49
228	688063	派能科技	1,847,843.48	2.49
229	603198	迎驾贡酒	1,840,305.00	2.48
230	300082	奥克股份	1,828,476.00	2.46
231	688378	奥来德	1,823,381.99	2.45
232	601225	陕西煤业	1,819,209.84	2.45
233	300558	贝达药业	1,811,632.00	2.44
234	002727	一心堂	1,790,438.00	2.41
235	300821	东岳硅材	1,788,360.00	2.41
236	600171	上海贝岭	1,783,498.00	2.40
237	002340	格林美	1,782,464.00	2.40
238	000902	新洋丰	1,774,430.00	2.39
239	600160	巨化股份	1,760,996.00	2.37
240	300142	沃森生物	1,758,391.00	2.37
241	600584	长电科技	1,757,981.00	2.37
242	605020	永和股份	1,740,307.76	2.34
243	603218	日月股份	1,736,589.00	2.34
244	300363	博腾股份	1,728,064.00	2.33
245	300763	锦浪科技	1,725,535.00	2.32
246	300487	蓝晓科技	1,723,578.71	2.32
247	601186	中国铁建	1,710,024.00	2.30
248	600893	航发动力	1,689,906.00	2.28
249	688016	心脉医疗	1,682,894.69	2.27
250	603288	海天味业	1,680,178.08	2.26
251	603026	石大胜华	1,674,532.32	2.25
252	300725	药石科技	1,672,060.00	2.25
253	000656	金科股份	1,665,097.00	2.24
254	603379	三美股份	1,664,907.00	2.24
255	000157	中联重科	1,656,050.00	2.23
256	300369	绿盟科技	1,652,513.00	2.22
257	688699	明微电子	1,644,300.34	2.21
258	002938	鹏鼎控股	1,631,325.00	2.20
259	605117	德业股份	1,627,810.00	2.19
260	000002	万科 A	1,622,481.00	2.18
261	688508	芯朋微	1,618,605.01	2.18
262	600378	昊华科技	1,618,363.00	2.18
263	601615	明阳智能	1,614,651.00	2.17
264	000538	云南白药	1,613,141.00	2.17
265	601658	邮储银行	1,606,016.00	2.16
266	688007	光峰科技	1,605,783.52	2.16

267	600346	恒力石化	1,597,126.00	2.15
268	002145	中核钛白	1,593,269.00	2.15
269	688116	天奈科技	1,591,300.99	2.14
270	600019	宝钢股份	1,589,613.00	2.14
271	601058	赛轮轮胎	1,586,251.00	2.14
272	002335	科华数据	1,575,929.00	2.12
273	688356	键凯科技	1,575,392.51	2.12
274	002832	比音勒芬	1,571,187.00	2.12
275	000983	山西焦煤	1,569,040.00	2.11
276	002815	崇达技术	1,567,249.00	2.11
277	600348	华阳股份	1,557,333.00	2.10
278	603995	甬金股份	1,555,624.00	2.09
279	688111	金山办公	1,546,104.73	2.08
280	688036	传音控股	1,544,021.90	2.08
281	002573	清新环境	1,542,971.00	2.08
282	002756	永兴材料	1,539,403.00	2.07
283	300196	长海股份	1,537,055.00	2.07
284	601838	成都银行	1,534,164.00	2.07
285	000933	神火股份	1,533,319.00	2.06
286	601865	福莱特	1,532,131.00	2.06
287	000703	恒逸石化	1,529,859.15	2.06
288	600011	华能国际	1,529,697.00	2.06
289	603667	五洲新春	1,524,026.00	2.05
290	688357	建龙微纳	1,516,483.37	2.04
291	300827	上能电气	1,505,410.00	2.03
292	603396	金辰股份	1,504,984.00	2.03
293	600004	白云机场	1,502,603.00	2.02
294	300454	深信服	1,497,490.00	2.02
295	600801	华新水泥	1,492,987.00	2.01
296	600027	华电国际	1,486,280.00	2.00

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	1,372,136,568.87
卖出股票收入（成交）总额	1,297,946,125.95

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	58,175.06
2	应收证券清算款	535,088.78
3	应收股利	-
4	应收利息	1,483.20
5	应收申购款	50,124.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	644,871.43

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
易方达易百智能量化策略混合 A	1,101	61,524.97	26,481,509.74	39.09%	41,257,486.56	60.91%
易方达易百智能量化策略混合 C	617	80,191.15	42,619,736.93	86.14%	6,858,200.10	13.86%
合计	1,718	68,228.72	69,101,246.67	58.95%	48,115,686.66	41.05%

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	易方达易百智能量化策略混合 A	287,373.52	0.4242%
	易方达易百智能量化策略混合 C	1.00	0.0000%
	合计	287,374.52	0.2452%

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、基金投资和研发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	10~50
	易方达易百智能量化策略混合 C	0
	合计	10~50

§ 10 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 A	易方达易百智能量化策略混合 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	54,701,431.67	65,408,781.81
减：本报告期基金总赎回份额	37,776,661.82	20,391,254.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	67,738,996.30	49,477,937.03

§ 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 4 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 40,000.00 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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	64,870,590.86	2.44%	12,974.58	67.04%	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	2,595,484,516.67	97.56%	6,378.88	32.96%	-

华福证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	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、国盛证券有限责任公司、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、中国国际金融股份有限公司、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、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下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券投资基金基金经理变更公告	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	2021-03-20
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 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2021-04-19
8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-17
9	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	中国证券报	2021-07-20
10	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
11	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	2021-07-24
12	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	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	2021-07-28
13	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	2021-07-30
14	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	中国证券报	2021-08-28
15	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	中国证券报	2021-10-27
16	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2021-11-15

	股票的公告	金电子披露网站	
17	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	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	2021-12-17
18	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购中国移动有限公司首次公开发行股票的公告	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	2021-12-25

§ 12影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	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08月31日,2021年09月06日,2021年12月03日~2021年12月31日	0.00	23,782,305.37	0.00	23,782,305.37	20.29%
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>							

§ 13备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达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。

13.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日