

# 易方达价值成长混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12	投资组合报告附注 .....	45
8	基金份额持有人信息 .....	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	47
9	开放式基金份额变动 .....	48
10	重大事件揭示 .....	48
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4	基金投资策略的改变 .....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8	其他重大事件 .....	51
11	备查文件目录 .....	52
11.1	备查文件目录 .....	52
11.2	存放地点 .....	53
11.3	查阅方式 .....	53

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达价值成长混合型证券投资基金
基金简称	易方达价值成长混合
基金主代码	110010
交易代码	110010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 4 月 2 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,143,098,846.40 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主动的资产配置以及对成长价值风格突出的股票进行投资，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金根据宏观及微观经济因素、市场因素和政策因素，进行大类资产的战略性配置。在股票投资方面，本基金遵循三个投资步骤。一是进行股票的风格特征的数量化评估，应用“易方达成长与价值股评价模型”，使用历史与预测的数据，从公司的备选库股票中选择成长与价值特性突出的股票。二是进行股票素质的基本面筛选，使用优质成长股与优质价值股的评价标准，在前面用数量化方法选出的风格鲜明的股票中，应用基本面分析方法，选出基本面较好的股票。三是进行成长与价值的风格配置，根据对市场的判断，动态地调整成长股与价值股的投资比重，追求在可控风险前提下的稳健回报。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	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，高于债券型基金及货币市场基金。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799

负责人	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55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55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	陈四清

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	1,341,330,431.80
本期利润	108,131,837.83
加权平均基金份额本期利润	0.0496
本期加权平均净值利润率	2.02%
本期基金份额净值增长率	1.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	3,205,748,860.59
期末可供分配基金份额利润	1.4958
期末基金资产净值	5,348,847,706.99
期末基金份额净值	2.4958

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	234.87%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.95%	1.01%	-1.37%	0.57%	3.32%	0.44%
过去三个月	9.65%	1.13%	2.69%	0.68%	6.96%	0.45%
过去六个月	1.62%	1.43%	0.67%	0.92%	0.95%	0.51%
过去一年	19.28%	1.51%	18.55%	0.93%	0.73%	0.58%
过去三年	69.24%	1.58%	38.04%	0.96%	31.20%	0.62%
自基金合同生效起至今	234.87%	1.68%	81.63%	1.20%	153.24%	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

易方达价值成长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

(2007年4月2日至2021年6月30日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 234.87%，同期业绩比较基准收益率为 81.63%。

## 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		
林高榜	本基金的基金经理、易方达金融行业股票型发起式证券投资基金的基金经理	2018-03-23	-	9 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、投资经理、基金经理助理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。



武阳	本基金的基金经理、易方达远见成长混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018-03-23	2021-05-29	10 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行业研究员、易方达策略成长证券投资基金基金经理、基金经理助理。
林海	本基金的基金经理	2021-05-29	-	24 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任申银万国证券公司湖北武汉营业部研究员，易方达基金管理有限公司市场拓展部研究员、基金经理助理、固定收益部副总经理、易方达货币市场基金基金经理、易方达月月收益中短期债券投资基金基金经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理、专户投资部投资经理、权益投资管理部投资经理。

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，从宏观经济总量来看，国内外经济都陆续进入了复苏的周期。国内经济高景气、国外经济陆续从疫情冲击下复苏，叠加由于疫情冲击导致的供应链阻断等因素，部分原材料、中间产品价格和运输费用出现了较大幅度的上涨。这一方面导致中游制造业的成本上升和盈利能力受到限制，另一方面增加了市场参与者对通胀压力和货币政策收紧的担忧。股票市场对于上述变化作出了一定的反应，上游周期行业的表现较强，中游制造业的表现有所减弱，而对远期盈利前景和利率较为敏感的公司则调整幅度较大。相比海外主要经济体，中国经济在 2020 年率先走出疫情冲击的低谷，并在 2021 年上半年迎来了景气度恢复的峰值。尽管上半年仍有部分国家和地区出现疫情的反复爆发，但随着管控措施逐渐发挥作用，疫苗供应逐渐放量，疫情受控的趋势不会改变，全球经济也将稳定复苏。

2021 年上半年，本基金股票比例保持稳定，股票行业结构有所调整。按申万行业区分，主要增加了电子、医药生物、电气设备、有色金属和建筑材料行业的比例，降低了计算机、机械设备和家用电器行业的比例。本基金仍将聚焦于具备长期核心竞争优势的优质企业，并给予经营处于向上扩张趋势的企业更多关注。在当前阶段，新能源汽车产业链、光伏产业链和电子元器件、半导体产业链体现出了较高的景气度，提示了经济在未来一定阶段内的发展亮点，基金在上述方向上增加了个股投资。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.4958 元，本报告期份额净值增长率为 1.62%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于经济和市场的这些变化，我们倾向于认为，经济的高景气仍将在较长时期持续，但全球尤其是中国经济产出缺口的快速扩张动能已经收敛。随着新增供应逐渐出现以及全球供应链的逐渐修

复，上游原材料价格上涨的高峰已过，制造业盈利能力将得到改善，短期的上中游价格上涨目前看并不一定能带来长期通胀压力的上升。中国央行和美国联储都做出了维持稳定的货币政策的类似表述，中国央行于 7 月降低了存款准备金率，向市场传递了稳定货币政策的较强信号，市场对于货币收缩和利率上行的短期担忧在慢慢减弱。因此，我们对于股票市场整体趋势并不悲观，并且基于经济景气度将在较长时间内维持偏高区间的判断，对于股票市场在部分行业和结构上的投资机会持乐观态度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 375,691,536.01 元。

### 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，本基金托管人在对易方达价值成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，易方达价值成长混合型证券投资基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达价值成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达价值成长混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	229,418,587.42	332,972,093.13
结算备付金		5,648,949.45	5,142,487.92
存出保证金		775,496.24	953,759.85
交易性金融资产	6.4.7.2	5,142,883,800.51	5,688,968,866.91
其中：股票投资		5,003,257,909.09	5,680,505,327.07
基金投资		-	-
债券投资		139,625,891.42	8,463,539.84
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		440,142.61	1,444,577.34
应收利息	6.4.7.5	475,419.37	57,957.55
应收股利		-	-

应收申购款		520,811.06	594,520.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,380,163,206.66	6,030,134,262.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		16,598,308.94	33,150,659.36
应付管理人报酬		6,436,203.96	7,384,869.73
应付托管费		1,072,700.65	1,230,811.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,267,506.53	2,446,214.05
应交税费		690,206.55	690,306.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,250,573.04	1,514,785.04
负债合计		31,315,499.67	46,417,646.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,143,098,846.40	2,282,307,705.39
未分配利润	6.4.7.10	3,205,748,860.59	3,701,408,911.18
所有者权益合计		5,348,847,706.99	5,983,716,616.57
负债和所有者权益总计		5,380,163,206.66	6,030,134,262.96

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.4958 元，基金份额总额 2,143,098,846.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日
一、收入		<b>169,761,213.81</b>	<b>1,202,905,068.60</b>
1.利息收入	6.4.7.11	952,214.31	1,772,331.78

其中：存款利息收入		862,831.06	1,263,442.06
债券利息收入		89,383.25	376,865.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	132,023.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,401,700,902.83	447,446,270.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,383,945,597.01	421,679,874.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,396,215.23	1,029,071.74
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	16,359,090.59	24,737,323.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,233,198,593.97	753,237,227.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	306,690.64	449,239.51
<b>减：二、费用</b>		<b>61,629,375.98</b>	<b>63,257,762.42</b>
1. 管理人报酬		40,080,694.36	40,755,034.28
2. 托管费		6,680,115.68	6,792,505.66
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	14,723,735.64	15,564,437.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		104.12	135.00
7. 其他费用	6.4.7.19	144,726.18	145,650.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>108,131,837.83</b>	<b>1,139,647,306.18</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>108,131,837.83</b>	<b>1,139,647,306.18</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,282,307,705.39	3,701,408,911.18	5,983,716,616.57

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	108,131,837.83	108,131,837.83
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）	-139,208,858.99	-228,100,352.41	-367,309,211.40
其中：1.基金申购款	187,021,994.39	291,385,632.62	478,407,627.01
2.基金赎回款	-326,230,853.38	-519,485,985.03	-845,716,838.41
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）	-	-375,691,536.01	-375,691,536.01
五、期末所有者权益（基金净值）	2,143,098,846.40	3,205,748,860.59	5,348,847,706.99
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,932,872,580.02	2,670,869,730.96	5,603,742,310.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,139,647,306.18	1,139,647,306.18
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）	-262,168,065.04	-246,819,993.88	-508,988,058.92
其中：1.基金申购款	270,207,183.98	262,868,029.46	533,075,213.44
2.基金赎回款	-532,375,249.02	-509,688,023.34	-1,042,063,272.36
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）	-	-268,821,615.50	-268,821,615.50
五、期末所有者权益（基金净值）	2,670,704,514.98	3,294,875,427.76	5,965,579,942.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达价值成长混合型证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国

证监会”)证监基金字[2007] 69 号文件《关于同意易方达价值成长混合型证券投资基金募集的批复》批准,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《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》向社会公开募集。经向中国证监会备案,本基金基金合同于 2007 年 4 月 2 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,874,939,465.41 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。基金管理人为易方达基金管理有限公司,注册登记机构为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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



资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	229,418,587.42
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	229,418,587.42

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,394,524,106.86	5,003,257,909.09	608,733,802.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,286,900.00	9,668,891.42
	银行间市场	129,851,310.00	129,957,000.00
	合计	137,138,210.00	139,625,891.42
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,531,662,316.86	5,142,883,800.51	611,221,483.65

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	22,848.18
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	2,287.80
应收债券利息	449,969.29
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	314.10
合计	475,419.37

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,266,881.53
银行间市场应付交易费用	625.00
合计	5,267,506.53

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00
应付赎回费	16,021.76
应付证券出借违约金	-
预提费用	234,551.28
其他应付款	-
合计	1,250,573.04

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,282,307,705.39	2,282,307,705.39
本期申购	187,021,994.39	187,021,994.39
本期赎回（以“-”号填列）	-326,230,853.38	-326,230,853.38
本期末	2,143,098,846.40	2,143,098,846.40

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,564,126,385.70	137,282,525.48	3,701,408,911.18
本期利润	1,341,330,431.80	-1,233,198,593.97	108,131,837.83
本期基金份额交易产生的变动数	-236,277,329.49	8,176,977.08	-228,100,352.41
其中：基金申购款	293,044,612.04	-1,658,979.42	291,385,632.62
基金赎回款	-529,321,941.53	9,835,956.50	-519,485,985.03
本期已分配利润	-375,691,536.01	-	-375,691,536.01

本期末	4,293,487,952.00	-1,087,739,091.41	3,205,748,860.59
-----	------------------	-------------------	------------------

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	825,815.05
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	29,808.88
其他	7,207.13
合计	862,831.06

## 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	5,622,831,500.41
减：卖出股票成本总额	4,238,885,903.40
买卖股票差价收入	1,383,945,597.01

## 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	6,311,134.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,900,000.00
减：应收利息总额	14,919.68
买卖债券差价收入	1,396,215.23

## 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,359,090.59
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	16,359,090.59

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-1,233,198,593.97
——股票投资	-1,234,898,435.55
——债券投资	1,699,841.58
——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	-1,233,198,593.97

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	306,690.64
其他	-
合计	306,690.64

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	14,723,110.64
银行间市场交易费用	625.00
合计	14,723,735.64

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	55,043.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	11,574.90
银行间账户维护费	18,000.00

其他	600.00
合计	144,726.18

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	743,770,345.67	7.20%	598,494,333.45	5.77%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广发证券	595,012.47	7.30%	479,911.98	9.11%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	478,793.97	5.32%	478,793.97	11.12%

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	40,080,694.36	40,755,034.28
其中：支付销售机构的客户维护费	8,251,825.17	6,611,490.27

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,680,115.68	6,792,505.66

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	229,418,587.42	825,815.05	361,270,842.23	1,176,667.32

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

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



发行					
上年度可比期间					
2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

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

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2021-02-08	-	2021-02-08	1.000	77,437,431.81	136,047,778.91	213,485,210.72	-
2	2021-02-24	-	2021-02-24	0.750	57,419,744.09	104,786,581.20	162,206,325.29	-
合计				1.750	134,857,175.90	240,834,360.11	375,691,536.01	-

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

				受限						
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
30095	恒辉	2021-0	2021-0	新股	11.72	27.08	340	3,984.	9,207.	-

2	安防	3-03	9-13	流通受限				80	20	
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-

300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-12-27	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股流通	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

				受限						
30101 2	扬电 科技	2021-0 6-15	2021-1 2-22	新股 流通 受限	8.05	24.26	170	1,368. 50	4,124. 20	-
30101 5	百洋 医药	2021-0 6-22	2021-1 2-30	新股 流通 受限	7.64	38.83	462	3,529. 68	17,939 .46	-
30101 6	雷尔 伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	新股 流通 受限	13.75	32.98	275	3,781. 25	9,069. 50	-
30101 7	漱玉 平民	2021-0 6-23	2021-0 7-05	新股 流通 受限	8.86	8.86	4,995	44,255 .70	44,255 .70	-
30101 7	漱玉 平民	2021-0 6-23	2022-0 1-05	新股 流通 受限	8.86	8.86	555	4,917. 30	4,917. 30	-
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 流通 受限	9.46	9.46	2,609	24,681 .14	24,681 .14	-
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股 流通 受限	9.46	9.46	290	2,743. 40	2,743. 40	-
60090 5	三峡 能源	2021-0 6-02	2021-1 2-10	新股 流通 受限	2.65	5.67	907,76 3	2,405, 571.95	5,147, 016.21	-
60528 7	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 流通 受限	31.56	31.56	349	11,014 .44	11,014 .44	-
68805 9	华锐 精密	2021-0 2-01	2021-0 8-09	新股 流通 受限	37.09	160.26	1,023	37,943 .07	163,94 5.98	-
68808 7	英科 再生	2021-0 6-30	2021-0 7-09	新股 流通 受限	21.96	21.96	2,469	54,219 .24	54,219 .24	-
68821 7	睿昂 基因	2021-0 5-07	2021-1 1-17	新股 流通 受限	18.42	58.40	1,040	19,156 .80	60,736 .00	-
68822 6	威腾 电气	2021-0 6-28	2021-0 7-07	新股 流通 受限	6.42	6.42	2,693	17,289 .06	17,289 .06	-
68869 0	纳微 科技	2021-0 6-16	2021-1 2-23	新股 流通 受限	8.07	79.89	3,477	28,059 .39	277,77 7.53	-
60080	新奥	2021-0	2021-0	非公	12.50	16.25	5,824,	72,800	94,640	-

3	股份	2-03	8-02	开发 行流 通受 限			000	,000.0 0	,000.0 0	
<b>6.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
12703 8	国微 转债	2021-0 6-10	2021-0 7-14	新发 流通 受限	100.00	100.00	11,040	1,104, 000.00	1,104, 000.00	-

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.18%(2020 年 12 月 31 日：0.14%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	130,396,095.89	0.00
合计	130,396,095.89	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

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

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	3,648,846.39	8,481,029.62
AAA 以下	6,030,918.43	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	9,679,764.82	8,481,029.62

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

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



### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	229,418,587.42	-	-	-	229,418,587.42
结算备付金	5,648,949.45	-	-	-	5,648,949.45
存出保证金	775,496.24	-	-	-	775,496.24
交易性金融资产	129,957,000.00	3,638,761.66	6,030,129.76	5,003,257,909.09	5,142,883,800.51
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	440,142.61	440,142.61
应收利息	-	-	-	475,419.37	475,419.37
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	520,811.06	520,811.06
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	365,800,033.11	3,638,761.66	6,030,129.76	5,004,694,282.13	5,380,163,206.66
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	-	-	-	16,598,308.94	16,598,308.94
应付管理人报酬	-	-	-	6,436,203.96	6,436,203.96
应付托管费	-	-	-	1,072,700.65	1,072,700.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,267,506.53	5,267,506.53
应交税费	-	-	-	690,206.55	690,206.55
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,250,573.04	1,250,573.04
负债总计	-	-	-	31,315,499.67	31,315,499.67
利率敏感度缺口	365,800,033.11	3,638,761.66	6,030,129.76	4,973,378,782.46	5,348,847,706.99
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	332,972,093.13	-	-	-	332,972,093.13
结算备付金	5,142,487.92	-	-	-	5,142,487.92
存出保证金	953,759.85	-	-	-	953,759.85
交易性金融资产	-	8,463,539.84	-	5,680,505,327.07	5,688,968,866.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,444,577.34	1,444,577.34

应收利息	-	-	-	57,957.55	57,957.55
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	594,520.26	594,520.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	339,068,340.90	8,463,539.84	-	5,682,602,382.22	6,030,134,262.96
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	-	-	-	33,150,659.36	33,150,659.36
应付管理人报酬	-	-	-	7,384,869.73	7,384,869.73
应付托管费	-	-	-	1,230,811.61	1,230,811.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,446,214.05	2,446,214.05
应交税费	-	-	-	690,306.60	690,306.60
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,514,785.04	1,514,785.04
负债总计	-	-	-	46,417,646.39	46,417,646.39
利率敏感度缺口	339,068,340.90	8,463,539.84	-	5,636,184,735.83	5,983,716,616.57

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	275,661.51	-
	2.市场利率上升25个基点	-274,492.20	-

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,003,257,909.09	93.54	5,680,505,327.07	94.93
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	5,003,257,909.09	93.54	5,680,505,327.07	94.93

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	400,565,900.20	454,610,329.14
2.业绩比较基准下降 5%	-400,565,900.20	-454,610,329.14	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 4,907,991,323.09 元，属于第二层次的余额为 234,892,477.42 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 5,609,186,694.62 元，第二层次 79,782,172.29 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,003,257,909.09	92.99
	其中：股票	5,003,257,909.09	92.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	139,625,891.42	2.60
	其中：债券	139,625,891.42	2.60
	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	235,067,536.87	4.37
8	其他各项资产	2,211,869.28	0.04
9	合计	5,380,163,206.66	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	59,250,616.20	1.11
C	制造业	3,867,379,231.11	72.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	99,791,932.61	1.87
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	315,648.66	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	24,601,164.50	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	141,092,237.21	2.64
J	金融业	528,590,931.97	9.88
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	99,029,698.90	1.85
M	科学研究和技术服务业	183,139,364.73	3.42
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,003,257,909.09	93.54

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002129	中环股份	6,000,003	231,600,115.80	4.33
2	600036	招商银行	4,227,100	229,066,549.00	4.28
3	000661	长春高新	535,590	207,273,330.00	3.88
4	002142	宁波银行	5,179,611	201,849,440.67	3.77
5	603259	药明康德	1,169,547	183,139,364.73	3.42
6	600309	万华化学	1,430,994	155,720,767.08	2.91
7	300014	亿纬锂能	1,449,746	150,672,101.78	2.82
8	002185	华天科技	9,456,700	145,538,613.00	2.72
9	002153	石基信息	6,000,113	141,062,656.63	2.64
10	300623	捷捷微电	3,600,091	136,191,442.53	2.55
11	603678	火炬电子	2,000,079	135,005,332.50	2.52
12	600519	贵州茅台	59,300	121,962,310.00	2.28
13	002384	东山精密	5,499,950	114,618,958.00	2.14
14	002049	紫光国微	700,000	107,933,000.00	2.02
15	688598	金博股份	400,000	107,600,000.00	2.01
16	300655	晶瑞股份	2,799,905	102,168,533.45	1.91
17	601012	隆基股份	1,130,516	100,435,041.44	1.88
18	000100	TCL 科技	13,000,000	99,450,000.00	1.86
19	601888	中国中免	329,989	99,029,698.90	1.85
20	300415	伊之密	4,599,960	98,899,140.00	1.85
21	000001	平安银行	4,316,460	97,638,325.20	1.83
22	002409	雅克科技	1,200,000	97,200,000.00	1.82
23	600803	新奥股份	5,824,000	94,640,000.00	1.77
24	300737	科顺股份	2,999,999	94,319,968.56	1.76

25	688388	嘉元科技	999,942	90,954,724.32	1.70
26	002876	三利谱	1,399,726	90,562,272.20	1.69
27	603185	上机数控	500,000	89,475,000.00	1.67
28	002850	科达利	1,000,000	87,400,000.00	1.63
29	002709	天赐材料	800,050	85,269,329.00	1.59
30	603833	欧派家居	600,000	85,176,000.00	1.59
31	002056	横店东磁	6,499,966	84,499,558.00	1.58
32	002859	洁美科技	2,700,060	84,430,876.20	1.58
33	002271	东方雨虹	1,460,800	80,811,456.00	1.51
34	688005	容百科技	650,059	78,787,150.80	1.47
35	000786	北新建材	1,800,079	70,653,100.75	1.32
36	000858	五粮液	235,150	70,048,833.50	1.31
37	300037	新宙邦	660,000	66,066,000.00	1.24
38	000725	京东方 A	10,000,000	62,400,000.00	1.17
39	600522	中天科技	6,000,000	60,000,000.00	1.12
40	601225	陕西煤业	5,000,052	59,250,616.20	1.11
41	688300	联瑞新材	900,000	55,800,000.00	1.04
42	688016	心脉医疗	120,000	54,553,200.00	1.02
43	603378	亚士创能	899,882	49,511,507.64	0.93
44	603338	浙江鼎力	823,424	48,326,754.56	0.90
45	300699	光威复材	629,863	47,838,094.85	0.89
46	300408	三环集团	1,100,000	46,662,000.00	0.87
47	300122	智飞生物	220,000	41,080,600.00	0.77
48	000333	美的集团	543,700	38,803,869.00	0.73
49	002572	索菲亚	1,500,000	36,300,000.00	0.68
50	600563	法拉电子	180,000	28,504,800.00	0.53
51	605499	东鹏饮料	101,564	25,472,251.20	0.48
52	002352	顺丰控股	363,385	24,601,164.50	0.46
53	600905	三峡能源	907,803	5,147,270.61	0.10
54	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.01
55	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
56	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
57	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.00
58	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
59	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
60	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.00
61	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
62	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
63	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
64	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
65	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
66	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
67	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
68	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00



69	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
70	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
71	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
72	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
73	300628	亿联网络	164	13,743.20	0.00
74	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
75	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
76	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
77	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
78	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
79	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
80	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
81	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
82	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
83	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
84	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
85	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
86	300925	法本信息	353	9,280.37	0.00
87	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
88	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
89	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
90	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
91	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
92	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
93	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
94	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
95	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
96	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
97	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
98	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
99	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
100	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
101	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
102	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
103	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
104	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
105	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
106	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
107	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
108	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
109	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
110	301007	德迈仕	322	4,766.15	0.00
111	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
112	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00

113	300998	宁波方正	203	4,347.24	0.00
114	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
115	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
116	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
117	601688	华泰证券	120	1,896.00	0.00
118	600967	内蒙一机	78	789.36	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000661	长春高新	216,581,945.58	3.62
2	002352	顺丰控股	204,069,814.32	3.41
3	002129	中环股份	172,200,271.84	2.88
4	000858	五粮液	167,519,894.48	2.80
5	002049	紫光国微	162,233,828.48	2.71
6	300014	亿纬锂能	149,704,210.25	2.50
7	603259	药明康德	140,187,531.93	2.34
8	603317	天味食品	138,341,849.41	2.31
9	603678	火炬电子	124,127,677.88	2.07
10	002185	华天科技	123,265,388.46	2.06
11	600803	新奥股份	121,169,419.00	2.02
12	600519	贵州茅台	117,504,560.92	1.96
13	300623	捷捷微电	112,381,393.31	1.88
14	600309	万华化学	110,538,509.50	1.85
15	601888	中国中免	108,171,733.74	1.81
16	300737	科顺股份	105,435,763.96	1.76
17	000100	TCL 科技	103,716,364.14	1.73
18	002384	东山精密	103,069,671.94	1.72
19	000001	平安银行	101,348,485.02	1.69
20	603833	欧派家居	92,543,799.57	1.55

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002410	广联达	287,857,368.55	4.81
2	600845	宝信软件	264,884,732.07	4.43
3	600588	用友网络	235,738,284.06	3.94

4	600570	恒生电子	231,606,995.92	3.87
5	603737	三棵树	231,279,801.77	3.87
6	603960	克来机电	220,656,016.21	3.69
7	002241	歌尔股份	202,797,824.09	3.39
8	300113	顺网科技	198,521,948.21	3.32
9	603338	浙江鼎力	197,388,092.49	3.30
10	601012	隆基股份	183,102,507.54	3.06
11	300454	深信服	171,028,890.88	2.86
12	002568	百润股份	168,475,941.18	2.82
13	603666	亿嘉和	167,265,784.40	2.80
14	300059	东方财富	164,671,070.35	2.75
15	002153	石基信息	160,562,564.55	2.68
16	000333	美的集团	158,158,137.91	2.64
17	300628	亿联网络	152,772,692.38	2.55
18	000001	平安银行	151,399,121.31	2.53
19	002352	顺丰控股	150,219,349.95	2.51
20	603786	科博达	148,282,141.91	2.48
21	002050	三花智控	147,582,057.91	2.47
22	600036	招商银行	140,958,014.36	2.36
23	600176	中国巨石	131,619,085.29	2.20
24	688008	澜起科技	126,882,628.25	2.12
25	000858	五粮液	123,874,073.18	2.07

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,796,536,920.97
卖出股票收入（成交）总额	5,622,831,500.41

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	129,957,000.00	2.43

	其中：政策性金融债	129,957,000.00	2.43
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）	9,668,891.42	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	139,625,891.42	2.61

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210304	21 进出 04	700,000	69,951,000.00	1.31
2	210206	21 国开 06	600,000	60,006,000.00	1.12
3	123115	捷捷转债	34,072	4,926,129.76	0.09
4	120003	19 华菱 EB	15,296	2,151,994.24	0.04
5	127038	国微转债	11,040	1,104,000.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 7170 万元的行政处罚决定：1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；3、理财产品之间风险隔离不到位；4、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；5、同业投资接受第三方金融机构信用担保；6、理财资金池化运作；7、利用理财产品准备金调节收益；8、高净值客户认定不审慎；9、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；10、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；11、投资集合资金信托计划人数超限；12、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；13、信贷资产非真实转让；14、全权委托业务不规范；15、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；16、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；17、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；18、票据转贴现假卖断屡查屡犯；19、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；20、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，

向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；21、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；22、理财资金认购商业银行增发的股票；23、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；24、为定制公募基金提供投资顾问；25、为本行承销债券兑付提供资金支持；26、协助发行人以非市场化的价格发行债券；27、瞒报案件信息。

2020年10月16日，宁波银保监局对宁波银行作出“罚款人民币30万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚。违法违规事由：授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位。

2021年6月10日，宁波银保监局对宁波银行作出“罚款人民币25万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚。违法违规事由：代理销售保险不规范

本基金投资招商银行、宁波银行的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	775,496.24
2	应收证券清算款	440,142.61
3	应收股利	-
4	应收利息	475,419.37
5	应收申购款	520,811.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,211,869.28

#### 7.12.4 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	132014	18 中化 EB	679,259.40	0.01
2	132021	19 中电 EB	444,174.50	0.01

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
152,715	14,033.32	10,152,892.92	0.47%	2,132,945,953.48	99.53%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	216,862.72	0.0101%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2007 年 4 月 2 日）基金份额总额	10,874,939,465.41
本报告期期初基金份额总额	2,282,307,705.39
本报告期基金总申购份额	187,021,994.39
减：本报告期基金总赎回份额	326,230,853.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,143,098,846.40

**10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。



## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	369,604,682.35	3.58%	295,683.19	3.63%	-
中金公司	2	681,197,833.64	6.59%	544,957.95	6.68%	-
国泰君安	1	594,640,973.56	5.75%	475,712.73	5.83%	-
中金财富	1	450,770,658.77	4.36%	360,616.54	4.42%	-
浙商证券	1	118,425,399.55	1.15%	94,740.56	1.16%	-
华西证券	1	334,566,479.64	3.24%	267,653.27	3.28%	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	77,610,949.28	0.75%	62,088.85	0.76%	-
瑞银证券	1	81,505,107.05	0.79%	65,204.09	0.80%	-
中信建投	2	316,063,648.10	3.06%	252,850.25	3.10%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	446,955,933.17	4.33%	357,564.74	4.39%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	1,217,093,292.16	11.78%	973,674.64	11.94%	-
东方证券	1	200,746,267.56	1.94%	160,596.94	1.97%	-
兴业证券	2	466,751,423.54	4.52%	373,401.16	4.58%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	640,601,735.91	6.20%	512,480.82	6.28%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	8,707,354.55	0.08%	5,224.41	0.06%	-
中泰证券	2	1,126,810,867.95	10.90%	901,448.69	11.06%	-
中银国际	1	121,748,640.38	1.18%	97,398.36	1.19%	-
东北证券	1	555,698,416.69	5.38%	333,421.05	4.09%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

中信证券华南	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	30,040,742.64	0.29%	24,032.59	0.29%	-
华创证券	2	1,750,465,766.47	16.94%	1,400,374.72	17.17%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	743,770,345.67	7.20%	595,012.47	7.30%	-

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广发证券股份有限公司、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。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	2,252,716.58	35.71%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	1,818,642.70	28.83%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东北证券	2,236,990.00	35.46%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加东方财富证券为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-12
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-01-21
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配新奥股份（600803）非公开发行 A 股的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-05
5	易方达价值成长混合型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2021-02-05

	公告	电子披露网站	
6	易方达基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021-02-08
7	易方达价值成长混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-08
8	易方达价值成长混合型证券投资基金恢复机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-08
9	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加腾安基金为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-10
10	易方达价值成长混合型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-23
11	易方达价值成长混合型证券投资基金分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-24
12	易方达价值成长混合型证券投资基金恢复机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-24
13	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	上海证券报	2021-03-30
14	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
15	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-04-19
16	易方达价值成长混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-29

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达价值成长混合型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达价值成长混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达价值成长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和营业执照。

## 11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

## 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日