

**易方达优质精选混合型证券投资基金**  
**(原易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册)**  
**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。

自2021年9月10日起原易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金，基金代码(110011)保持不变。原易方达中小盘混合型证券投资基金本报告期自2021年1月1日至2021年9月9日止，易方达优质精选混合型证券投资基金本报告期自2021年9月10日至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.1.1 易方达优质精选混合型证券投资基金.....	6
2.1.2 易方达中小盘混合型证券投资基金.....	6
2.2 基金产品说明.....	7
2.2.1 易方达优质精选混合型证券投资基金.....	7
2.2.2 易方达中小盘混合型证券投资基金.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	8
2.5 信息披露方式.....	8
2.6 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	16
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	16
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	18
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
<b>§6 审计报告</b> .....	22
6.1 易方达优质精选混合型证券投资基金.....	22
6.1.1 审计意见.....	22
6.1.2 形成审计意见的基础.....	22
6.1.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	22
6.1.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	23
6.2 易方达中小盘混合型证券投资基金.....	24
6.2.1 审计意见.....	24
6.2.2 形成审计意见的基础.....	24
6.2.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	24

6.2.4 注册会计师对财务报表审计的责任 .....	25
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>26</b>
7.1 易方达优质精选混合型证券投资基金 .....	26
7.1.1 资产负债表 .....	26
7.1.2 利润表 .....	27
7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	28
7.1.4 报表附注 .....	29
7.2 易方达中小盘混合型证券投资基金 .....	56
7.2.1 资产负债表 .....	56
7.2.2 利润表 .....	58
7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	59
7.2.4 报表附注 .....	60
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>90</b>
8.1 易方达优质精选混合型证券投资基金 .....	90
8.1.1 期末基金资产组合情况 .....	90
8.1.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 .....	91
8.1.3 期末按行业分类的权益投资组合 .....	91
8.1.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	92
8.1.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	100
8.1.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	103
8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	103
8.1.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	103
8.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	103
8.1.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	103
8.1.11 投资组合报告附注 .....	103
8.2 易方达中小盘混合型证券投资基金 .....	104
8.2.1 期末基金资产组合情况 .....	104
8.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	104
8.2.3 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 .....	105
8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	108
8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	109
8.2.6 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 .....	109
8.2.7 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 .....	109
8.2.8 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 .....	109
8.2.9 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 .....	109
8.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	110
8.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	110
8.2.12 投资组合报告附注 .....	110
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>111</b>
9.1 易方达优质精选混合型证券投资基金 .....	111
9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	111
9.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	111
9.1.3 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 .....	111
9.2 易方达中小盘混合型证券投资基金 .....	111
9.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	111

9.2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	112
9.2.3 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 .....	112
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	112
10.1 易方达优质精选混合型证券投资基金 .....	112
10.2 易方达中小盘混合型证券投资基金 .....	112
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	113
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	113
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 .....	113
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	113
11.4 基金投资策略的改变 .....	113
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	114
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 .....	114
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	114
11.8 其他重大事件 .....	118
<b>§12 备查文件目录</b> .....	121
12.1 备查文件目录 .....	121
12.2 存放地点 .....	122
12.3 查阅方式 .....	122

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

基金名称	易方达优质精选混合型证券投资基金
基金简称	易方达优质精选混合(QDII)
基金主代码	110011
交易代码	110011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年9月10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	2,791,221,583.39 份
基金合同存续期	不定期

注：根据2021年9月10日发布的《易方达基金管理有限公司关于易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会同意将基金名称由“易方达中小盘混合型证券投资基金”变更为“易方达优质精选混合型证券投资基金”，将投资范围扩大为包括内地市场上市交易的企业、香港市场挂牌交易的企业，相应调整基金投资策略和投资比例限制、业绩比较基准、开放日安排、估值条款、基金费用条款、收益分配政策等，并相应修订基金合同等法律文件。

#### 2.1.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

基金名称	易方达中小盘混合型证券投资基金
基金简称	易方达中小盘混合
基金主代码	110011
交易代码	110011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月19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	3,043,094,297.36 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

### 2.2.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

投资目标	本基金主要通过精选优质企业，力求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。
投资策略	资产配置方面，本基金结合宏观经济与市场分析，评估各类资产的预期收益与风险，在基金合同约定的范围内，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。股票投资方面，本基金基于深度的研究分析，在内地和香港市场精选具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的优质企业；本基金投资存托凭证的策略依照上述股票投资策略执行。其他投资策略方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资；可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上进行资产支持证券投资；根据风险管理的原则并综合考虑多种因素，可投资股指期货、国债期货、股票期权；可在符合有关法律法规、严格控制风险的前提下，进行证券借贷交易、回购交易、融资交易等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证香港 300 指数收益率×30%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 本基金可投资港股通股票以及港股通以外的香港市场挂牌交易的股票，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、股价波动较大的风险等投资于香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有风险。本基金投资香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有风险详见招募说明书。

### 2.2.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

投资目标	通过投资具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票，力求在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，进行战术性资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，追求更高收益，回避市场风险。在股票资产方面，本基金采取“自下而上”的策略，

	投资具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的中小盘股票。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	45%×天相中盘指数收益率+35%×天相小盘指数收益率+20%×中债总指数收益率
风险收益特征	本基金是混合基金，理论上其风险收益水平高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。

### 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 境外投资顾问和境外资产托管人

#### 2.4.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	无	中国银行(香港)有限公司
注册地址		无	香港中环花园道一号，中银大厦 12 楼
办公地址		无	香港中环花园道一号，中银大厦 32 楼
邮政编码		无	无

### 2.5 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
登载基金年度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



## 2.6 其他相关资料

### 2.6.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

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

### 2.6.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

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	报告期(2021年9月10日(基金合同生效日)至2021年12月31日)	报告期(2021年1月1日至2021年9月9日)	2020年	2019年
本期已实现收益	-3,225,764,307.38	13,464,500,524.10	5,566,337,040.85	564,940,545.90
本期利润	-657,226,079.16	-3,324,851,815.69	15,031,666,411.37	6,452,259,829.33
加权平均基金份额本期利润	-0.2256	-0.8718	4.3098	2.0461
本期加权平均净值利润率	-3.08%	-10.49%	66.43%	43.55%
本期基金份额净值	-3.10%	-10.72%	84.34%	65.34%

增长率				
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2021 年末</b>	<b>报告期末(2021 年 9 月 9 日)</b>	<b>2020 年末</b>	<b>2019 年末</b>
期末可供分配利润	12,411,633,605.98	16,785,180,259.56	13,545,960,944.55	5,601,229,686.89
期末可供分配基金份额利润	4.4467	5.5158	3.0883	1.4903
期末基金资产净值	19,983,661,526.50	22,485,046,298.65	40,110,640,052.62	18,644,573,119.33
期末基金份额净值	7.1595	7.3889	9.1448	4.9607
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2021 年末</b>	<b>报告期末(2021 年 9 月 9 日)</b>	<b>2020 年末</b>	<b>2019 年末</b>
基金份额累计净值增长率	-3.10%	925.27%	1,048.42%	522.97%

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。

4.自 2021 年 9 月 10 日起原易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金，易方达优质精选混合型证券投资基金合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

##### 3.2.1.1 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
过去三个月	-1.25%	1.20%	-1.12%	0.62%	-0.13%	0.58%

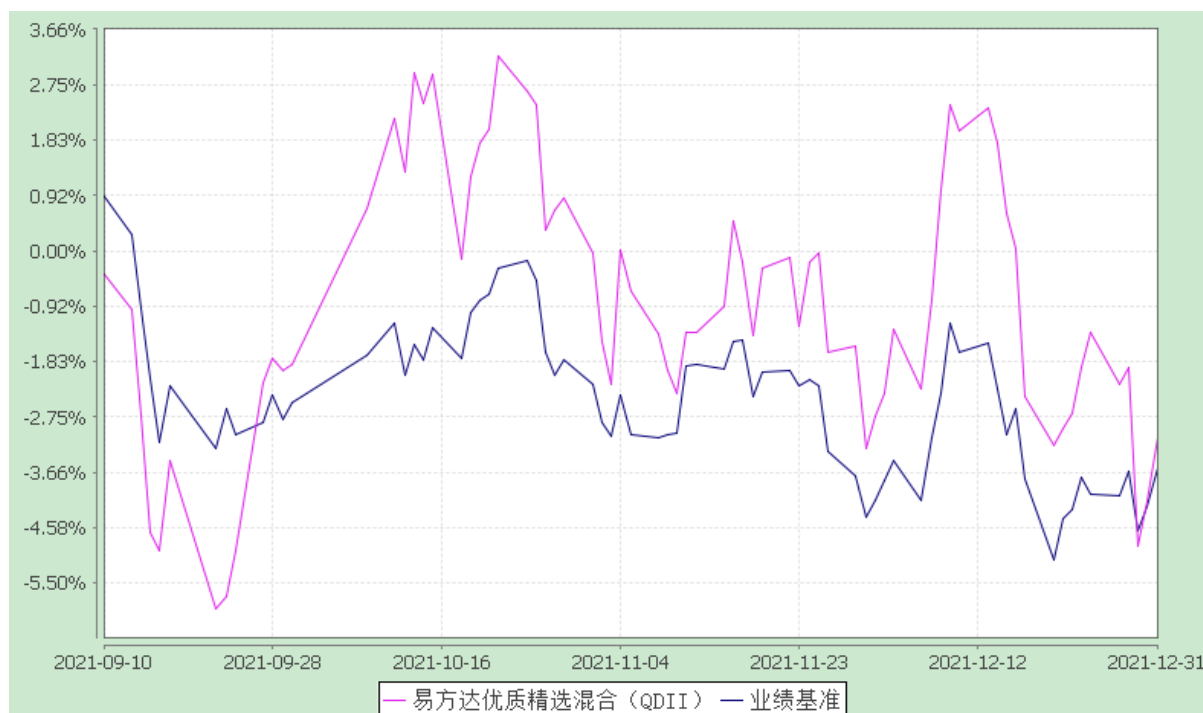
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-3.10%	1.24%	-3.60%	0.66%	0.50%	0.58%

注：自2021年9月10日起，本基金业绩比较基准为“沪深300指数收益率×50%+中证香港300指数收益率×30%+中债总指数收益率×20%”。

### 3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达优质精选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  
(2021年9月10日(基金合同生效日)至2021年12月31日)



注：1.本基金由原易方达中小盘混合型证券投资基金于2021年9月10日变更注册而来，截至报告期末，本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十一部分二、投资范围，四、投资策略和五、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.自2021年9月10日起，本基金业绩比较基准为“沪深300指数收益率×50%+中证香港300指数收益率×30%+中债总指数收益率×20%”。

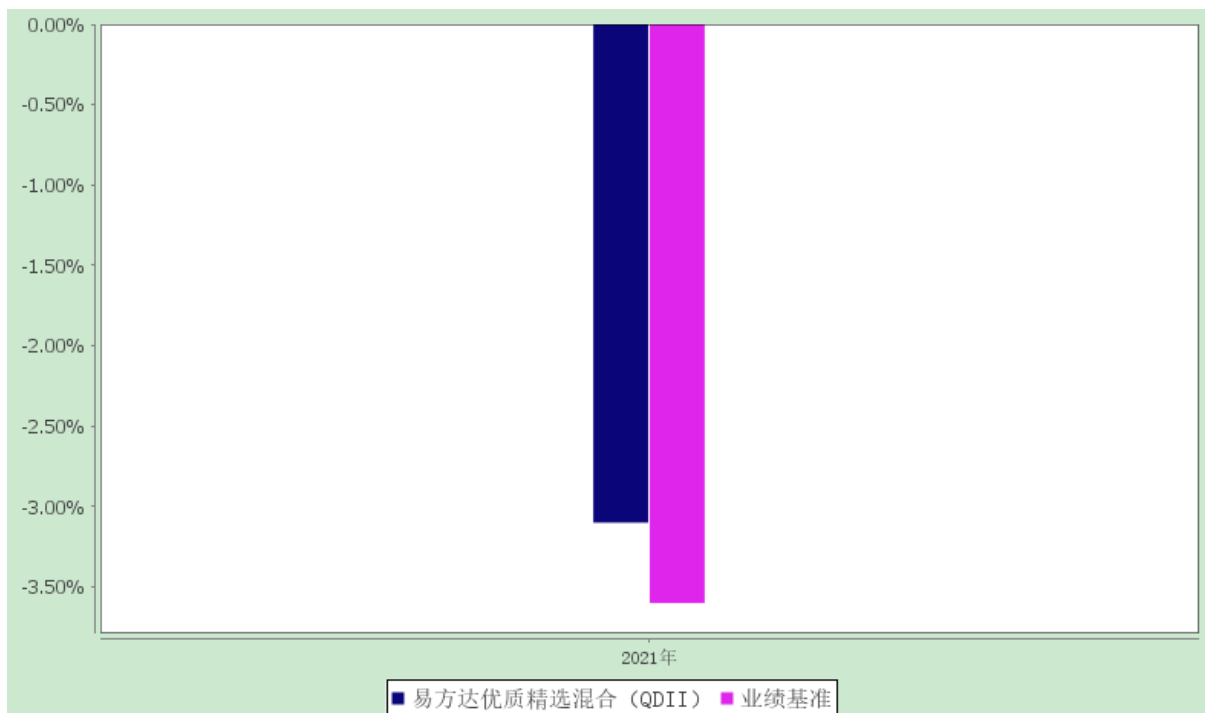
4.自基金变更注册至报告期末，基金份额净值增长率为-3.10%，同期业绩比较基准收益率为

-3.60%。

### 3.2.1.3 自基金转型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

易方达优质精选混合型证券投资基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：1.自2021年9月10日起原易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金，易方达优质精选混合型证券投资基金合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自2021年9月10日起，本基金业绩比较基准为“沪深300指数收益率×50%+中证香港300指数收益率×30%+中债总指数收益率×20%”。

### 3.2.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

#### 3.2.2.1 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
过去三个月	-8.58%	1.09%	4.68%	0.94%	-13.26%	0.15%
过去六个月	-6.29%	1.12%	13.03%	0.80%	-19.32%	0.32%
过去一年	13.93%	1.47%	16.60%	0.92%	-2.67%	0.55%
过去三年	130.69%	1.59%	49.74%	1.14%	80.95%	0.45%
过去五年	237.92%	1.42%	24.70%	1.02%	213.22%	0.40%
自基金合同生	925.27%	1.45%	96.99%	1.35%	828.28%	0.10%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

注：过去三个月：2021年7月1日-2021年9月9日；

过去六个月：2021年4月1日-2021年9月9日；

过去一年：2020年10月1日-2021年9月9日；

过去三年：2018年10月1日-2021年9月9日；

过去五年：2016年10月1日-2021年9月9日；

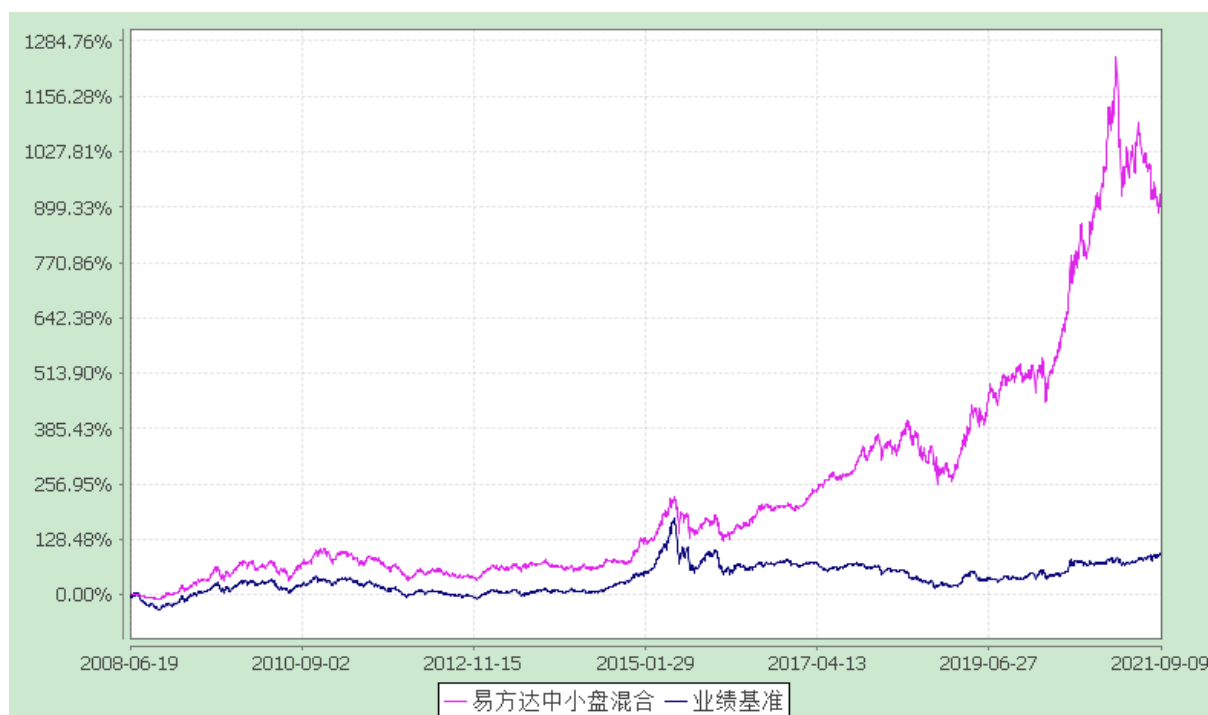
自基金合同生效起至今：2008年6月19日-2021年9月9日。

### 3.2.2.2 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

易方达中小盘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

(2008年6月19日至2021年9月9日)

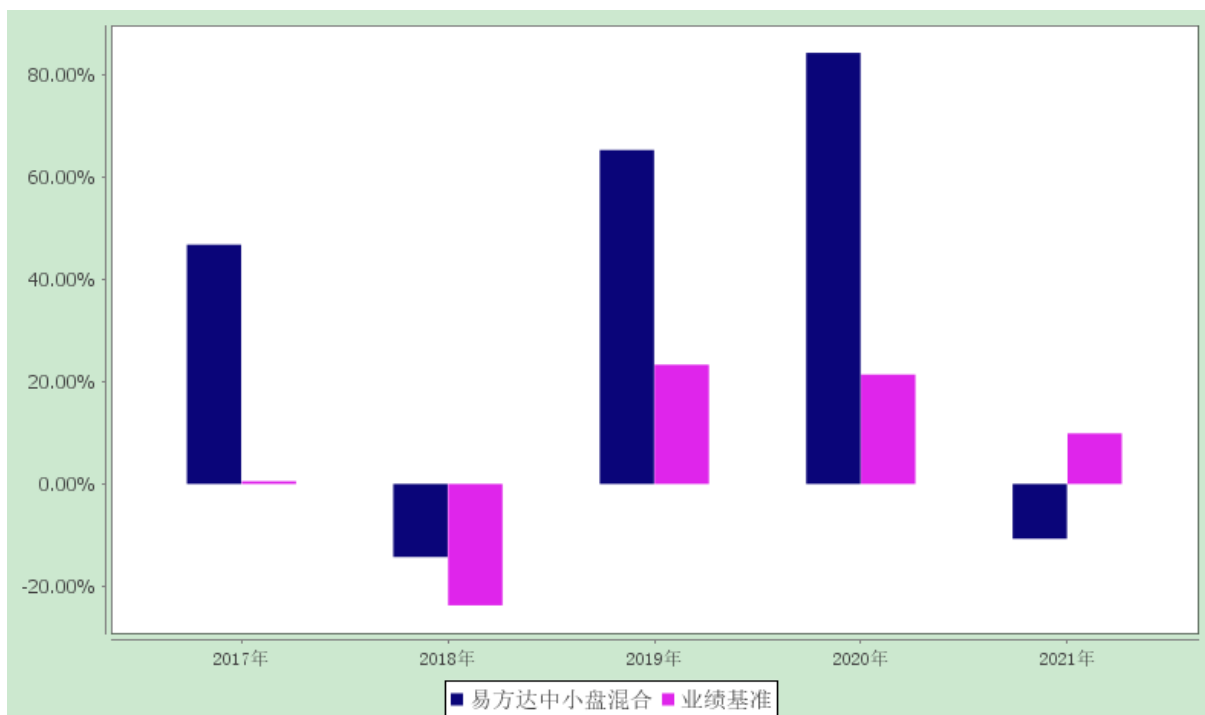


注：自基金合同生效至2021年9月9日，基金份额净值增长率为925.27%，同期业绩比较基准收益率为96.99%。

### 3.2.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中小盘混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：自2021年9月10日起原易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金，基金变更注册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

#### 3.3.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

本基金自基金合同生效日（2021年9月10日）至本报告期末未发生利润分配。

#### 3.3.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2021年1月1日至2021年9月9日	9.000	2,254,647,639.63	1,686,052,480.12	3,940,700,119.75	-
合计	9.000	2,254,647,639.63	1,686,052,480.12	3,940,700,119.75	-

## §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

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

##### 4.1.2.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

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		
张坤	本基金的基金经理、易方达亚洲精选股票型证券投资基金的基金经理、易方达蓝筹精选混合型证券投资基金的基金经理、易方达优质企业三年持有期混合型证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、权益投资决策委员会委员	2021-09-10	-	13 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、基金经理助理、研究部总经理助理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达中小盘混合型证券投资基金基金经理

注：1.上表报告期：2021年9月10日-2021年12月31日。

2.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。

3.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。

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

##### 4.1.2.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

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		
张坤	本基金的基金	2012-09-2	2021-09-10	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。

	经理、易方达亚洲精选股票型证券投资基金的基金经理、易方达新丝路灵活配置混合型证券投资基金的基金经理（自2015年11月07日至2021年02月10日）、易方达蓝筹精选混合型证券投资基金的基金经理、易方达优质企业三年持有期混合型证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、权益投资决策委员会委员	8			曾任易方达基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理、研究部总经理助理
--	--	---	--	--	------------------------------------

注：1.上表报告期：2021年1月1日-2021年9月9日。

2.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。

3.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。

4.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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 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。



## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 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。

对于公司旗下基金在境外的投资交易行为,公司制定了相应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,通过投资交易系统内的公平交易模块,并结合境外市场的交易特点规范交易委托方式,以尽可能确保公平对待各投资组合。

### 4.4.2 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。

#### 4.4.3 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。

#### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年，A股市场呈现结构分化，沪深300指数下跌5.20%，上证综指上涨4.80%，而创业板指数上涨12.02%。香港市场震荡下跌，恒生指数下跌14.08%，恒生中国企业指数下跌23.30%。

2021年，货币政策保持较为宽松的状态，经济方面，随着下半年地产销售转弱，以及部分民营企业出现信用风险，经济面临一定的下行压力。全球来看，随着疫苗的接种，各国的企业经营活动也开始缓慢恢复。股票市场方面，市场分化较为明显，电力设备、有色金属、煤炭、基础化工、钢铁等行业表现较好，而非银金融、家电等行业表现相对落后。

2021年，在各位持有人的支持下，本基金完成了合同变更。我们认为，新的合同将有助于我们在更广阔的范围内，寻找并投资优质的上市公司股权。本基金在2021年股票仓位略有提升，并对结构进行了调整。行业方面，增加了金融、科技等行业的配置，降低了医药、家电等行业的配置；个股方面，增加了业务模式有特色、长期逻辑清晰、估值水平合理的个股的投资比例。

##### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2021年12月31日，易方达优质精选混合型证券投资基金份额净值为7.1595元，本报告期(2021年9月10日—2021年12月31日)份额净值增长率为-3.10%，同期业绩比较基准收益率为-3.60%。

2021年9月9日，原易方达中小盘混合型证券投资基金份额净值为7.3889元，本报告期(2021年1月1日—2021年9月9日)份额净值增长率为-10.72%，同期业绩比较基准收益率为9.89%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们始终相信，企业的价值是其生命周期内所有自由现金流的折现。从年度来看，自由现金流往往受到资本开支节奏、运营资本波动等因素的影响，经常呈现出较大的波动。因此，投资者经常用净利润（及其增速）或者收入（及其增速），甚至产能（及其增速）作为近似变量进行估值。这在一定程度上是合理的，因为自由现金流的转化过程为“收入->净利润->自由现金流”。然而无法忽视的是，既然是近似变量，就无法做到100%代表。上述的每一步转化都可能出现不顺畅的情况。例如，从收入到净利润的转化可能会受到竞争加剧的影响，呈现增收不增利的情况；从净利润到自由现金

流的转化可能会受到资本开支过大但最终利用率不足、运营资本占用越来越多等因素的影响。因此，当我们习惯了用收入、净利润这些代理变量对企业进行估值时，还需要考虑这些代理变量向自由现金流这个本质变量转化过程中的潜在不顺畅可能。我想，这可能也是亚马逊号召其投资者直接关注其自由现金流的原因之一。

因此，我们在研究公司时，自由现金流始终是我们最关注的财务指标之一。虽然年度之间会有波动，但拉长到 5-10 年的维度，一个公司能否为股东创造充沛的自由现金流并不难分辨。进一步从底层来说，一个企业生产的产品多大程度被其客户所渴望，是否具有优秀的商业模式、是否具有护城河使其在长周期内维持良好的竞争格局，这些都是使收入能够顺畅转化为净利润然后转化为自由现金流的重要决定因素。

作为管理人，我们始终感受肩上的责任重大。基金的资产属于每位持有人，对于每位持有人，实际上持有的是基金持有的上市公司股权的一部分。我们会始终与持有人站在一起，力争找到一部分优质的上市公司，其能产生充沛的自由现金流，并且产生的自由现金流能随时间增长。这样才能使公司的股权价值随着时间增长，继而在足够长的时间内，最终体现到基金的净值增长中。

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

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

(6) 全面落实《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》等最新反洗钱法规与监管要求，下大力气完善提升洗钱风险管理体系和内控机制：进一步修订制度流程、充实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，健全洗钱风险自评估工作机制方法，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，不断提高反洗钱合规和风险管理水平，推动反洗钱工作以风险为本向纵深发展。

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

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

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

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

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

#### 4.8 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。

#### **4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

##### **4.9.1 易方达优质精选混合型证券投资基金**

本基金本报告期内未实施利润分配。

##### **4.9.2 易方达中小盘混合型证券投资基金**

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 3,940,700,119.75 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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

### 6.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

普华永道中天审字(2022)第 25220 号

易方达优质精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人:

#### 6.1.1 审计意见

##### (一)我们审计的内容

我们审计了易方达优质精选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 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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,公允反映了易方达优质精选混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.1.2 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,我们独立于易方达优质精选混合型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

#### 6.1.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达优质精选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优质精选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优质精选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优质精选混合型证券投资基金的财务报告过程。

#### 6.1.4 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优质精选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优质精选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

## 6.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

普华永道中天审字(2022)第 25148 号

易方达中小盘混合型证券投资基金全体基金份额持有人:

### 6.2.1 审计意见

#### (一)我们审计的内容

我们审计了易方达中小盘混合型证券投资基金的财务报表,包括 2021 年 9 月 9 日(基金变更注册日前日)的资产负债表,2021 年 1 月 1 日至 2021 年 9 月 9 日(基金变更注册日前日)止期间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,公允反映了易方达中小盘混合型证券投资基金 2021 年 9 月 9 日(基金变更注册日前日)的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 9 月 9 日(基金变更注册日前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.2.2 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,我们独立于易方达中小盘混合型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.2.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达中小盘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中小盘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中小盘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中小盘混合型证券投资基金的财务报告过程。



#### 6.2.4 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中小盘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中小盘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 易方达优质精选混合型证券投资基金

## 7.1.1 资产负债表

会计主体：易方达优质精选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
资产：		
银行存款	7.1.4.7.1	1,092,103,991.73
结算备付金		4,507,373.70
存出保证金		7,431,917.08
交易性金融资产	7.1.4.7.2	18,977,792,150.71
其中：股票投资		18,977,792,150.71
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	7.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	-
应收证券清算款		69,576.48
应收利息	7.1.4.7.5	84,270.74
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.1.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>20,081,989,280.44</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		61,860,977.37

应付管理人报酬		26,260,604.80
应付托管费		4,376,767.47
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.1.4.7.7	5,514,994.58
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.1.4.7.8	314,409.72
<b>负债合计</b>		<b>98,327,753.94</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.1.4.7.9	2,791,221,583.39
未分配利润	7.1.4.7.10	17,192,439,943.11
<b>所有者权益合计</b>		<b>19,983,661,526.50</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>20,081,989,280.44</b>

注：1.本基金由原易方达中小盘混合型证券投资基金于2021年9月10日变更注册而来，2021年度实际报告期间为2021年9月10日至2021年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日2021年12月31日，基金份额净值7.1595元，基金份额总额2,791,221,583.39份。

### 7.1.2 利润表

会计主体：易方达优质精选混合型证券投资基金

本报告期：2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>-490,227,673.26</b>
1.利息收入		3,221,424.91
其中：存款利息收入	<b>7.1.4.7.11</b>	2,265,280.41
债券利息收入		1,423.40
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		954,721.10
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,058,101,188.61
其中：股票投资收益	<b>7.1.4.7.12</b>	-3,046,915,652.38

基金投资收益	<b>7.1.4.7.13</b>	-
债券投资收益	<b>7.1.4.7.14</b>	2,445,258.30
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	<b>7.1.4.7.15</b>	-
股利收益	<b>7.1.4.7.16</b>	-13,630,794.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	<b>7.1.4.7.17</b>	2,568,538,228.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-5,314,351.88
5.其他收入（损失以“-”号填列）	<b>7.1.4.7.18</b>	1,428,214.10
<b>减：二、费用</b>		<b>166,998,405.90</b>
1. 管理人报酬		99,312,840.91
2. 托管费		16,552,140.13
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	<b>7.1.4.7.19</b>	50,906,135.32
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		5.11
7. 其他费用	<b>7.1.4.7.20</b>	227,284.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-657,226,079.16</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-657,226,079.16</b>

注：本基金由原易方达中小盘混合型证券投资基金于2021年9月10日变更注册而来，2021年度实际报告期间为2021年9月10日至2021年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达优质精选混合型证券投资基金

本报告期：2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2021年9月10日（基金合同生效日）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）	3,043,094,297.36	19,441,952,001.29	22,485,046,298.65
二、本期经营活动产生	-	-657,226,079.16	-657,226,079.16

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	-251,872,713.97	-1,592,285,979.02	-1,844,158,692.99
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-251,872,713.97	-1,592,285,979.02	-1,844,158,692.99
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）	2,791,221,583.39	17,192,439,943.11	19,983,661,526.50

注：本基金由原易方达中小盘混合型证券投资基金于2021年9月10日变更注册而来，2021年度实际报告期间为2021年9月10日至2021年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1.1至7.1.4，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

## 7.1.4 报表附注

### 7.1.4.1 基金基本情况

易方达优质精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册而成。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[2021]2431号《关于准予易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册的批复》和基金管理人于2021年9月10日发布的《易方达基金管理有限公司关于易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金，并相应调整基金投资策略和投资比例限制、业绩比较基准、开放日安排、估值条款、基金费用条款、收益分配政策等，基金名称相应变更为“易方达优质精选混合型证券投资基金”。2021年9月10日起，原《易方达中小盘混合型证券投资基金基金合同》失效，《易方达优质精选混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)

有限公司。

#### 7.1.4.2 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》、《易方达优质精选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。

#### 7.1.4.3 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。

#### 7.1.4.4 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。

##### 7.1.4.4.1 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，惟本会计年度期间为 2021 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

##### 7.1.4.4.2 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。

##### 7.1.4.4.3 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、基金投资、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。

#### 7.1.4.4.4 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。

#### 7.1.4.4.5 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。

#### 7.1.4.4.6 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。

#### 7.1.4.4.7 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。

#### 7.1.4.4.8 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)。

#### 7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。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。

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。

#### 7.1.4.4.10 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。

#### 7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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) 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。

#### 7.1.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.1.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为

一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **7.1.4.4.14 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。

#### **7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.1.4.5.1 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。

##### **7.1.4.5.2 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。

##### **7.1.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无会计差错更正。

#### **7.1.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

#### 7.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.1.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
活期存款	1,092,103,991.73
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	1,092,103,991.73

#### 7.1.4.7.2 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	18,441,514,166.21	18,977,792,150.71	536,277,984.50
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	18,441,514,166.21	18,977,792,150.71	536,277,984.50

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

#### 7.1.4.7.3 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。

#### 7.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.1.4.7.4.1 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。

##### 7.1.4.7.4.2 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。

#### 7.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	78,898.14
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	2,028.30
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	-
其他	3,344.30
合计	84,270.74

#### 7.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 7.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	5,514,994.58
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,514,994.58

#### 7.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	64,409.72
预提费用	250,000.00
合计	314,409.72

#### 7.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年9月10日至2021年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	3,043,094,297.36	3,043,094,297.36
-基金份额折算调整	-	-

-未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-251,872,713.97	-251,872,713.97
本期末	2,791,221,583.39	2,791,221,583.39

注：1.本基金由原易方达中小盘混合型证券投资基金于2021年9月10日变更注册而来。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.1.4.7.10 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
基金合同生效日	16,785,180,259.56	2,656,771,741.73	19,441,952,001.29
本期利润	-3,225,764,307.38	2,568,538,228.22	-657,226,079.16
本期基金份额交易产生的变动数	-1,147,782,346.20	-444,503,632.82	-1,592,285,979.02
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,147,782,346.20	-444,503,632.82	-1,592,285,979.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,411,633,605.98	4,780,806,337.13	17,192,439,943.11

#### 7.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	1,190,481.73
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	956,388.85
其他	118,409.83
合计	2,265,280.41

#### 7.1.4.7.12 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9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日

	日
卖出股票成交总额	14,243,863,056.15
减：卖出股票成本总额	17,290,778,708.53
买卖股票差价收入	-3,046,915,652.38

#### 7.1.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 7.1.4.7.14 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9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,472,324.25
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,025,600.00
减：应收利息总额	1,465.95
买卖债券差价收入	2,445,258.30

#### 7.1.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 7.1.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	-13,630,794.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	-13,630,794.53

#### 7.1.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1.交易性金融资产	2,568,538,228.22
——股票投资	2,568,538,228.22
——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	2,568,538,228.22

**7.1.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	1,428,214.10
其他	-
合计	1,428,214.10

**7.1.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	50,906,135.32
银行间市场交易费用	-
其他	-
合计	50,906,135.32

**7.1.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	40,247.68



信息披露费	37,149.96
银行汇划费	40,586.79
银行间账户维护费	9,000.00
其他	100,300.00
合计	227,284.43

#### 7.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.1.4.8.1 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。

##### 7.1.4.8.2 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。

#### 7.1.4.9 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
中国银行(香港)有限公司	境外资产托管人
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。

#### 7.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.1.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.1.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.1.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.1.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

### 7.1.4.10.2 关联方报酬

#### 7.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	99,312,840.91
其中：支付销售机构的客户维护费	29,814,248.01

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	16,552,140.13

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 7.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.1.4.10.4.2 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。

#### 7.1.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年9月10日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	828,357,545.33	1,190,481.73
中银香港-活期存款	263,746,446.40	-

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和中国银行(香港)有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.1.4.10.6 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9月10日（基金合同生效日）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
中银国际	600941	中国移动	新股网上 发行	1,000	57,580.00

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。

#### 7.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.1.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

##### 7.1.4.12.1 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

7.1.4.12.1.1 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 CH	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 CH	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 CH	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 CH	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017 CH	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 CH	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 CH	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 CH	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-

30102 7 CH	华蓝 集团	2021-0 7-08	2022-0 1-19	新股 流通 受限	11.45	16.65	286	3,274. 70	4,761. 90	-
30102 8 CH	东亚 机械	2021-0 7-12	2022-0 1-20	新股 流通 受限	5.31	13.50	733	3,892. 23	9,895. 50	-
30102 9 CH	怡合 达	2021-0 7-14	2022-0 1-24	新股 流通 受限	14.14	89.87	462	6,532. 68	41,519. 94	-
30103 0 CH	仕净 科技	2021-0 7-15	2022-0 1-24	新股 流通 受限	6.10	31.52	242	1,476. 20	7,627. 84	-
30103 5 CH	润丰 股份	2021-0 7-21	2022-0 1-28	新股 流通 受限	22.04	56.28	644	14,193. .76	36,244. .32	-
30103 8 CH	深水 规院	2021-0 7-22	2022-0 2-07	新股 流通 受限	6.68	20.23	266	1,776. 88	5,381. 18	-
30103 9 CH	中集 车辆	2021-0 7-01	2022-0 1-10	新股 流通 受限	6.96	12.51	2,064	14,365. .44	25,820. .64	-
30104 0 CH	中环 海陆	2021-0 7-26	2022-0 2-07	新股 流通 受限	13.57	38.51	241	3,270. 37	9,280. 91	-
30104 1 CH	金百 泽	2021-0 8-02	2022-0 2-11	新股 流通 受限	7.31	28.21	215	1,571. 65	6,065. 15	-
30104 6 CH	能辉 科技	2021-0 8-10	2022-0 2-17	新股 流通 受限	8.34	48.99	290	2,418. 60	14,207. .10	-
30104 8 CH	金鹰 重工	2021-0 8-11	2022-0 2-28	新股 流通 受限	4.13	12.96	843	3,481. 59	10,925. .28	-
30104 9 CH	超越 科技	2021-0 8-17	2022-0 2-24	新股 流通 受限	19.34	32.92	196	3,790. 64	6,452. 32	-
30105 0 CH	雷电 微力	2021-0 8-17	2022-0 2-24	新股 流通 受限	60.64	234.74	233	14,129. .12	54,694. .42	-
30105 3 CH	远信 工业	2021-0 8-25	2022-0 3-01	新股 流通 受限	11.87	28.78	155	1,839. 85	4,460. 90	-
30105 5 CH	张小 泉	2021-0 8-26	2022-0 3-07	新股 流通	6.90	21.78	355	2,449. 50	7,731. 90	-

				受限						
30105 6 CH	森赫 股份	2021-0 8-27	2022-0 3-07	新股 流通 受限	3.93	11.09	572	2,247. 96	6,343. 48	-
30105 7 CH	汇隆 新材	2021-0 8-31	2022-0 3-09	新股 流通 受限	8.03	19.02	218	1,750. 54	4,146. 36	-
30105 8 CH	中粮 工科	2021-0 9-01	2022-0 3-09	新股 流通 受限	3.55	18.24	1,386	4,920. 30	25,280 .64	-
30105 9 CH	金三 江	2021-0 9-03	2022-0 3-14	新股 流通 受限	8.09	19.30	259	2,095. 31	4,998. 70	-
30106 0 CH	兰卫 医学	2021-0 9-06	2022-0 3-14	新股 流通 受限	4.17	30.94	587	2,447. 79	18,161 .78	-
30106 2 CH	上海 艾录	2021-0 9-07	2022-0 3-14	新股 流通 受限	3.31	17.01	523	1,731. 13	8,896. 23	-
30107 8 CH	孩子 王	2021-0 9-30	2022-0 4-14	新股 流通 受限	5.77	12.14	756	4,362. 12	9,177. 84	-
30107 9 CH	邵阳 液压	2021-1 0-11	2022-0 4-19	新股 流通 受限	11.92	24.82	140	1,668. 80	3,474. 80	-
30108 1 CH	严牌 股份	2021-1 0-13	2022-0 4-20	新股 流通 受限	12.95	17.44	403	5,218. 85	7,028. 32	-
30108 2 CH	久盛 电气	2021-1 0-14	2022-0 4-27	新股 流通 受限	15.48	21.53	915	14,164 .20	19,699 .95	-
30108 3 CH	百胜 智能	2021-1 0-13	2022-0 4-21	新股 流通 受限	9.08	14.21	416	3,777. 28	5,911. 36	-
30108 8 CH	戎美 股份	2021-1 0-19	2022-0 4-28	新股 流通 受限	33.16	24.67	704	23,344 .64	17,367 .68	-
30108 9 CH	拓新 药业	2021-1 0-20	2022-0 4-27	新股 流通 受限	19.11	67.93	220	4,204. 20	14,944 .60	-
30109 0 CH	华润 材料	2021-1 0-19	2022-0 4-26	新股 流通 受限	10.45	11.22	2,764	28,883 .80	31,012 .08	-
30109	深城	2021-1	2022-0	新股	36.50	31.31	524	19,126	16,406	-

1 CH	交	0-20	4-29	流通受限				.00	.44	
30109 3 CH	华兰 股份	2021-1 0-21	2022-0 5-05	新股 流通 受限	58.08	49.85	409	23,754 .72	20,388 .65	-
30109 6 CH	百诚 医药	2021-1 2-13	2022-0 6-20	新股 流通 受限	79.60	78.53	272	21,651 .20	21,360 .16	-
30109 8 CH	金埔 园林	2021-1 1-04	2022-0 5-12	新股 流通 受限	12.36	22.17	307	3,794. 52	6,806. 19	-
301111 CH	粤万 年青	2021-1 1-30	2022-0 6-07	新股 流通 受限	10.48	36.68	379	3,971. 92	13,901 .72	-
301118 CH	恒光 股份	2021-1 1-09	2022-0 5-18	新股 流通 受限	22.70	49.02	315	7,150. 50	15,441 .30	-
30113 3 CH	金钟 股份	2021-1 1-19	2022-0 5-26	新股 流通 受限	14.33	26.95	286	4,098. 38	7,707. 70	-
30113 8 CH	华研 精机	2021-1 2-08	2022-0 6-15	新股 流通 受限	26.17	44.86	285	7,458. 45	12,785 .10	-
30115 5 CH	海力 风电	2021-1 1-17	2022-0 5-24	新股 流通 受限	60.66	96.75	1,054	63,935 .64	101,97 4.50	-
30117 9 CH	泽宇 智能	2021-1 2-01	2022-0 6-08	新股 流通 受限	43.99	50.77	295	12,977 .05	14,977 .15	-
30118 0 CH	万祥 科技	2021-1 1-09	2022-0 5-16	新股 流通 受限	12.20	22.72	654	7,978. 80	14,858 .88	-
30119 3 CH	家联 科技	2021-1 2-02	2022-0 6-09	新股 流通 受限	30.73	29.14	297	9,126. 81	8,654. 58	-
30119 8 CH	喜悦 智行	2021-1 1-25	2022-0 6-02	新股 流通 受限	21.76	29.20	262	5,701. 12	7,650. 40	-
60094 1 CH	中国 移动	2021-1 2-27	2022-0 1-05	新股 流通 受限	57.58	57.58	1,000	57,580 .00	57,580 .00	-
68821 0 CH	统联 精密	2021-1 2-20	2022-0 6-27	新股 流通 受限	42.76	39.53	2,218	94,841 .68	87,677 .54	-

68829 6 CH	和达 科技	2021-0 7-19	2022-0 1-27	新股 流通 受限	12.46	49.67	2,173	27,075 .58	107,93 2.91	-
68871 1 CH	宏微 科技	2021-0 8-25	2022-0 3-01	新股 流通 受限	27.51	116.52	1,865	51,306 .15	217,30 9.80	-
68879 9 CH	华纳 药厂	2021-0 7-05	2022-0 1-13	新股 流通 受限	30.82	40.73	1,917	59,081 .94	78,079 .41	-

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。

#### 7.1.4.12.2 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。

#### 7.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.1.4.12.3.1 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。

##### 7.1.4.12.3.2 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。

#### 7.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.1.4.13.1 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。本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风



险之外，本基金还面临汇率风险、国家/地区风险等境外投资面临的特有风险。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。

#### 7.1.4.13.2 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。本基金在境内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；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。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%。

##### 7.1.4.13.2.1 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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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。

##### 7.1.4.13.2.2 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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00

合计	0.00
----	------

**7.1.4.13.2.3 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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

**7.1.4.13.2.4 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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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。

**7.1.4.13.2.5 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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

**7.1.4.13.2.6 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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

### 7.1.4.13.3 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。

#### 7.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所

或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 7.1.4.13.4 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。本基金可投资境外市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

##### 7.1.4.13.4.1 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。

##### 7.1.4.13.4.1.1 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	1,092,103,991.73	-	-	-	1,092,103,991.73
结算备付金	4,507,373.70	-	-	-	4,507,373.70
存出保证金	7,431,917.08	-	-	-	7,431,917.08
交易性金融资产	-	-	-	18,977,792,150.71	18,977,792,150.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	69,576.48	69,576.48
应收利息	-	-	-	84,270.74	84,270.74
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,104,043,282.51	-	-	18,977,945,997.91	20,081,989,280.42

				3	0.44
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	-	-	-	61,860,977.37	61,860,977.37
应付管理人报酬	-	-	-	26,260,604.80	26,260,604.80
应付托管费	-	-	-	4,376,767.47	4,376,767.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,514,994.58	5,514,994.58
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	314,409.72	314,409.72
负债总计	-	-	-	98,327,753.94	98,327,753.94
利率敏感度缺口	1,104,043,282.51	-	-	18,879,618,243.99	19,983,661,526.50

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。

#### 7.1.4.13.4.1.2 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。

#### 7.1.4.13.4.2 外汇风险

本基金可投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

##### 7.1.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				

银行存款	-	263,746,851.45	-	263,746,851.45
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	6,987,811,762.40	-	6,987,811,762.40
衍生金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
<b>资产合计</b>	-	<b>7,251,558,613.85</b>	-	<b>7,251,558,613.85</b>
<b>以外币计价的负债</b>				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
<b>负债合计</b>	-	-	-	-
<b>资产负债表外汇风险敞口净额</b>	-	<b>7,251,558,613.85</b>	-	<b>7,251,558,613.85</b>

#### 7.1.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变	
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
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-362,577,930.69
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	362,577,930.69

#### 7.1.4.13.4.3 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。

#### 7.1.4.13.4.3.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	18,977,792,150.71	94.97
交易性金融资产—基金投资	-	-
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	18,977,792,150.71	94.97

#### 7.1.4.13.4.3.2 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
	1.业绩比较基准上升5%	948,889,603.15
	2.业绩比较基准下降5%	-948,889,603.15

#### 7.1.4.14 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 18,976,470,986.98 元，属于第二层次的余额为 1,321,163.73 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。

(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。

## 7.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

### 7.2.1 资产负债表

会计主体：易方达中小盘混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 9 月 9 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 9 月 9 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.2.4.7.1	2,156,427,678.79	2,094,331,896.73



结算备付金		317,672,508.75	19,751,072.37
存出保证金		7,219,851.40	3,414,337.68
交易性金融资产	7.2.4.7.2	14,358,385,604.79	37,192,634,400.22
其中：股票投资		14,358,385,604.79	37,043,214,819.72
基金投资		-	-
债券投资		-	149,419,580.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.2.4.7.4	5,700,000,000.00	800,000,000.00
应收证券清算款		43,537,433.28	108,932,171.17
应收利息	7.2.4.7.5	4,246,178.97	1,264,453.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	192,199,950.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.2.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>22,587,489,255.98</b>	<b>40,412,528,281.97</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年9月9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	7.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		85,261,296.50	239,746,086.94
应付管理人报酬		8,270,095.20	46,228,750.02
应付托管费		1,378,349.18	7,704,791.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.2.4.7.7	7,023,751.13	7,132,533.60
应交税费		-	0.35
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.2.4.7.8	509,465.32	1,076,066.79
<b>负债合计</b>		<b>102,442,957.33</b>	<b>301,888,229.35</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.2.4.7.9	3,043,094,297.36	4,386,191,363.07

未分配利润	7.2.4.7.10	19,441,952,001.29	35,724,448,689.55
所有者权益合计		<b>22,485,046,298.65</b>	<b>40,110,640,052.62</b>
负债和所有者权益总计		<b>22,587,489,255.98</b>	<b>40,412,528,281.97</b>

注：报告截止日 2021 年 9 月 9 日，基金份额净值 7.3889 元，基金份额总额 3,043,094,297.36 份。

## 7.2.2 利润表

会计主体：易方达中小盘混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 9 月 9 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 9 月 9 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-2,838,113,865.84</b>	<b>15,472,779,612.00</b>
1.利息收入		42,939,315.79	9,710,439.44
其中：存款利息收入	7.2.4.7.11	9,476,049.13	6,714,309.60
债券利息收入		239,689.51	2,505,928.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		33,223,577.15	490,201.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,882,244,124.40	5,953,294,237.93
其中：股票投资收益	7.2.4.7.12	13,637,572,316.06	5,712,303,645.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.2.4.7.13	-61,090.26	526,402.66
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.2.4.7.14	-	-
股利收益	7.2.4.7.15	244,732,898.60	240,464,189.76
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.16	-16,789,352,339.79	9,465,329,370.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.2.4.7.17	26,055,033.76	44,445,564.11
<b>减：二、费用</b>		<b>486,737,949.85</b>	<b>441,113,200.63</b>
1. 管理人报酬		333,289,797.12	336,830,643.47
2. 托管费		55,548,299.59	56,138,440.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.2.4.7.18	97,636,717.12	47,793,572.06

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.07	0.11
7. 其他费用	7.2.4.7.19	263,135.95	350,544.53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-3,324,851,815.69</b>	<b>15,031,666,411.37</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-3,324,851,815.69</b>	<b>15,031,666,411.37</b>

### 7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达中小盘混合型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年9月9日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年1月1日至2021年9月9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）	4,386,191,363.07	35,724,448,689.55	40,110,640,052.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,324,851,815.69	-3,324,851,815.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,343,097,065.71	-9,016,944,752.82	-10,360,041,818.53
其中：1.基金申购款	1,212,313,278.61	10,429,479,141.10	11,641,792,419.71
2.基金赎回款	-2,555,410,344.32	-19,446,423,893.92	-22,001,834,238.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-3,940,700,119.75	-3,940,700,119.75
五、期末所有者权益（基金净值）	3,043,094,297.36	19,441,952,001.29	22,485,046,298.65
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）	3,758,491,155.19	14,886,081,964.14	18,644,573,119.33

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,031,666,411.37	15,031,666,411.37
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）	627,700,207.88	5,806,700,314.04	6,434,400,521.92
其中：1.基金申购款	5,985,724,289.31	33,415,483,903.66	39,401,208,192.97
2.基金赎回款	-5,358,024,081.43	-27,608,783,589.62	-32,966,807,671.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,386,191,363.07	35,724,448,689.55	40,110,640,052.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4，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

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 基金基本情况

本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 644 号《关于核准易方达中小盘股票型证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达中小盘股票型证券投资基金基金合同》公开募集。基金合同于 2008 年 6 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,226,705,470.21 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，注册登记机构为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

2015 年 7 月 25 日，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，本基金变更基金类别并由“易方达中小盘股票型证券投资基金”更名为“易方达中小盘混合型证券投资基金”。

### 7.2.4.2 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》、《易方达中小盘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。

#### 7.2.4.3 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。

#### 7.2.4.4 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。

##### 7.2.4.4.1 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,惟本会计年度期间为2021年1月1日至2021年9月9日(基金变更注册日前日)。

##### 7.2.4.4.2 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。

##### 7.2.4.4.3 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。

#### 7.2.4.4.4 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。

#### 7.2.4.4.5 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。

#### 7.2.4.4.6 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。

#### 7.2.4.4.7 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。

#### 7.2.4.4.8 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)。

#### 7.2.4.4.9 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。

#### 7.2.4.4.10 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。

#### 7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式,基金份额持有人可自行选择收益分配方式;基金份额持有人事先未做出选择的,默认的分红方式为现金红利;

(2)每一基金份额享有同等分配权;

(3)基金当期收益先弥补前期亏损后,方可进行当期收益分配;

(4)基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值;

(5)如果基金当期出现亏损,则不进行收益分配;

(6)在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至多十二次;

(7)每次基金收益分配比例不低于可分配收益的10%。基金合同生效不满三个月,收益可不分配;

(8)法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

#### 7.2.4.4.12 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。

#### 7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.2.4.5.1 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。

##### 7.2.4.5.2 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。

##### 7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.2.4.6 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。

#### 7.2.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 9 月 9 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	2,156,427,678.79	2,094,331,896.73
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	2,156,427,678.79	2,094,331,896.73

##### 7.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年9月9日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,390,645,848.51	14,358,385,604.79	-2,032,260,243.72
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	16,390,645,848.51	14,358,385,604.79	-2,032,260,243.72
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	22,285,644,254.15	37,043,214,819.72	14,757,570,565.57
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	53,000.00	64,580.50
	银行间市场	149,845,050.00	149,355,000.00
	合计	149,898,050.00	149,419,580.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	22,435,542,304.15	37,192,634,400.22	14,757,092,096.07

#### 7.2.4.7.3 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。

#### 7.2.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年9月9日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,700,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,700,000,000.00	-
项目	上年度末	

	2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	800,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	800,000,000.00	-

#### 7.2.4.7.4.2 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。

#### 7.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年9月9日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	2,572,397.95	277,210.01
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	1,646,129.07	8,888.00
应收债券利息	-	1,149,559.69
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-172,740.99
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	27,651.95	1,536.40
合计	4,246,178.97	1,264,453.11

#### 7.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年9月9日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	6,950,582.00	7,132,533.60
银行间市场应付交易费用	73,169.13	-
合计	7,023,751.13	7,132,533.60

#### 7.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年9月9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	216,862.96	826,066.79
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	292,602.36	250,000.00
合计	509,465.32	1,076,066.79

## 7.2.4.7.9 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9月9日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,386,191,363.07	4,386,191,363.07
本期申购	1,212,313,278.61	1,212,313,278.61
本期赎回（以“-”号填列）	-2,555,410,344.32	-2,555,410,344.32
本期末	3,043,094,297.36	3,043,094,297.36

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.2.4.7.10 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	13,545,960,944.55	22,178,487,745.00	35,724,448,689.55
本期利润	13,464,500,524.10	-16,789,352,339.79	-3,324,851,815.69
本期基金份额交易产生的变动数	-6,284,581,089.34	-2,732,363,663.48	-9,016,944,752.82
其中：基金申购款	4,894,178,486.16	5,535,300,654.94	10,429,479,141.10
基金赎回款	-11,178,759,575.50	-8,267,664,318.42	-19,446,423,893.92
本期已分配利润	-3,940,700,119.75	-	-3,940,700,119.75
本期末	16,785,180,259.56	2,656,771,741.73	19,441,952,001.29

## 7.2.4.7.11 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9月9日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	7,457,466.88	6,436,514.57

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	1,957,809.61	242,422.15
其他	60,772.64	35,372.88
合计	9,476,049.13	6,714,309.60

#### 7.2.4.7.12 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9月9日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	42,817,631,429.77	15,914,161,459.70
减：卖出股票成本总额	29,180,059,113.71	10,201,857,814.19
买卖股票差价收入	13,637,572,316.06	5,712,303,645.51

#### 7.2.4.7.13 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9月9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	151,226,209.48	513,828,842.71
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	149,898,050.00	500,837,109.72
减：应收利息总额	1,389,249.74	12,465,330.33
买卖债券差价收入	-61,090.26	526,402.66

#### 7.2.4.7.14 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。

#### 7.2.4.7.15 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9月9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	244,732,898.60	240,464,189.76
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	244,732,898.60	240,464,189.76

## 7.2.4.7.16 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9月9日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-16,789,352,339.79	9,465,329,370.52
——股票投资	-16,789,830,809.29	9,466,347,730.02
——债券投资	478,469.50	-1,018,359.50
——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	-16,789,352,339.79	9,465,329,370.52

## 7.2.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年9月9日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	26,055,033.76	44,445,564.11
合计	26,055,033.76	44,445,564.11

## 7.2.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年9月9日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	97,636,042.12	47,790,747.06
银行间市场交易费用	675.00	2,825.00
合计	97,636,717.12	47,793,572.06

## 7.2.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年9月9 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	89,752.32	130,000.00
信息披露费	82,850.04	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	62,633.59	63,344.53
银行间账户维护费	27,000.00	36,000.00
其他	900.00	1,200.00
合计	263,135.95	350,544.53

#### 7.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.2.4.8.1 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。

##### 7.2.4.8.2 资产负债表日后事项

自2021年9月10日起，本基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金。原《易方达中小盘混合型证券投资基金基金合同》失效，《易方达优质精选混合型证券投资基金基金合同》生效。

#### 7.2.4.9 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
盈峰控股集团有限公司	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。

#### 7.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.2.4.10.1.1 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。

###### 7.2.4.10.1.2 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。

###### 7.2.4.10.1.3 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。

###### 7.2.4.10.1.4 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。

###### 7.2.4.10.1.5 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。

##### 7.2.4.10.2 关联方报酬

###### 7.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年9月 9日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	333,289,797.12	336,830,643.47
其中：支付销售机构的客户维护费	97,937,060.01	90,553,488.69

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首日起10个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

**7.2.4.10.2.2 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9月9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	55,548,299.59	56,138,440.46

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首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支取。

**7.2.4.10.3 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。

**7.2.4.10.4 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****7.2.4.10.4.1 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。

**7.2.4.10.4.2 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。

**7.2.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.2.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.2.4.10.5.2 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。

**7.2.4.10.6 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9月9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	2,156,427,678.7 9	7,457,466.88	2,094,331,896.7 3	6,436,514.57
-----------	----------------------	--------------	----------------------	--------------

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。

#### 7.2.4.10.7 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9月9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	601728	中国电信	新股网上 发行	29,000	131,370.00
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
中银国际	688509	正元地信	新股网下 发行	15,433	30,403.01
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
-	-	-	-	-	-

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。

#### 7.2.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.2.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.2.4.11 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	2021-02-25	-	2021-02-25	9.000	2,254,647,639.63	1,686,052,480.12	3,940,700,119.75	-
合计				9.000	2,254,647,639.63	1,686,052,480.12	3,940,700,119.75	-

#### 7.2.4.12 期末（2021年9月9日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.2.4.12.1 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

7.2.4.12.2 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	39.40	329	3,023.51	12,962.60	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股流通受限	4.57	12.49	444	2,029.08	5,545.56	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股流通受限	8.40	18.72	328	2,755.20	6,140.16	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	24.90	340	3,984.80	8,466.00	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	84.24	240	6,904.80	20,217.60	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	33.76	232	3,834.96	7,832.32	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	22.75	371	4,767.35	8,440.25	-

300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	194.26	853	40,372.49	165,703.78	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	27.86	234	2,826.72	6,519.24	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-10-12	新股流通受限	8.48	25.98	394	3,341.12	10,236.12	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	21.08	576	1,958.40	12,142.08	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	30.15	283	3,432.79	8,532.45	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-13	新股流通受限	8.24	43.12	286	2,356.64	12,332.32	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	13.81	1,162	7,982.94	16,047.22	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-21	新股流通受限	7.19	14.39	430	3,091.70	6,187.70	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	131.39	360	10,180.80	47,300.40	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	17.62	492	2,696.16	8,669.04	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	16.57	593	4,993.06	9,826.01	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	79.40	925	30,728.50	73,445.00	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-11-02	新股流通受限	15.83	64.01	317	5,018.11	20,291.17	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	36.44	295	7,345.50	10,749.80	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通	14.79	47.93	264	3,904.56	12,653.52	-

				受限						
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-18	新股流通受限	6.79	25.54	301	2,043.79	7,687.54	-
300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股流通受限	13.06	34.36	254	3,317.24	8,727.44	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	27.70	200	1,872.00	5,540.00	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股流通受限	11.90	29.53	420	4,998.00	12,402.60	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-20	新股流通受限	14.72	29.42	191	2,811.52	5,619.22	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-11-20	新股流通受限	4.94	15.95	928	4,584.32	14,801.60	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-11-15	新股流通受限	6.02	24.87	201	1,210.02	4,998.87	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-11-07	新股流通受限	18.71	69.01	201	3,760.71	13,871.01	-
301004	嘉益股份	2021-06-18	2021-11-27	新股流通受限	7.81	15.62	312	2,436.72	4,873.44	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-11-23	新股流通受限	5.29	13.88	303	1,602.87	4,205.64	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-11-17	新股流通受限	12.54	20.63	801	10,044.54	16,524.63	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-11-20	新股流通受限	7.83	18.93	218	1,706.94	4,126.74	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-11-22	新股流通受限	8.05	23.11	170	1,368.50	3,928.70	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-11-30	新股流通受限	7.64	17.27	462	3,529.68	7,978.74	-
301011	雷尔	2021-06-22	2021-11-30	新股	13.75	23.30	275	3,781.	6,407.	-

6	伟	6-23	2-30	流通受限				25	50	
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	14.10	555	4,917.30	7,825.50	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	31.55	290	2,743.40	9,149.50	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股流通受限	1.55	11.59	403	624.65	4,670.77	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股流通受限	18.03	53.63	203	3,660.09	10,886.89	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股流通受限	11.45	15.41	286	3,274.70	4,407.26	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	12.50	733	3,892.23	9,162.50	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股流通受限	14.14	64.80	462	6,532.68	29,937.60	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	6.10	23.06	242	1,476.20	5,580.52	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股流通受限	22.04	43.59	644	14,193.76	28,071.96	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	6.68	17.76	266	1,776.88	4,724.16	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	6.96	10.06	2,064	14,365.44	20,763.84	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股流通受限	13.57	30.26	241	3,270.37	7,292.66	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	22.20	215	1,571.65	4,773.00	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股流通受限	8.34	37.96	290	2,418.60	11,008.40	-

301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股流通受限	4.13	12.90	843	3,481.59	10,874.70	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	29.75	196	3,790.64	5,831.00	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	60.64	185.39	233	14,129.12	43,195.87	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股流通受限	11.87	28.14	155	1,839.85	4,361.70	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股流通受限	6.90	21.67	355	2,449.50	7,692.85	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股流通受限	3.93	9.79	572	2,247.96	5,599.88	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股流通受限	8.03	19.46	218	1,750.54	4,242.28	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	新股流通受限	3.55	10.08	1,386	4,920.30	13,970.88	-
301059	金三江	2021-09-03	2021-09-13	新股流通受限	8.09	8.09	2,322	18,784.98	18,784.98	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股流通受限	8.09	8.09	259	2,095.31	2,095.31	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2021-09-13	新股流通受限	4.17	4.17	5,282	22,025.94	22,025.94	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股流通受限	4.17	4.17	587	2,447.79	2,447.79	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2021-09-14	新股流通受限	3.31	3.31	4,702	15,563.62	15,563.62	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股流通受限	3.31	3.31	523	1,731.13	1,731.13	-
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通	2.65	5.53	907,763	2,405,571.95	5,019,929.39	-



				受限						
600955	维远股份	2021-09-06	2021-09-15	新股流通受限	29.56	29.56	1,694	50,074.64	50,074.64	-
605033	美邦股份	2021-09-06	2021-09-16	新股流通受限	12.69	12.69	423	5,367.87	5,367.87	-
688103	国力股份	2021-09-02	2021-09-10	新股流通受限	12.04	12.04	1,595	19,203.80	19,203.80	-
688296	和达科技	2021-07-19	2022-01-27	新股流通受限	12.46	35.37	2,173	27,075.58	76,859.01	-
688621	阳光诺和	2021-06-11	2021-12-21	新股流通受限	26.89	79.61	1,485	39,931.65	118,220.85	-
688622	禾信仪器	2021-09-03	2021-09-13	新股流通受限	17.70	17.70	1,204	21,310.80	21,310.80	-
688711	宏微科技	2021-08-25	2022-03-01	新股流通受限	27.51	65.33	1,865	51,306.15	121,840.45	-
688799	华纳药厂	2021-07-05	2022-01-13	新股流通受限	30.82	34.24	1,917	59,081.94	65,638.08	-
600161	天坛生物	2021-04-26	2021-10-25	非公开发行流通受限	28.13	36.03	10,131,532	284,999,995.16	365,039,097.96	-

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。

#### 7.2.4.12.3 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。

#### 7.2.4.12.4 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.2.4.12.4.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 9 月 9 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。

##### 7.2.4.12.4.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 9 月 9 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。

#### 7.2.4.12.5 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。

#### 7.2.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.2.4.13.1 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。

##### 7.2.4.13.2 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。本基金在境内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;在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算,在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。于 2021 年 9 月 9 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%)。

##### 7.2.4.13.2.1 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9月9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	150,504,534.25
合计	0.00	150,504,534.25

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。

#### 7.2.4.13.2.2 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9月9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

#### 7.2.4.13.2.3 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9月9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

#### 7.2.4.13.2.4 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9月9日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	64,605.94
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	64,605.94

- 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。

#### 7.2.4.13.2.5 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9月9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

#### 7.2.4.13.2.6 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9月9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

#### 7.2.4.13.3 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 9 月 9 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。

#### 7.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 7.2.4.13.4 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。

##### 7.2.4.13.4.1 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。

##### 7.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年9月9日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,156,427,678.79	-	-	-	2,156,427,678.79

结算备付金	317,672,508.75	-	-	-	317,672,508.75
存出保证金	7,219,851.40	-	-	-	7,219,851.40
交易性金融资产	-	-	-	14,358,385,604.79	14,358,385,604.79
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	5,700,000,000.00	-	-	-	5,700,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	43,537,433.28	43,537,433.28
应收利息	-	-	-	4,246,178.97	4,246,178.97
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,181,320,038.94	-	-	14,406,169,217.04	22,587,489,255.98
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	-	-	-	85,261,296.50	85,261,296.50
应付管理人报酬	-	-	-	8,270,095.20	8,270,095.20
应付托管费	-	-	-	1,378,349.18	1,378,349.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	7,023,751.13	7,023,751.13
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	509,465.32	509,465.32
负债总计	-	-	-	102,442,957.33	102,442,957.33
利率敏感度缺口	8,181,320,038.94	-	-	14,303,726,259.71	22,485,046,298.65
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	2,094,331,896.73	-	-	-	2,094,331,896.73

					73
结算备付金	19,751,072.37	-	-	-	19,751,072.37
存出保证金	3,414,337.68	-	-	-	3,414,337.68
交易性金融资产	149,355,000.00	-	64,580.50	37,043,214,819.72	37,192,634,400.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	800,000,000.00	-	-	-	800,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	108,932,171.17	108,932,171.17
应收利息	-	-	-	1,264,453.11	1,264,453.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	192,199,950.69	192,199,950.69
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,066,852,306.78	-	64,580.50	37,345,611,394.69	40,412,528,281.97
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	-	-	-	239,746,086.94	239,746,086.94
应付管理人报酬	-	-	-	46,228,750.02	46,228,750.02
应付托管费	-	-	-	7,704,791.65	7,704,791.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	7,132,533.60	7,132,533.60
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,076,066.79	1,076,066.79
负债总计	-	-	-	301,888,229.35	301,888,229.35
利率敏感度缺口	3,066,852,306.78	-	64,580.50	37,043,723,165.34	40,110,640,052.62

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。

#### 7.2.4.13.4.1.2 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9月9日	上年度末 2020年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	0.00	110,754.06
2.市场利率上升25个基点	0.00	-110,590.05	

注: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。

#### 7.2.4.13.4.2 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。

#### 7.2.4.13.4.3 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。

#### 7.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2021年9月9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	14,358,385,604.79	63.86	37,043,214,819.72	92.35
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	14,358,385,604.79	63.86	37,043,214,819.72	92.35



**7.2.4.13.4.3.2 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9月9日	上年度末 2020年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	990,523,299.75	3,044,256,434.58
	2.业绩比较基准下降 5%	-990,523,299.75	-3,044,256,434.58

**7.2.4.14 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 9 月 9 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 13,986,919,455.44 元，属于第二层次的余额为 371,466,149.35 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 35,787,822,116.09 元，第二层次 1,404,812,284.13 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 9 月 9 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

(报告期：2021年9月10日（基金合同生效日）-2021年12月31日)

#### 8.1.1 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	18,977,792,150.71	94.50
	其中：普通股	18,977,792,150.71	94.50
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,096,611,365.43	5.46
8	其他各项资产	7,585,764.30	0.04
9	合计	20,081,989,280.44	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 4,283,386,777.60 元，占净值比例 21.43%。

### 8.1.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国	11,989,980,388.31	60.00
中国香港	6,987,811,762.40	34.97
合计	18,977,792,150.71	94.97

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

### 8.1.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	1,517,758.13	0.01
工业	405,803.70	0.00
非必需消费品	3,348,787,994.34	16.76
必需消费品	8,689,116,977.94	43.48
保健	4,047,676.16	0.02
金融	3,202,862,640.00	16.03
信息技术	1,413,014,156.21	7.07
电信服务	2,317,919,888.24	11.60
公用事业	-	-
房地产	-	-
其他-GICS 未分类	119,255.99	0.00
合计	18,977,792,150.71	94.97

注：1.以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

2.本基金本报告期末持有的部分股票尚无GICS行业分类，因此将其归入“其他-GICS未分类”。

#### 8.1.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量(股)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证 券交易 所	中国香港	5,270,000	1,968,237,913.60	9.85
2	Kweichow Moutai Co.,Ltd.	贵州茅台酒股份有限公司	600519 CH	上海证 券交易 所	中国	935,000	1,916,750,000.00	9.59
3	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	600036 CH	上海证 券交易 所	中国	39,000,000	1,899,690,000.00	9.51
4	Wuliangye Yibin Co.,Ltd	宜宾五粮液股份有限公司	000858 CH	深圳证 券交易 所	中国	8,420,000	1,874,797,200.00	9.38
5	Luzhou Laojiao Co.,Ltd	泸州老窖股份有限公司	000568 CH	深圳证 券交易 所	中国	6,660,000	1,690,774,200.00	8.46
6	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	江苏洋河酒厂股份有限公司	002304 CH	深圳证 券交易 所	中国	10,000,070	1,647,311,531.10	8.24
7	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co.,Ltd.	内蒙古伊利实业集团股份有限公司	600887 CH	上海证 券交易 所	中国	37,000,000	1,534,020,000.00	7.68
8	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co.,Ltd.	杭州海康威视数字技术股份有限公司	002415 CH	深圳证 券交易 所	中国	27,000,099	1,412,645,179.68	7.07

9	JD.com Inc	京东集团 股份有限 公司	9618 HK	香港证 券交易 所	中国香港	6,000,000	1,344,134,400.00	6.73
10	Hong Kong Exchange and Clearing Ltd.	香港交易 及结算所 有限公司	388 HK	香港证 券交易 所	中国香港	3,500,000	1,303,172,640.00	6.52
11	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴 集团控股 有限公司	9988 HK	香港证 券交易 所	中国香港	10,300,000	1,001,290,192.00	5.01
12	Meituan	美团	3690 HK	香港证 券交易 所	中国香港	4,600,000	847,720,384.00	4.24
13	NetEase Inc	网易公司	9999 HK	香港证 券交易 所	中国香港	2,715,000	349,615,980.00	1.75
14	Pop Mart International Group Limited	泡泡玛特 国际集团 有限公司	9992 HK	香港证 券交易 所	中国香港	4,000,000	146,186,880.00	0.73
15	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	中国蒙牛 乳业有限 公司	2319 HK	香港证 券交易 所	中国香港	500,000	18,068,960.00	0.09
16	Yum China Holdings, Inc.	百胜中国 控股有限 公司	9987 HK	香港证 券交易 所	中国香港	30,000	9,384,412.80	0.05
17	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co.,Ltd.	山西杏花 村汾酒厂 股份有限 公司	600809 CH	上海证 券交易 所	中国	10,000	3,157,800.00	0.02
18	Eastroc Beverage (Group) Co.,Ltd.	东鹏饮料 (集团)股份 有限公司	605499 CH	上海证 券交易 所	中国	10,000	1,818,400.00	0.01
19	Beijing Tiantan Biological Products	北京天坛 生物制品 股份有限 公司	600161 CH	上海证 券交易 所	中国	50,000	1,448,000.00	0.01

	Corporation Limited							
20	Skshu Paint Co., Ltd.	三棵树涂料股份有限公司	603737 CH	上海证券交易所	中国	10,000	1,391,500.00	0.01
21	Aier Eye Hospital Group Co.,Ltd	爱尔眼科医院集团股份有限公司	300015 CH	深圳证券交易所	中国	30,000	1,268,400.00	0.01
22	Sichuan Swellfun Co., Ltd.	四川水井坊股份有限公司	600779 CH	上海证券交易所	中国	10,000	1,199,900.00	0.01
23	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co., Ltd.	上海百润投资控股集团股份有限公司	002568 CH	深圳证券交易所	中国	20,000	1,196,600.00	0.01
24	Wuxi Apptec Co.,Ltd.	无锡药明康德新药开发股份有限公司	603259 CH	上海证券交易所	中国	10,000	1,185,800.00	0.01
25	Macmic Science & Technology Co., Ltd.	江苏宏微科技股份有限公司	688711 CH	上海证券交易所	中国	1,865	217,309.80	0.00
26	Zhejiang Heda Technology Co.,Ltd	浙江和达科技股份有限公司	688296 CH	上海证券交易所	中国	2,173	107,932.91	0.00
27	Jiangsu Haili Wind Power Equipment Technology Co., Ltd.	江苏海力风电设备科技股份有限公司	301155 CH	深圳证券交易所	中国	1,054	101,974.50	0.00
28	Shenzhen Pacific Union Precision	深圳市泛海统联精密制造股份有限公司	688210 CH	上海证券交易所	中国	2,218	87,677.54	0.00

	Manufacturing Co., Ltd.	司						
29	Hunan Warrant Pharmaceutical Co., Ltd	湖南华纳大药厂股份有限公司	688799 CH	上海证券交易所	中国	1,917	78,079.41	0.00
30	China Mobile Limited	中国移动有限公司	600941 CH	上海证券交易所	中国	1,000	57,580.00	0.00
31	Chengdu RML Technology Co., Ltd.	成都雷电微力科技股份有限公司	301050 CH	深圳证券交易所	中国	233	54,694.42	0.00
32	Dongguan Yiheda Automation Co., Ltd.	东莞怡合达自动化股份有限公司	301029 CH	深圳证券交易所	中国	462	41,519.94	0.00
33	Shandong Weifang Rainbow Chemical Co., Ltd	山东潍坊润丰化工股份有限公司	301035 CH	深圳证券交易所	中国	644	36,244.32	0.00
34	China Resources Chemical Innovative Materials Co., Ltd.	华润化学材料科技股份有限公司	301090 CH	深圳证券交易所	中国	2,764	31,012.08	0.00
35	Cimc Vehicles (Group) Co., Ltd.	中集车辆(集团)股份有限公司	301039 CH	深圳证券交易所	中国	2,064	25,820.64	0.00
36	COFCO Engineering & Technology Co., Ltd.	中粮工程科技股份有限公司	301058 CH	深圳证券交易所	中国	1,386	25,280.64	0.00
37	Hangzhou Bio-Since	杭州百诚医药科技	301096 CH	深圳证 券交易	中国	272	21,360.16	0.00

	rity Pharma-T ech Co., Ltd	股份有限 公司		所				
38	Jiangsu Hualan New Pharmace utical Material Co., Ltd	江苏华兰 药用新材 料股份有 限公司	301093 CH	深圳证 券交易 所	中国	409	20,388.65	0.00
39	Jiusheng Electric Co., Ltd.	久盛电气 股份有限 公司	301082 CH	深圳证 券交易 所	中国	915	19,699.95	0.00
40	Joy Kie Corporati on Limited.	久祺股份 有限公司	300994 CH	深圳证 券交易 所	中国	420	19,089.00	0.00
41	Shanghai Labway Clinical Laborator y Co.,Ltd.	上海兰卫 医学检验 所股份有 限公司	301060 CH	深圳证 券交易 所	中国	587	18,161.78	0.00
42	Rumere Co., Ltd.	日禾戎美 股份有限 公司	301088 CH	深圳证 券交易 所	中国	704	17,367.68	0.00
43	Shenzhen Urban Transport Planning Center Co., Ltd	深圳市城 市交通规 划设计研 究中心股 份有限公 司	301091 CH	深圳证 券交易 所	中国	524	16,406.44	0.00
44	Hunan Hengguan g Technolog y Co., Ltd.	湖南恒光 科技股份 有限公司	301118 CH	深圳证 券交易 所	中国	315	15,441.30	0.00
45	Jiangsu Zeyu Intelligent Electric Power Co.,Ltd.	江苏泽宇 智能电力 股份有限 公司	301179 CH	深圳证 券交易 所	中国	295	14,977.15	0.00
46	Xinxiang	新乡拓新	301089 CH	深圳证	中国	220	14,944.60	0.00



	Tuoxin Pharmaceutical Co., Ltd.	药业股份有限公司		券交易所				
47	Suzhou Wanxiang Technology Co., Ltd.	苏州万祥科技股份有限公司	301180 CH	深圳证券交易所	中国	654	14,858.88	0.00
48	Shanghai Nenghui Technology Co.,Ltd.	上海能辉科技股份有限公司	301046 CH	深圳证券交易所	中国	290	14,207.10	0.00
49	Guangdong Lifstrong Pharmacy Co., Ltd.	广东万年青制药股份有限公司	301111 CH	深圳证券交易所	中国	379	13,901.72	0.00
50	Shu Yu Civilian Pharmacy Corp.,Ltd.	漱玉平民大药房连锁股份有限公司	301017 CH	深圳证券交易所	中国	555	13,209.00	0.00
51	Guang Zhou Hua Yan Precision Machinery Co.,Ltd.	广州华研精密机械股份有限公司	301138 CH	深圳证券交易所	中国	285	12,785.10	0.00
52	Hootech Inc.	徐州浩通新材料科技股份有限公司	301026 CH	深圳证券交易所	中国	203	12,734.19	0.00
53	Inno Laser Technology Co., Ltd.	英诺激光科技股份有限公司	301021 CH	深圳证券交易所	中国	290	12,014.70	0.00
54	Gemac Engineering Machinery Co., Ltd.	金鹰重型工程机械股份有限公司	301048 CH	深圳证券交易所	中国	843	10,925.28	0.00
55	Xiamen East Asia	厦门东亚机械工业	301028 CH	深圳证券交易	中国	733	9,895.50	0.00

	Machinery Industrial Co., Ltd.	股份有限公司		所				
56	BGT Group Co., Ltd.	倍杰特集团股份有限公司	300774 CH	深圳证券交易所	中国	444	9,359.52	0.00
57	Zhangjiagang Zhonghua Hailu High-End Equipment Co., Ltd.	张家港中环海陆高端装备股份有限公司	301040 CH	深圳证券交易所	中国	241	9,280.91	0.00
58	Kidswant Children Products Co., Ltd.	孩子王儿童用品股份有限公司	301078 CH	深圳证券交易所	中国	756	9,177.84	0.00
59	Shanghai Ailu Package Co., Ltd.	上海艾录包装股份有限公司	301062 CH	深圳证券交易所	中国	523	8,896.23	0.00
60	Ningbo Homelink Eco-iTech Co., Ltd.	宁波家联科技股份有限公司	301193 CH	深圳证券交易所	中国	297	8,654.58	0.00
61	Dook Media Group Limited	读客文化股份有限公司	301025 CH	深圳证券交易所	中国	403	8,414.64	0.00
62	Shenzhen Jove Enterprise Limited	深圳中富电路股份有限公司	300814 CH	深圳证券交易所	中国	328	7,832.64	0.00
63	Zhang Xiaoquan Inc.	张小泉股份有限公司	301055 CH	深圳证券交易所	中国	355	7,731.90	0.00
64	Guangzhou Jinzhong Auto Parts Manufacturing Co., Ltd.	广州市金钟汽车零部件股份有限公司	301133 CH	深圳证券交易所	中国	286	7,707.70	0.00
65	Ningbo	宁波喜悦	301198 CH	深圳证	中国	262	7,650.40	0.00

	Joy Intelligent Logistics Technology Co.,Ltd.	智行科技股份有限公司		券交易所				
66	Suzhou Shijing Environmental Technology Co.,Ltd	苏州仕净科技股份有限公司	301030 CH	深圳证券交易所	中国	242	7,627.84	0.00
67	Yanpai Filtration Technology Co.,Ltd.	浙江严牌过滤技术股份有限公司	301081 CH	深圳证券交易所	中国	403	7,028.32	0.00
68	Jinpu Landscape Architecture Co.,Ltd.	金埔园林股份有限公司	301098 CH	深圳证券交易所	中国	307	6,806.19	0.00
69	Anhui Chaoyue Environmental Protection Technology Co.,Ltd.	安徽超越环保科技有限公司	301049 CH	深圳证券交易所	中国	196	6,452.32	0.00
70	Sicher Elevator Co., Ltd.	森赫电梯股份有限公司	301056 CH	深圳证券交易所	中国	572	6,343.48	0.00
71	Shenzhen King Brother Electronics Technology Co.,Ltd.	深圳市金百泽电子科技股份有限公司	301041 CH	深圳证券交易所	中国	215	6,065.15	0.00
72	Bisen Smart Access Co.,Ltd.	江西百胜智能科技有限公司	301083 CH	深圳证券交易所	中国	416	5,911.36	0.00
73	Jiangsu Times Textile	江苏泰慕士针纺科技股份有限公司	001234 CH	深圳证券交易所	中国	333	5,504.49	0.00

	Technology Co.,Ltd	限公司						
74	Shenzhen Water Planning & Design Institute Co., Ltd.	深圳市水务规划设计院股份有限公司	301038 CH	深圳证券交易所	中国	266	5,381.18	0.00
75	Jinsanjiang (Zhaoqing) Silicon Material Company Limited	金三江(肇庆)硅材料股份有限公司	301059 CH	深圳证券交易所	中国	259	4,998.70	0.00
76	Hualan Group Co., Ltd.	华蓝集团股份有限公司	301027 CH	深圳证券交易所	中国	286	4,761.90	0.00
77	Huitong Construction Group Co.,Ltd.	汇通建设集团股份有限公司	603176 CH	上海证券交易所	中国	1,924	4,713.80	0.00
78	Yoantion Industrial Inc.,Ltd.	远信工业股份有限公司	301053 CH	深圳证券交易所	中国	155	4,460.90	0.00
79	Zhejiang Huilong New Materials Co.,Ltd.	浙江汇隆新材料股份有限公司	301057 CH	深圳证券交易所	中国	218	4,146.36	0.00
80	Shaoyang Victor Hydraulics Co.,Ltd.	邵阳维克液压股份有限公司	301079 CH	深圳证券交易所	中国	140	3,474.80	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 8.1.5 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 8.1.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）

1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	2,176,851,363.62	10.89
2	China Merchants Bank Co., Ltd.	600036 CH	2,154,627,383.42	10.78
3	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	002304 CH	1,896,051,666.58	9.49
4	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co.,Ltd.	002415 CH	1,607,397,766.43	8.04
5	JD.com Inc	9618 HK	1,522,853,626.63	7.62
6	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co.,Ltd.	600887 CH	1,508,533,768.65	7.55
7	Luzhou Laojiao Co.,Ltd	000568 CH	1,501,232,051.96	7.51
8	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	1,447,148,852.06	7.24
9	Wuliangye Yibin Co.,Ltd	000858 CH	1,445,729,624.29	7.23
10	Ping An Bank Co., Ltd.	000001 CH	1,196,122,623.82	5.99
11	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	1,094,775,556.42	5.48
12	Meituan	3690 HK	1,005,627,654.84	5.03
13	NetEase Inc	9999 HK	350,910,725.78	1.76
14	Pop Mart International Group Limited	9992 HK	194,169,296.85	0.97
15	Haier Smart Home Co., Ltd.	600690 CH	139,515,196.81	0.70
		6690 HK	5,005,544.55	0.03
16	Kweichow Moutai Co.,Ltd.	600519 CH	50,087,122.18	0.25
17	China Mengniu Dairy Co. Ltd.	2319 HK	19,846,604.31	0.10
18	Yum China Holdings, Inc.	9987 HK	10,723,277.60	0.05
19	BeiGene, Ltd.	688235 CH	3,701,194.20	0.02
20	China Overseas Land & Investment Ltd.	688 HK	1,489,728.13	0.01

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

#### 8.1.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	Postal Savings Bank of China Co.,Ltd.	601658 CH	2,301,058,439.59	11.51
2	Hundsun Technologies Inc.	600570 CH	1,591,241,959.14	7.96
3	Meinian Onehealth	002044 CH	1,390,683,568.51	6.96

	Healthcare Holdings Co., Ltd.			
4	Zhejiang Supor Co., Ltd.	002032 CH	1,100,876,187.89	5.51
5	Ping An Bank Co., Ltd.	000001 CH	1,099,893,959.97	5.50
6	Hualan Biological Engineering, Inc.	002007 CH	1,045,651,474.24	5.23
7	Jonjee Hi-Tech Industrial and Commercial Holding Co., Ltd	600872 CH	849,429,478.74	4.25
8	Kweichow Moutai Co., Ltd.	600519 CH	688,314,437.09	3.44
9	China World Trade Center Co., Ltd.	600007 CH	569,039,617.50	2.85
10	Shanghai Bairun Investment Holding Group Co., Ltd.	002568 CH	562,015,571.02	2.81
11	Beijing Tiantan Biological Products Corporation Limited	600161 CH	560,511,150.55	2.80
12	SDIC Power Holdings Co., Ltd.	600886 CH	452,654,072.05	2.27
13	Wuliangye Yibin Co., Ltd	000858 CH	437,580,695.13	2.19
14	Luzhou Laojiao Co., Ltd	000568 CH	285,543,913.03	1.43
15	Yutong Bus Co., Ltd.	600066 CH	245,093,116.06	1.23
16	Inner Mongolia Yili Industrial Group Co., Ltd.	600887 CH	199,163,411.46	1.00
17	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co., Ltd.	002415 CH	147,683,453.12	0.74
18	Jiangsu Yanghe Brewery Joint-Stock Co., Ltd.	002304 CH	141,856,798.76	0.71
19	Beijing Shunxin Agriculture Co., Ltd	000860 CH	135,895,571.59	0.68
20	Haier Smart Home Co., Ltd.	600690 CH	126,700,281.70	0.63
		6690 HK	4,503,636.29	0.02

注：1. 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。

2. 此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

### 8.1.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	19,341,647,026.23
卖出收入（成交）总额	14,243,863,056.15

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。

**8.1.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**8.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**8.1.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

**8.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细**

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**8.1.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金。

**8.1.11 投资组合报告附注**

8.1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，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。

8.1.11.2 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。

**8.1.11.3 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	7,431,917.08
2	应收证券清算款	69,576.48
3	应收股利	-
4	应收利息	84,270.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	7,585,764.30
---	----	--------------

#### 8.1.11.4 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。

#### 8.1.11.5 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。

### 8.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

(报告期：2021年1月1日-2021年9月9日)

#### 8.2.1 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	14,358,385,604.79	63.57
	其中：股票	14,358,385,604.79	63.57
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	5,700,000,000.00	25.24
	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	2,474,100,187.54	10.95
8	其他各项资产	55,003,463.65	0.24
9	合计	22,587,489,255.98	100.00

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.2.2.1 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	6,187.70	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,638,792,560.63	33.97



D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	483,004,953.11	2.15
E	建筑业	20,291.17	0.00
F	批发和零售业	63,059.01	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	36,478.86	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,570,884,546.55	6.99
J	金融业	2,415,925,000.00	10.74
K	房地产业	683,761,669.44	3.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,700,697.95	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	42,753.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,562,142,736.56	6.95
R	文化、体育和娱乐业	4,670.77	0.00
S	综合	-	-
	合计	14,358,385,604.79	63.86

### 8.2.3 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	601658	邮储银行	442,000,000	2,413,320,000.00	10.73
2	600519	贵州茅台	1,260,100	2,059,104,208.00	9.16
3	600570	恒生电子	28,000,000	1,570,800,000.00	6.99
4	002044	美年健康	180,000,000	1,486,800,000.00	6.61
5	002032	苏泊尔	23,100,000	1,145,298,000.00	5.09
6	002007	华兰生物	37,000,000	1,100,750,000.00	4.90
7	600872	中炬高新	28,200,087	942,728,908.41	4.19
8	000858	五粮液	3,500,100	725,675,733.00	3.23
9	600007	中国国贸	38,500,094	683,761,669.44	3.04
10	600161	天坛生物	17,200,062	629,048,693.46	2.80
11	002568	百润股份	8,700,000	583,335,000.00	2.59
12	600886	国投电力	45,008,006	477,985,023.72	2.13
13	600066	宇通客车	21,000,000	255,570,000.00	1.14
14	000860	顺鑫农业	4,000,080	137,642,752.80	0.61
15	000516	国际医学	7,000,072	71,610,736.56	0.32
16	605499	东鹏饮料	100,100	18,619,601.00	0.08

17	000568	泸州老窖	100,000	18,141,000.00	0.08
18	002304	洋河股份	50,000	8,324,000.00	0.04
19	600779	水井坊	50,000	6,455,000.00	0.03
20	600905	三峡能源	907,763	5,019,929.39	0.02
21	603259	药明康德	24,000	3,378,720.00	0.02
22	600809	山西汾酒	10,000	2,754,000.00	0.01
23	600036	招商银行	50,000	2,605,000.00	0.01
24	002415	海康威视	50,000	2,598,000.00	0.01
25	600763	通策医疗	10,000	2,376,600.00	0.01
26	300015	爱尔眼科	30,000	1,355,400.00	0.01
27	603737	三棵树	10,000	1,310,400.00	0.01
28	301058	中粮工科	13,860	183,617.28	0.00
29	300957	贝泰妮	853	165,703.78	0.00
30	688091	上海谊众	3,294	161,373.06	0.00
31	688767	博拓生物	2,220	152,958.00	0.00
32	688711	宏微科技	1,865	121,840.45	0.00
33	688621	阳光诺和	1,485	118,220.85	0.00
34	688296	和达科技	2,173	76,859.01	0.00
35	300979	华利集团	925	73,445.00	0.00
36	688799	华纳药厂	1,917	65,638.08	0.00
37	301057	汇隆新材	2,173	53,879.73	0.00
38	600955	维远股份	1,694	50,074.64	0.00
39	300973	立高食品	360	47,300.40	0.00
40	301050	雷电微力	233	43,195.87	0.00
41	001213	中铁特货	5,818	36,478.86	0.00
42	301029	怡合达	462	29,937.60	0.00
43	301035	润丰股份	644	28,071.96	0.00
44	301060	兰卫医学	5,869	24,473.73	0.00
45	688622	禾信仪器	1,204	21,310.80	0.00
46	301059	金三江	2,581	20,880.29	0.00
47	301039	中集车辆	2,064	20,763.84	0.00
48	300982	苏文电能	317	20,291.17	0.00
49	300953	震裕科技	240	20,217.60	0.00
50	688103	国力股份	1,595	19,203.80	0.00
51	301062	上海艾录	5,225	17,294.75	0.00
52	301009	可靠股份	801	16,524.63	0.00
53	300968	格林精密	1,162	16,047.22	0.00
54	300997	欢乐家	928	14,801.60	0.00
55	605599	菜百股份	980	14,112.00	0.00
56	301002	崧盛股份	201	13,871.01	0.00
57	300614	百川畅银	329	12,962.60	0.00
58	300986	志特新材	264	12,653.52	0.00
59	300994	久祺股份	420	12,402.60	0.00
60	300966	共同药业	286	12,332.32	0.00

61	300962	中金辐照	576	12,142.08	0.00
62	301046	能辉科技	290	11,008.40	0.00
63	301026	浩通科技	203	10,886.89	0.00
64	301048	金鹰重工	843	10,874.70	0.00
65	300985	致远新能	295	10,749.80	0.00
66	300961	深水海纳	394	10,236.12	0.00
67	300978	东箭科技	593	9,826.01	0.00
68	301028	东亚机械	733	9,162.50	0.00
69	301021	英诺激光	290	9,149.50	0.00
70	001215	千味央厨	295	8,882.45	0.00
71	300950	德固特	219	8,841.03	0.00
72	300991	创益通	254	8,727.44	0.00
73	300975	商络电子	492	8,669.04	0.00
74	300963	中洲特材	283	8,532.45	0.00
75	300952	恒辉安防	340	8,466.00	0.00
76	300956	英力股份	371	8,440.25	0.00
77	300948	冠中生态	324	8,177.76	0.00
78	301015	百洋医药	462	7,978.74	0.00
79	300955	嘉亨家化	232	7,832.32	0.00
80	301017	漱玉平民	555	7,825.50	0.00
81	301055	张小泉	355	7,692.85	0.00
82	300987	川网传媒	301	7,687.54	0.00
83	301040	中环海陆	241	7,292.66	0.00
84	300960	通业科技	234	6,519.24	0.00
85	301016	雷尔伟	275	6,407.50	0.00
86	300972	万辰生物	430	6,187.70	0.00
87	300814	中富电路	328	6,140.16	0.00
88	301049	超越科技	196	5,831.00	0.00
89	300995	奇德新材	191	5,619.22	0.00
90	301056	森赫股份	572	5,599.88	0.00
91	301030	仕净科技	242	5,580.52	0.00
92	300774	倍杰特	444	5,545.56	0.00
93	300992	泰福泵业	200	5,540.00	0.00
94	605033	美邦股份	423	5,367.87	0.00
95	300998	宁波方正	201	4,998.87	0.00
96	301004	嘉益股份	312	4,873.44	0.00
97	301041	金百泽	215	4,773.00	0.00
98	301038	深水规院	266	4,724.16	0.00
99	301025	读客文化	403	4,670.77	0.00
100	301027	华蓝集团	286	4,407.26	0.00
101	301053	远信工业	155	4,361.70	0.00
102	301007	德迈仕	303	4,205.64	0.00
103	301010	晶雪节能	218	4,126.74	0.00
104	301012	扬电科技	170	3,928.70	0.00

注：本报告期末本基金投资邮储银行占基金资产净值比例超过10%，属于被动超标。

## 8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.2.4.1 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	600036	招商银行	3,715,643,049.66	9.26
2	002007	华兰生物	2,903,907,369.74	7.24
3	601658	邮储银行	2,253,950,621.51	5.62
4	000001	平安银行	2,145,516,882.77	5.35
5	600570	恒生电子	1,702,790,508.46	4.25
6	002415	海康威视	1,089,131,580.63	2.72
7	600872	中炬高新	1,039,572,852.78	2.59
8	002568	百润股份	837,970,990.06	2.09
9	600007	中国国贸	817,483,277.37	2.04
10	000895	双汇发展	774,322,064.13	1.93
11	600161	天坛生物	704,510,418.43	1.76
12	600779	水井坊	684,627,830.61	1.71
13	000858	五粮液	644,215,207.58	1.61
14	601166	兴业银行	624,487,395.67	1.56
15	600519	贵州茅台	530,404,286.01	1.32
16	600588	用友网络	488,746,872.15	1.22
17	600886	国投电力	447,658,067.78	1.12
18	002507	涪陵榨菜	306,277,689.00	0.76
19	600763	通策医疗	294,072,010.45	0.73
20	600066	宇通客车	273,165,333.25	0.68

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。

### 8.2.4.2 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	600036	招商银行	4,251,492,520.66	10.60
2	000568	泸州老窖	4,177,939,977.67	10.42
3	600763	通策医疗	3,493,941,572.11	8.71
4	000858	五粮液	3,490,351,842.87	8.70
5	002304	洋河股份	3,097,402,075.84	7.72

6	002415	海康威视	2,745,737,728.38	6.85
7	600779	水井坊	2,499,860,901.89	6.23
8	600519	贵州茅台	2,157,264,633.84	5.38
9	000001	平安银行	2,100,103,878.02	5.24
10	600161	天坛生物	1,669,832,285.52	4.16
11	600009	上海机场	1,662,200,654.36	4.14
12	600809	山西汾酒	1,590,445,186.49	3.97
13	002568	百润股份	1,410,480,940.78	3.52
14	300015	爱尔眼科	1,327,103,326.88	3.31
15	600066	宇通客车	1,285,626,494.47	3.21
16	002007	华兰生物	1,059,364,718.14	2.64
17	601166	兴业银行	613,007,486.34	1.53
18	600570	恒生电子	586,633,746.89	1.46
19	603317	天味食品	577,502,308.87	1.44
20	000895	双汇发展	563,419,148.02	1.40

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。

#### 8.2.4.3 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	23,285,060,708.07
卖出股票收入（成交）总额	42,817,631,429.77

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。

#### 8.2.5 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。

#### 8.2.6 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。

#### 8.2.7 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。

#### 8.2.8 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。

#### 8.2.9 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。

**8.2.10 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。

**8.2.11 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。

**8.2.12 投资组合报告附注**

8.2.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家税务总局北京市税务局第一稽查局、中国银行保险监督管理委员会处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，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。

8.2.12.2 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。

**8.2.12.3 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	7,219,851.40
2	应收证券清算款	43,537,433.28
3	应收股利	-
4	应收利息	4,246,178.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,003,463.65

**8.2.12.4 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。

**8.2.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	-----------	----------

				(%)	
1	600161	天坛生物	365,039,097.96	1.62	非公开发行流通受限

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

(报告期: 2021年9月10日(基金合同生效日)-2021年12月31日)

#### 9.1.1 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
2,974,364	938.43	26,105,780.07	0.94%	2,765,115,803. 32	99.06%

#### 9.1.2 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	3,863,035.71	0.1384%

#### 9.1.3 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

### 9.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

(报告期: 2021年1月1日-2021年9月9日)

#### 9.2.1 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
3,337,339	911.83	31,770,945. 24	1.04%	3,011,323, 52.12	98.96%

**9.2.2 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	4,112,221.05	0.1351%

**9.2.3 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

**§10 开放式基金份额变动****10.1 易方达优质精选混合型证券投资基金**

（报告期：2021年9月10日（基金合同生效日）-2021年12月31日）

单位：份

基金合同生效日(2021年9月10日)基金份额总额	3,043,094,297.36
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	251,872,713.97
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,791,221,583.39

注：本基金由易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册而来，基金合同于2021年09月10日起生效，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

**10.2 易方达中小盘混合型证券投资基金**

（报告期：2021年1月1日-2021年9月9日）

单位：份

基金合同生效日（2008年6月19日）基金份额总额	1,226,705,470.21
本报告期期初基金份额总额	4,386,191,363.07
本报告期基金总申购份额	1,212,313,278.61
减：本报告期基金总赎回份额	2,555,410,344.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,043,094,297.36

注：自2021年9月10日起，“易方达中小盘混合型证券投资基金”变更为“易方达优质精选混合型证券投资基金”。本报告期的相关数据按实际存续期计算。



## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，自2021年8月2日起至2021年9月7日17:00止（投票表决时间以本次大会召集人公告规定的收件人收到表决票的时间为准）进行了投票表决。会议审议通过了《关于易方达中小盘混合型证券投资基金变更基金名称、投资范围等相关事项的议案》，同意将基金名称由“易方达中小盘混合型证券投资基金”变更为“易方达优质精选混合型证券投资基金”，将投资范围扩大为包括内地市场上市交易的企业、香港市场挂牌交易的企业，相应调整基金投资策略和投资比例限制、业绩比较基准、开放日安排、估值条款、基金费用条款、收益分配政策等，并相应修订基金合同等法律文件。根据上述表决，本次基金份额持有人大会决定的事项自2021年9月9日起正式生效。

### 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

自2021年9月10日起原易方达中小盘混合型证券投资基金变更为易方达优质精选混合型证券投资基金。变更后，本基金在资产配置方面，结合宏观经济与市场分析，评估各类资产的预期收益与风险，在基金合同约定的范围内，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。股票投资方面，本基金基于深度的研究分析，在内地和香港市场精选具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的优质企业；本基金投资存托凭证的策略依照上述股票投资策略执行。其他投资策略方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资；可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上进行资产支持证券投资；根据风险管理的原则并综合考虑多种因素，可投资股指期货、国债期货、股票期权；可在符合有关法律法规、严格控制风险的前提下，进行证券借贷交易、回购交易、融资交易等。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

### 11.5.1 易方达优质精选混合型证券投资基金

易方达优质精选混合型证券投资基金自基金变更注册以来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，本报告期的审计费用为 40,247.68 元。

### 11.5.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

易方达中小盘混合型证券投资基金连续 14 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，本报告期的审计费用为 89,752.32 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 易方达优质精选混合型证券投资基金

（报告期：2021 年 9 月 10 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日）

#### 11.7.1.1 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	
银河证券	1	3,355,752,168.16	9.99%	2,013,451.28	8.64%	-
长城证券	1	1,278,309,888.15	3.81%	766,985.93	3.29%	-
东吴证券	2	3,345,068,029.46	9.96%	2,676,052.05	11.49%	-
中信建投	2	2,809,376,258.05	8.37%	2,247,501.12	9.65%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	1,683,947,438.29	5.02%	505,184.23	2.17%	-
Goldman Sachs	1	178,898,624.90	0.53%	89,449.30	0.38%	-
国泰君安	1	1,895,104,604.30	5.64%	1,516,078.68	6.51%	-
华金证券	1	2,084,236,492.80	6.21%	1,667,389.24	7.16%	-
长江证券	2	5,222,141,430.73	15.55%	4,177,707.63	17.93%	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	408,859,751.22	1.22%	286,201.84	1.23%	-

UBS Securities Asia Limited	1	151,402,258.18	0.45%	75,701.13	0.32%	-
安信证券	1	186,549,918.02	0.56%	149,240.06	0.64%	-
国信证券	2	3,140,332,439.29	9.35%	1,884,204.87	8.09%	-
光大证券	2	4,285,690,529.07	12.76%	2,571,429.67	11.04%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	300,616,209.49	0.90%	150,308.12	0.65%	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	179,762,204.43	0.54%	89,881.09	0.39%	-
天风证券	1	717,265,610.63	2.14%	573,816.59	2.46%	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	1	75,776,699.92	0.23%	37,888.35	0.16%	-
海通证券	1	2,275,891,997.66	6.78%	1,820,713.58	7.81%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金新增交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司，减少交易单元的证券公司为中邮证券有限责任公司，新增交易账户的机构为 Haitong International Securities Company Limited、China Intl Capital Corp HK Secs Ltd、Citigroup Global Markets Limited、Goldman Sachs、Credit Suisse (Hong Kong) Limited、Morgan Stanley & Co. International PLC、UBS Securities Asia Limited。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。基金交易账户的开立标准如下：

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训

服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

#### 11.7.1.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	8,470,491.81	100.00%	-	-	-	-	-	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.7.2 易方达中小盘混合型证券投资基金

(报告期: 2021年1月1日-2021年9月9日)

#### 11.7.2.1 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	
安信证券	1	3,249,627,342.18	4.94%	2,599,704.33	5.31%	-
长城证券	1	3,770,738,985.19	5.73%	2,262,448.91	4.62%	-
长江证券	2	16,086,694,488.64	24.45%	12,869,351.16	26.30%	-
东吴证券	2	9,486,740,059.60	14.42%	7,589,391.06	15.51%	-
光大证券	2	2,624,188,614.41	3.99%	1,743,268.32	3.56%	-
国泰君安	1	464,564,970.03	0.71%	371,653.42	0.76%	-
国信证券	2	9,325,578,387.80	14.17%	5,595,357.06	11.43%	-
海通证券	1	7,041,508,280.21	10.70%	5,633,206.60	11.51%	-
华金证券	1	2,016,654,984.81	3.06%	1,613,324.02	3.30%	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	639,532,405.09	0.97%	511,625.28	1.05%	-
新时代证券	1	1,173,639,279.93	1.78%	938,912.85	1.92%	-
银河证券	1	4,079,173,008.53	6.20%	2,531,353.60	5.17%	-
中泰证券	1	598,168,449.59	0.91%	478,534.74	0.98%	-
中信建投	2	5,242,403,643.67	7.97%	4,193,924.27	8.57%	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注: a) 本报告期内新增交易单元的证券公司为光大证券股份有限公司、国信证券股份有限公司, 无减少交易单元。

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

1) 经营行为稳健规范, 内控制度健全, 在业内有良好的声誉;

2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施满足基金进行证券交易的需要;

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 有较好的研究能力和行业分析能力, 能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息; 能根据基金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。

#### 11.7.2.2 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
长城证券	67,204.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	72,079,200,000.00	21.51%	-	-
光大证券	-	-	7,157,600,000.00	2.14%	-	-
海通证券	-	-	140,685,600,000.00	41.98%	-	-
华金证券	-	-	13,353,600,000.00	3.98%	-	-
银河证券	-	-	86,857,000,000.00	25.92%	-	-
中信建投	-	-	14,967,800,000.00	4.47%	-	-

#### 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	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旗下部分开放式基金增加长城华西银行为销售机构的公告	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	2021-01-28
5	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
6	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加英大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	2021-02-10
7	易方达中小盘混合型证券投资基金在非直销销售机构、网上直销系统调整大额申购、大额转换转入业务金额限制的公告	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
8	易方达中小盘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
9	易方达中小盘混合型证券投资基金暂停申购、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
10	关于易方达中小盘混合型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	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	2021-03-10
11	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加植信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	2021-03-12
12	关于易方达中小盘混合型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	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	2021-03-24
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	关于易方达中小盘混合型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	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	2021-04-07
16	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
17	关于易方达中小盘混合型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告	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	2021-04-21
18	易方达基金管理有限公司关于终止攀枝花市	上海证券报、基金管理	2021-04-27

	商业银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配天坛生物(600161)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	2021-04-28
20	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	2021-07-17
21	易方达基金管理有限公司旗下基金2021年第二季度报告提示性公告	上海证券报	2021-07-20
22	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	2021-07-24
23	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	2021-07-24
24	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	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	2021-07-28
25	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购正元地理信息集团股份有限公司首次公开发行股票的公告	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	2021-07-28
26	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	2021-07-30
27	易方达基金管理有限公司关于拟召开易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会的预公告	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	2021-07-30
28	易方达基金管理有限公司关于以通讯方式召开易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	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	2021-08-02
29	易方达基金管理有限公司关于以通讯方式召开易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	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	2021-08-03
30	易方达基金管理有限公司关于以通讯方式召开易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	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	2021-08-04
31	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	上海证券报	2021-08-28
32	易方达基金管理有限公司关于易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	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	2021-09-10
33	易方达优质精选混合型证券投资基金开放日常赎回和转换转出业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2021-09-10



		金电子披露网站	
34	易方达优质精选混合型证券投资基金 2021 年 9 月 16 日至 2021 年 9 月 22 日暂停赎回及转换转出业务的公告	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	2021-09-13
35	易方达优质精选混合型证券投资基金 2021 年 9 月 29 日至 2021 年 9 月 30 日暂停赎回及转换转出业务的公告	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	2021-09-24
36	易方达优质精选混合型证券投资基金 2021 年 10 月 14 日暂停赎回及转换转出业务的公告	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	2021-10-11
37	易方达优质精选混合型证券投资基金 2021 年 10 月 13 日暂停赎回及转换转出业务的公告	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	2021-10-13
38	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	上海证券报	2021-10-27
39	易方达基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	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	2021-11-15
40	易方达基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	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	2021-12-10
41	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	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	2021-12-17
42	易方达优质精选混合型证券投资基金 2021 年 12 月 24 日至 2021 年 12 月 27 日暂停赎回及转换转出业务的公告	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	2021-12-21
43	易方达优质精选混合型证券投资基金 2021 年 12 月 29 日至 2021 年 12 月 31 日暂停赎回及转换转出业务的公告	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	2021-12-24
44	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	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	2021-12-25
45	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金单笔赎回最低份额及最低持有份额限制的公告	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	2021-12-29

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金的文件；

2、《易方达优质精选混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《易方达优质精选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。

## 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日