

易方达安心回报债券型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

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

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

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | | |
|-----|--|----|
| § 1 | 重要提示及目录..... | 2 |
| 1.1 | 重要提示..... | 2 |
| 1.2 | 目录..... | 3 |
| § 2 | 基金简介..... | 5 |
| 2.1 | 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 | 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 | 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 | 其他相关资料..... | 6 |
| § 3 | 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况..... | 7 |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 | 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 | 过去三年基金的利润分配情况..... | 11 |
| § 4 | 管理人报告..... | 12 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 17 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 17 |
| 4.4 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 19 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 19 |
| 4.6 | 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 20 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 22 |
| 4.8 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 22 |
| § 5 | 托管人报告..... | 22 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 22 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 22 |
| 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..... | 22 |
| § 6 | 审计报告..... | 23 |
| 6.1 | 审计意见..... | 23 |
| 6.2 | 形成审计意见的基础..... | 23 |
| 6.3 | 其他信息..... | 23 |
| 6.4 | 管理层和治理层对财务报表的责任..... | 23 |
| 6.5 | 注册会计师对财务报表审计的责任..... | 24 |
| § 7 | 年度财务报表..... | 25 |
| 7.1 | 资产负债表..... | 25 |
| 7.2 | 利润表..... | 26 |
| 7.3 | 所有者权益（基金净值）变动表..... | 28 |
| 7.4 | 报表附注..... | 29 |
| § 8 | 投资组合报告..... | 60 |
| 8.1 | 期末基金资产组合情况..... | 60 |
| 8.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 60 |
| 8.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 61 |
| 8.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 62 |

| | | |
|------|---|----|
| 8.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 63 |
| 8.6 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 64 |
| 8.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 64 |
| 8.8 | 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 65 |
| 8.9 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 65 |
| 8.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 66 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 66 |
| 8.12 | 投资组合报告附注 | 66 |
| § 9 | 基金份额持有人信息 | 68 |
| 9.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 68 |
| 9.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 69 |
| 9.3 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 69 |
| § 10 | 开放式基金份额变动 | 69 |
| § 11 | 重大事件揭示 | 70 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 | 70 |
| 11.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 70 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 70 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 | 70 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 70 |
| 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 | 70 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 71 |
| 11.8 | 其他重大事件 | 72 |
| § 12 | 备查文件目录 | 74 |
| 12.1 | 备查文件目录 | 74 |
| 12.2 | 存放地点 | 75 |
| 12.3 | 查阅方式 | 75 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---------------------|--------------------|
| 基金名称 | 易方达安心回报债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 易方达安心回报债券 | |
| 基金主代码 | 110027 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011年6月21日 | |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 13,960,726,987.16 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 110027 | 110028 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 11,945,143,015.60 份 | 2,015,583,971.56 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金力争战胜通货膨胀和银行定期存款利率，主要面向以储蓄存款为主要投资工具的中小投资者，追求基金资产的长期、持续、稳定增值，努力为投资者实现有吸引力的回报，为投资者提供养老投资的工具。 |
| 投资策略 | 本基金采取稳健的资产配置策略，通过自上而下的方法进行固定收益类品种与权益类品种的战略及战术资产配置，在控制基金资产净值波动、追求收益稳定的基础上，提高基金的收益水平。具体来看，本基金主要通过研究各类资产在较长时期的收益与风险水平特征，及各类资产收益与风险间的相关关系，对国内外宏观经济形势与政策、市场利率走势、信用利差水平、利率期限结构以及证券市场走势等因素进行分析，在本基金合同约定范围内制定合理的战略资产配置计划。固定收益品种投资方面，本基金将经济分为衰退、萧条、复苏、繁荣四个阶段，并在各个阶段通过投资不同的固定收益类属资产，以获得超越长期平均通胀水平的回报。权益类品种投资方面，本基金采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略，严格管理权益类品种的投资比例以 |

| | |
|--------|--|
| | 及净值的波动幅度。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 | 三年期银行定期存款收益率（税后）+1.0% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|-----------------------------------|---------------------|
| 名称 | | 易方达基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 张南 | 郭明 |
| | 联系电话 | 020-85102688 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400 881 8088 | 95588 |
| 传真 | | 020-38798812 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 办公地址 | | 广州市天河区珠江新城珠江东路 30号广州银行大厦40-43楼 | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 邮政编码 | | 510620 | 100140 |
| 法定代表人 | | 刘晓艳 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

| | |
|--|---------------|
| | 州银行大厦 40-43 楼 |
|--|---------------|

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2021 年 | | 2020 年 | | 2019 年 | |
|---------------|-------------------|------------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B |
| 本期已实现收益 | 818,404,381.34 | 152,047,842.49 | 979,991,120.61 | 338,475,665.50 | 323,694,063.03 | 250,482,371.44 |
| 本期利润 | 1,304,178,118.70 | 243,853,359.03 | 1,268,838,371.91 | 410,036,981.43 | 1,094,604,121.13 | 853,273,945.69 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1337 | 0.1133 | 0.2167 | 0.1831 | 0.2879 | 0.3232 |
| 本期加权平均净值利润率 | 6.44% | 5.55% | 11.66% | 10.07% | 17.46% | 19.91% |
| 本期基金份额净值增长率 | 8.03% | 7.58% | 14.49% | 14.03% | 20.87% | 20.34% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末 | | 2020 年末 | | 2019 年末 | |
| | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B |
| 期末可供分配利润 | 1,628,771,245.58 | 246,990,049.57 | 1,376,516,188.78 | 330,811,630.39 | 291,864,190.57 | 119,574,184.37 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1364 | 0.1225 | 0.2373 | 0.2129 | 0.0655 | 0.0509 |
| 期末基金资产净值 | 23,829,642,961.55 | 3,975,286,673.12 | 11,690,040,034.91 | 3,081,369,747.90 | 7,846,208,081.87 | 4,089,127,417.55 |
| 期末基金份额 | 1.995 | 1.972 | 2.015 | 1.983 | 1.760 | 1.739 |

| 净值 | | | | | | |
|---|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 3.1.3 累计 期末指标 | 2021 年末 | | 2020 年末 | | 2019 年末 | |
| | 易方达安心 回报债券 A | 易方达安心 回报债券 B | 易方达安心 回报债券 A | 易方达安心 回报债券 B | 易方达安心 回报债券 A | 易方达安心回 报债券 B |
| 基金份 额累 计 净 值 增 长 率 | 281.52% | 267.98% | 253.15% | 242.06% | 208.46% | 199.97% |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达安心回报债券 A

| 阶段 | 份额净值增 长率① | 份额净值增 长率标准差 ② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 1.91% | 0.26% | 0.95% | 0.01% | 0.96% | 0.25% |
| 过去六个月 | 2.29% | 0.34% | 1.89% | 0.01% | 0.40% | 0.33% |
| 过去一年 | 8.03% | 0.43% | 3.75% | 0.01% | 4.28% | 0.42% |
| 过去三年 | 49.49% | 0.52% | 11.25% | 0.01% | 38.24% | 0.51% |
| 过去五年 | 55.96% | 0.53% | 18.75% | 0.01% | 37.21% | 0.52% |
| 自基金合同生 效起至今 | 281.52% | 0.73% | 47.06% | 0.01% | 234.46% | 0.72% |

易方达安心回报债券 B

| 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 | 1.83% | 0.27% | 0.95% | 0.01% | 0.88% | 0.26% |
| 过去六个月 | 2.07% | 0.34% | 1.89% | 0.01% | 0.18% | 0.33% |
| 过去一年 | 7.58% | 0.43% | 3.75% | 0.01% | 3.83% | 0.42% |
| 过去三年 | 47.62% | 0.52% | 11.25% | 0.01% | 36.37% | 0.51% |
| 过去五年 | 53.14% | 0.53% | 18.75% | 0.01% | 34.39% | 0.52% |
| 自基金合同生 效起至今 | 267.98% | 0.73% | 47.06% | 0.01% | 220.92% | 0.72% |

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

易方达安心回报债券型证券投资基金

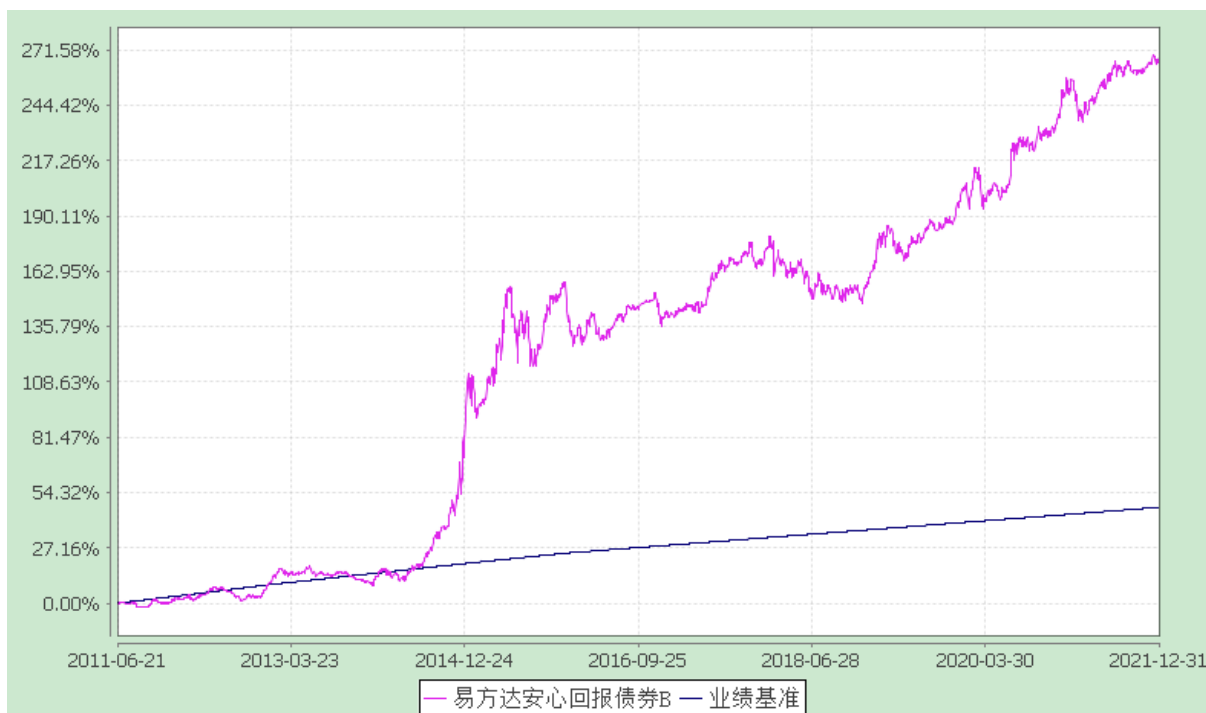
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年6月21日至2021年12月31日)

易方达安心回报债券 A



易方达安心回报债券 B



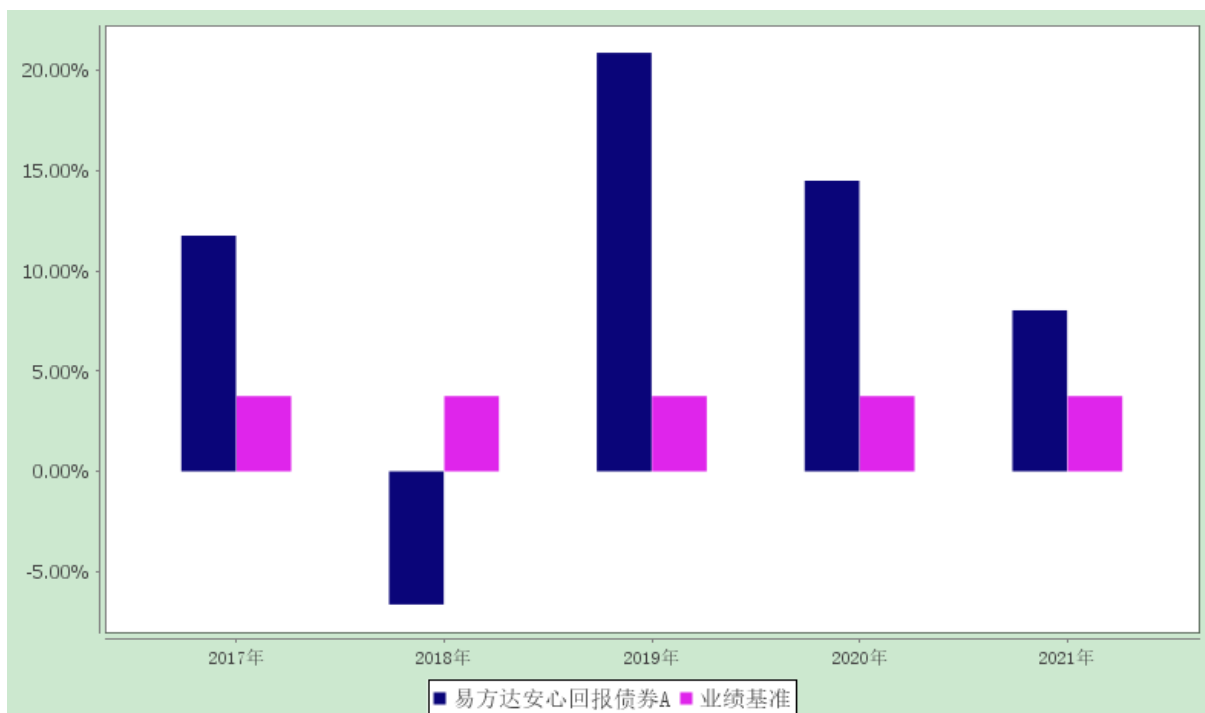
注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 281.52%，B 类基金份额净值增长率为 267.98%，同期业绩比较基准收益率为 47.06%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

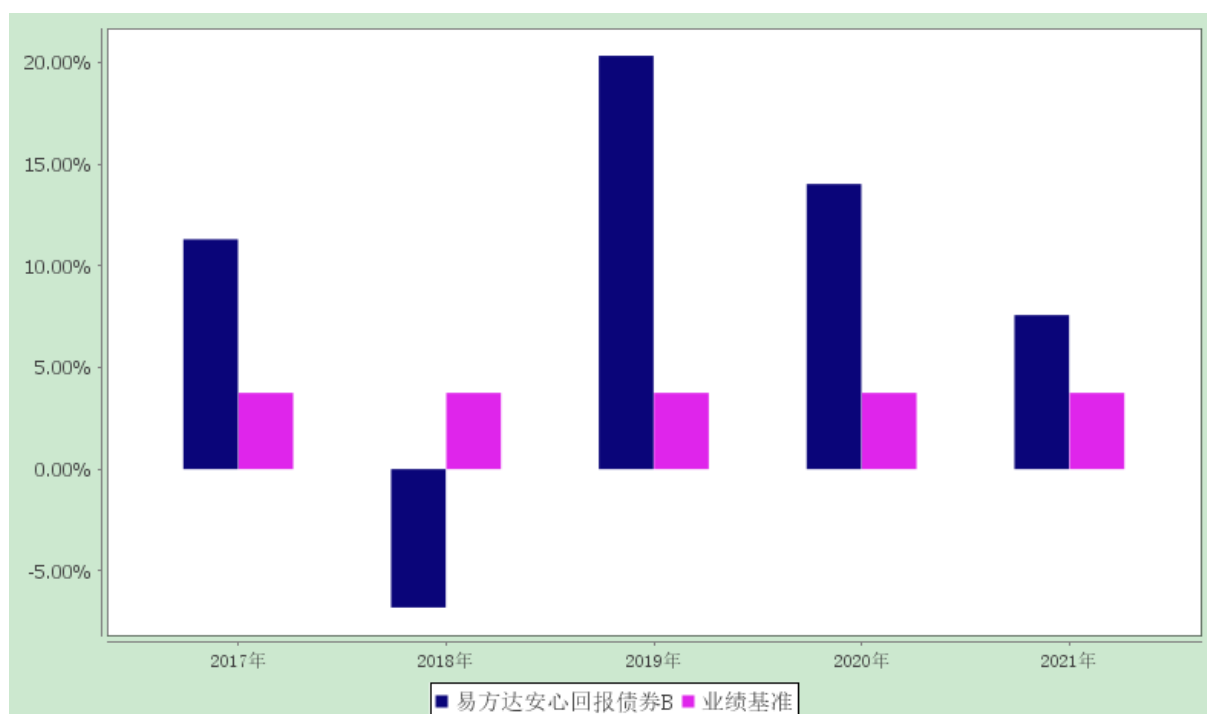
易方达安心回报债券型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达安心回报债券 A



易方达安心回报债券 B



3.3 过去三年基金的利润分配情况

易方达安心回报债券 A

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 | 1.780 | 1,136,043,123.58 | 921,268,290.71 | 2,057,311,414.29 | - |
| 2020年 | - | - | - | - | - |
| 2019年 | 0.350 | 88,138,698.20 | 44,759,087.61 | 132,897,785.81 | - |
| 合计 | 2.130 | 1,224,181,821.78 | 966,027,378.32 | 2,190,209,200.10 | - |

易方达安心回报债券 B

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 | 1.580 | 259,015,091.39 | 103,466,350.14 | 362,481,441.53 | - |
| 2020年 | - | - | - | - | - |
| 2019年 | 0.350 | 104,267,690.11 | 31,639,842.30 | 135,907,532.41 | - |
| 合计 | 1.930 | 363,282,781.50 | 135,106,192.44 | 498,388,973.94 | - |

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的 基金经理（助 理）期限 | | 证券 从业 年限 | 说明 |
|-----|---|-------------------------|----------|----------------|--|
| | | 任职 日期 | 离任 日期 | | |
| 张清华 | 本基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金的基金经理（自 2015 年 05 月 29 日至 2021 年 09 月 07 日）、易方达裕祥回报债券型证券投资基金的基金经理（自 2016 年 01 月 22 日至 2021 年 09 月 07 日）、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理（自 2020 年 09 月 03 日至 2021 年 09 月 17 日）、副总经理级高级管理人员、多资产投资业务总部总经理、固定收益投资决策委员会委员 | 2013-12-23 | - | 14 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师，中信证券股份有限公司研究员，易方达基金管理有限公司投资经理、固定收益基金投资部总经理、混合资产投资部总经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞通灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞程灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金基金经理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资 |

| | | | | | |
|-----|--|------------|---|------|---|
| | | | | | 资基金基金经理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金基金经理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金基金经理 |
| 张雅君 | <p>本基金的基金经理助理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达富财纯债债券型证券投资基金的基金经理（自 2018 年 10 月 26 日至 2021 年 06 月 11 日）、易方达悦通一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达磐恒九个月持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达稳泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金的基金经理、易方达宁易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 11 月 15 日至 2021 年 01 月 29 日）、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 11 月 15 日至 2021 年 02 月 10 日）、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 01 月 31 日至 2021 年 01 月 29 日）、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 03 月 06 日至 2021 年 01 月 29 日）、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 04 月 04 日至 2021 年 02 月 10 日）、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、多资产公募投资部总</p> | 2015-02-17 | - | 12 年 | <p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任海通证券股份有限公司项目经理，工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员、固定收益研究员、固定收益基金投资部总经理助理、混合资产投资部总经理助理、多资产公募投资部负责人、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理、易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、易方达富惠纯债债券型证券投资基金基金经理、易方达中债 3-5 年期国债指数证券投资基金基金经理、易方达中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理、易方达恒兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理</p> |

| | | | | | |
|----|--|------------|---|-----|---|
| | 经理 | | | | |
| 杨康 | <p>本基金的基金经理助理、易方达鑫转增利混合型证券投资基金的基金经理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理、易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达瑞锦灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达瑞安灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理、易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 10 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理（自 2019 年 06 月 29 日至 2021 年 04 月 14 日）、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理</p> | 2019-06-19 | - | 6 年 | <p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部研究员、投资经理助理，易方达基金管理有限公司投资经理</p> |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|-----|--|
| | <p>助理(自 2019 年 07 月 31 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理(自 2019 年 07 月 31 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦通一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理助理(自 2020 年 07 月 09 日至 2021 年 11 月 30 日)、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐恒九个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦弘一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达宁易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理</p> | | | | |
| 周琼 | <p>本基金的基金经理助理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰华债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞信灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达安盈回报混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达丰和债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕鑫债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达富财纯债债券型证券投资基金的基金经理助理(自 2019 年 10 月 11 日至 2021 年 06 月 15 日)、易方达鑫转</p> | 2019-10-11 | - | 7 年 | <p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任凯仁投资咨询（上海）有限公司客户经理，易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员</p> |

| | | | | |
|---|--|--|--|--|
| <p>增利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞祺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转添利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达鑫转招利混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦兴一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦通一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达裕富债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞川灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达丰惠混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达招易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞锦灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达磐恒九个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达磐固六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、</p> | | | | |
|---|--|--|--|--|

| | | | | |
|---|--|--|--|--|
| <p>易方达悦享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞安灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理助理、易方达悦浦一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦弘一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦盈一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦安一年持有期债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达宁易一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳泰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦信一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦夏一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理、易方达悦丰一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理</p> | | | | |
|---|--|--|--|--|

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适

用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

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

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

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

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

债券市场方面，2021 全年在央行对流动性的呵护以及基本面走弱的背景下，债券市场整体表现强势，虽然在一季度、四季度初出现阶段性调整，但全年收益率明显下行，1 年期和 10 年期国债收益率全年分别下行 25bp 和 40bp。信用利差在 2020 年底经历信用风险事件冲击走阔后，2021 年上半年跟随收益率回落，下半年稳定在较低水平。

股票市场在 2021 年呈现了极大的分化，行业轮动迅速，景气度和宏观政策是主要的拐点驱动力，市场更多关注短期的盈利动量。全年中证 500 显著跑赢沪深 300，市场相对偏好中小市值的个股，这给组合管理带来了不小的挑战。回顾全年，投资策略上，上半年还能相对适应市场，进入下半年，随着能耗双控持续加码，上游原材料价格大幅上涨，供给紧张对以制造业为主的高成长板块形成了较大的成本和需求冲击，同时医疗政策的调整对于医药行业也带来了较大的冲击。

转债市场方面，正股与估值双重驱动，全年表现亮眼。年初受到小盘股表现较差和信用风险拖累，低价转债遭遇双杀；春节后市场风格反转，受益于正股成分股中证 2000 占比较高，转债迎来平价和估值双击，叠加普遍的不赎回现象，估值从历史低位拉升至历史极高水平。行业层面，转债正股成分股中周期、成长和泛新能源占比较高，较好地契合了贯穿全年的强势板块。

报告期内，本基金规模大幅增长。股票方面，组合全年保持了偏高的仓位，在持续净申购的过程中，灵活调整新增资金的建仓节奏，在三季度主动放缓了买入节奏，年底股票仓位下降到 17% 左右；全年来看，股票换手率较低，行业配置集中在新能源、医药、计算机、化工行业，医药行业下半年给组合带来了较大的拖累。转债方面，仓位随申购有所下降，仍维持在 30% 以上，持有大盘转债为主，部分触发赎回的个券转股或卖出，补仓部分新券和低价券。债券方面，持仓以高等级信用债为主获取票息收益，同时择机参与利率债波段操作，关注信用风险，对持仓进行结构性调整，下半年杠杆水平有所提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.995 元，本报告期份额净值增长率为 8.03%，同期业绩比较基准收益率为 3.75%；B 类基金份额净值为 1.972 元，本报告期份额净值增长率为 7.58%，同期业绩比较基准收益率为 3.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年宏观经济的总体表现为外需强、内需弱。展望 2022 年，外需对经济的贡献预计会出现一定程度的下滑，主要源于全球经济复苏的高点可能已经过去，中国出口的份额也难以进一步提升，这会导致出口增速相比 2021 年出现下降。但同时国内需求可能会出现一定程度的修复：一方面国内

信贷条件和财政支持均出现好转，稳增长政策持续发力，在房住不炒背景下地产政策也出现了边际缓和，明确支持合理的住房需求，这对于内需有较为明显的托底作用；另一方面很多供给方面的限制政策有所放松，大宗商品价格出现一定回落，企业利润从上游向中下游转移，这有利于中下游企业预期的修复和整体生产状况的改善。

在资本市场层面，在盈利预期修复的背景下，权益市场整体仍有支撑。考虑到流动性以及盈利增速差异的变化，权益市场的极端分化行情预计会出现较为明显的收敛。2022 年内需回升会带来相关行业的盈利出现修复，带来结构性的机会。在经济企稳的背景下，债券市场利率继续大幅下行的空间较为有限，需要密切关注经济出现趋势性回升后债券市场可能面临的风险，在此之前在流动性宽松支持下利率仍然会保持震荡格局。

风险层面，一方面需要关注海外持续的通胀压力下货币政策超预期的退出风险，从历史上来看，这对全球资本市场都会产生压力。考虑到国内政策储备充足，人民币汇率弹性也较大，预计国内资本市场运行的趋势不会改变，但是需要密切关注阶段性冲击的出现。另一方面需要关注政策的变量，经历了过去两年的变化，很多行业的长期预期都发生了较大的变化，股票价值某种程度体现为企业未来长期现金流的折现，随着市场的变化，对于企业的定价我们需要不断地审视变与不变。

本基金债券部分仍将以中高等级信用债为主，保持一定的杠杆水平，降低信用风险暴露，以获取票息收益为主；权益部分将根据市场情况，适度加大自上而下资产配置的作用，优化个股持仓。同时保持组合的灵活性，根据市场变化及时调仓，力争以长期稳健的业绩回报基金持有人。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

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

(2) 坚持“守底线、保合规、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示；认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运

作的监控检查和反馈提示；持续完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

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

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

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

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

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

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

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

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

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和

控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达安心回报债券 A:本报告期内实施的利润分配金额为 2,057,311,414.29 元。

易方达安心回报债券 B:本报告期内实施的利润分配金额为 362,481,441.53 元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60468000_G12 号

易方达安心回报债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达安心回报债券型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

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

6.2 形成审计意见的基础

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

6.3 其他信息

易方达安心回报债券型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

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

治理层负责监督易方达安心回报债券型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

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

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达安心回报债券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安心回报债券型证券投资基金不能持续经营。

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

昌华 马婧

北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

2022年3月25日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达安心回报债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 1,118,596.59 | 1,492,980.94 |
| 结算备付金 | | 170,276,894.08 | 277,993,833.74 |
| 存出保证金 | | 390,219.20 | 561,963.56 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 34,576,108,950.61 | 17,918,795,606.10 |
| 其中：股票投资 | | 4,832,229,708.43 | 2,928,797,519.67 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 28,613,116,242.18 | 14,501,556,126.43 |
| 资产支持证券投资 | | 1,130,763,000.00 | 488,441,960.00 |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | 66,430,219.65 |
| 应收证券清算款 | | 751,920,815.14 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 317,136,260.95 | 153,704,035.34 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 36,327,482.95 | 60,323,002.67 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 35,853,279,219.52 | 18,479,301,642.00 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |

| | | | |
|-------------------|----------|--------------------------|--------------------------|
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 7,242,994,810.00 | 3,653,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 752,035,468.08 | 10,845,697.97 |
| 应付赎回款 | | 28,052,820.28 | 30,941,554.99 |
| 应付管理人报酬 | | 16,405,803.27 | 8,518,917.69 |
| 应付托管费 | | 4,687,372.39 | 2,433,976.49 |
| 应付销售服务费 | | 1,367,669.84 | 1,066,590.59 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 811,496.36 | 622,175.83 |
| 应交税费 | | 1,629,702.76 | 1,013,745.31 |
| 应付利息 | | 117,961.53 | -799,134.21 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 246,480.34 | 248,334.53 |
| 负债合计 | | 8,048,349,584.85 | 3,707,891,859.19 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 13,960,726,987.16 | 7,355,563,033.68 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 13,844,202,647.51 | 7,415,846,749.13 |
| 所有者权益合计 | | 27,804,929,634.67 | 14,771,409,782.81 |
| 负债和所有者权益总计 | | 35,853,279,219.52 | 18,479,301,642.00 |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.995 元，B 类基金份额净值 1.972 元；基金份额总额 13,960,726,987.16 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 11,945,143,015.60 份，B 类基金份额总额 2,015,583,971.56 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达安心回报债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|-----|----|---------|
|----|-----|----|---------|

| | | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 一、收入 | | 1,845,628,683.43 | 1,914,391,933.20 |
| 1.利息收入 | | 569,629,530.64 | 353,617,308.30 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 2,878,374.79 | 4,700,200.41 |
| 债券利息收入 | | 541,060,577.75 | 335,444,459.13 |
| 资产支持证券利息收入 | | 24,619,750.94 | 12,916,184.27 |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,070,827.16 | 556,464.49 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 684,825,657.50 | 1,190,064,964.66 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 323,339,163.37 | 632,531,617.73 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 343,097,669.85 | 527,444,946.98 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.1 | 111,319.80 | 643,690.88 |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 18,277,504.48 | 29,444,709.07 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 577,579,253.90 | 360,408,567.23 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 13,594,241.39 | 10,301,093.01 |
| 减：二、费用 | | 297,597,205.70 | 235,516,579.86 |
| 1. 管理人报酬 | | 172,186,947.31 | 104,596,201.48 |
| 2. 托管费 | | 49,196,270.66 | 29,884,628.97 |
| 3. 销售服务费 | | 17,629,141.01 | 16,313,709.46 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 4,203,234.81 | 8,327,061.73 |
| 5. 利息支出 | | 52,390,076.92 | 75,043,865.01 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 52,390,076.92 | 75,043,865.01 |
| 6. 税金及附加 | | 1,635,997.06 | 1,007,446.56 |

| | | | |
|----------------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 7. 其他费用 | 7.4.7.19 | 355,537.93 | 343,666.65 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,548,031,477.73 | 1,678,875,353.34 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,548,031,477.73 | 1,678,875,353.34 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达安心回报债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | | |
|--|----------------------------------|--------------------|--------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 7,355,563,033.68 | 7,415,846,749.13 | 14,771,409,782.81 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,548,031,477.73 | 1,548,031,477.73 |
| 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） | 6,605,163,953.48 | 7,300,117,276.47 | 13,905,281,229.95 |
| 其中：1.基金申购款 | 17,604,003,400.15 | 19,019,826,078.91 | 36,623,829,479.06 |
| 2.基金赎回款 | -10,998,839,446.67 | -11,719,708,802.44 | -22,718,548,249.11 |
| 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） | - | -2,419,792,855.82 | -2,419,792,855.82 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 13,960,726,987.16 | 13,844,202,647.51 | 27,804,929,634.67 |

| 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） | 6,809,370,166.76 | 5,125,965,332.66 | 11,935,335,499.42 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,678,875,353.34 | 1,678,875,353.34 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 546,192,866.92 | 611,006,063.13 | 1,157,198,930.05 |
| 其中：1.基金申购款 | 12,967,546,968.61 | 10,676,903,551.87 | 23,644,450,520.48 |
| 2.基金赎回款 | -12,421,354,101.69 | -10,065,897,488.74 | -22,487,251,590.43 |
| 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） | 7,355,563,033.68 | 7,415,846,749.13 | 14,771,409,782.81 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达安心回报债券型证券投资基金(以下简称“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[2011]665 号《关于核准易方达安心回报债券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《易方达安心回报债券型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达安心回报债券型证券投资基

金基金合同》于 2011 年 6 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,790,229,532.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 786,926.23 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2)金融负债分类

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

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

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

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

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

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

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

报价进行调整，确定公允价值。

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

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业

代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

(7) 债券投资收益/(损失)：

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 B 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(2)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 60%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(3)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;

(4)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;

(5)本基金收益分配的发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日;

(6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰,由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让,按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50% 计入应纳税所得额；

持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|----------------|------------------|------------------|
| | 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
| 活期存款 | 1,118,596.59 | 1,492,980.94 |
| 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 | 1,118,596.59 | 1,492,980.94 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | |
|---------------|------------------|-------------------|-------------------|----------------|
| | 2021 年 12 月 31 日 | | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 3,777,495,000.34 | 4,832,229,708.43 | 1,054,734,708.09 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 14,363,899,853.42 | 15,097,006,842.18 | 733,106,988.76 |
| | 银行间市场 | 13,446,728,254.99 | 13,516,109,400.00 | 69,381,145.01 |
| | 合计 | 27,810,628,108.41 | 28,613,116,242.18 | 802,488,133.77 |
| 资产支持证券 | 1,127,001,267.68 | 1,130,763,000.00 | 3,761,732.32 | |
| 基金 | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | |

| | | | | |
|---------------|--------------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| 合计 | | 32,715,124,376.43 | 34,576,108,950.61 | 1,860,984,574.18 |
| 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 | | 1,692,521,619.24 | 2,928,797,519.67 | 1,236,275,900.43 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 9,207,566,111.31 | 9,294,750,926.43 | 87,184,815.12 |
| | 银行间市场 | 5,247,282,042.20 | 5,206,805,200.00 | -40,476,842.20 |
| | 合计 | 14,454,848,153.51 | 14,501,556,126.43 | 46,707,972.92 |
| 资产支持证券 | | 488,020,513.07 | 488,441,960.00 | 421,446.93 |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 16,635,390,285.82 | 17,918,795,606.10 | 1,283,405,320.28 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | |
|-------|--------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | - | - |
| 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 | - | - |
| 银行间市场 | 66,430,219.65 | - |
| 合计 | 66,430,219.65 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 183.01 | 4,768.39 |
| 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 | 76,624.60 | 125,097.30 |
| 应收债券利息 | 308,948,254.04 | 149,032,170.07 |
| 应收资产支持证券利息 | 8,111,023.70 | 4,537,342.59 |
| 应收买入返售证券利息 | - | 4,404.09 |
| 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 | 175.60 | 252.90 |
| 合计 | 317,136,260.95 | 153,704,035.34 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 669,041.40 | 605,725.50 |
| 银行间市场应付交易费用 | 142,454.96 | 16,450.33 |
| 合计 | 811,496.36 | 622,175.83 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | 上年度末 |
|-------------|------------------|------------------|
| | 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 12 月 31 日 |
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 15,380.34 | 20,334.53 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 预提费用 | 231,100.00 | 228,000.00 |
| 合计 | 246,480.34 | 248,334.53 |

7.4.7.9 实收基金

易方达安心回报债券 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|---------------|-----------------------|-------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 5,801,601,804.89 | 5,801,601,804.89 |
| 本期申购 | 14,242,809,107.89 | 14,242,809,107.89 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,099,267,897.18 | -8,099,267,897.18 |
| 本期末 | 11,945,143,015.60 | 11,945,143,015.60 |

易方达安心回报债券 B

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|---------------|-----------------------|-------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,553,961,228.79 | 1,553,961,228.79 |
| 本期申购 | 3,361,194,292.26 | 3,361,194,292.26 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,899,571,549.49 | -2,899,571,549.49 |
| 本期末 | 2,015,583,971.56 | 2,015,583,971.56 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

易方达安心回报债券 A

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末 | 1,376,516,188.78 | 4,511,922,041.24 | 5,888,438,230.02 |
| 本期利润 | 818,404,381.34 | 485,773,737.36 | 1,304,178,118.70 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,491,162,089.75 | 5,258,032,921.77 | 6,749,195,011.52 |
| 其中：基金申购款 | 3,441,606,745.44 | 12,054,225,181.29 | 15,495,831,926.73 |
| 基金赎回款 | -1,950,444,655.69 | -6,796,192,259.52 | -8,746,636,915.21 |
| 本期已分配利润 | -2,057,311,414.29 | - | -2,057,311,414.29 |
| 本期末 | 1,628,771,245.58 | 10,255,728,700.37 | 11,884,499,945.95 |

易方达安心回报债券 B

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 | 330,811,630.39 | 1,196,596,888.72 | 1,527,408,519.11 |
| 本期利润 | 152,047,842.49 | 91,805,516.54 | 243,853,359.03 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 126,612,018.22 | 424,310,246.73 | 550,922,264.95 |
| 其中：基金申购款 | 729,092,638.60 | 2,794,901,513.58 | 3,523,994,152.18 |
| 基金赎回款 | -602,480,620.38 | -2,370,591,266.85 | -2,973,071,887.23 |
| 本期已分配利润 | -362,481,441.53 | - | -362,481,441.53 |
| 本期末 | 246,990,049.57 | 1,712,712,651.99 | 1,959,702,701.56 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |
| 活期存款利息收入 | 211,640.76 | 403,971.01 |
| 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 | 2,658,261.13 | 4,284,682.77 |
| 其他 | 8,472.90 | 11,546.63 |

| | | |
|----|--------------|--------------|
| 合计 | 2,878,374.79 | 4,700,200.41 |
|----|--------------|--------------|

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,169,045,061.81 | 3,127,689,513.83 |
| 减：卖出股票成本总额 | 845,705,898.44 | 2,495,157,896.10 |
| 买卖股票差价收入 | 323,339,163.37 | 632,531,617.73 |

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日 |
|-------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 16,795,215,576.03 | 18,133,001,489.26 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 16,245,679,530.76 | 17,396,652,677.71 |
| 减：应收利息总额 | 206,438,375.42 | 208,903,864.57 |
| 买卖债券差价收入 | 343,097,669.85 | 527,444,946.98 |

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日 |
|----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 371,236,106.56 | 269,614,592.04 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 361,331,513.07 | 262,093,553.23 |
| 减：应收利息总额 | 9,793,273.69 | 6,877,347.93 |
| 资产支持证券投资收益 | 111,319.80 | 643,690.88 |

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
| | | |

| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 18,277,504.48 | 29,444,709.07 |
| 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 | 18,277,504.48 | 29,444,709.07 |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 1.交易性金融资产 | 577,579,253.90 | 360,408,567.23 |
| ——股票投资 | -181,541,192.34 | 678,249,263.29 |
| ——债券投资 | 755,780,160.85 | -318,101,142.99 |
| ——资产支持证券投资 | 3,340,285.39 | 260,446.93 |
| ——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 | 577,579,253.90 | 360,408,567.23 |

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 13,593,966.28 | 10,299,905.37 |
| 其他 | 275.11 | 1,187.64 |
| 合计 | 13,594,241.39 | 10,301,093.01 |

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 4,035,317.31 | 8,171,729.23 |
| 银行间市场交易费用 | 167,917.50 | 155,332.50 |
| 合计 | 4,203,234.81 | 8,327,061.73 |

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 审计费用 | 111,100.00 | 108,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行汇划费 | 90,237.93 | 78,466.65 |
| 银行间账户维护费 | 33,000.00 | 36,000.00 |
| 其他 | 1,200.00 | 1,200.00 |
| 合计 | 355,537.93 | 343,666.65 |

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

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

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

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 172,186,947.31 | 104,596,201.48 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 24,695,851.23 | 13,743,048.84 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 49,196,270.66 | 29,884,628.97 |

注: 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算, 逐日累计至每月月末, 按月支付, 由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令, 基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等, 支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|-----------------------|---------------|---------------|
| | 2021年1月1日至2021年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B | 合计 |
| 易方达基金管理有限公司 | - | 7,236,268.21 | 7,236,268.21 |
| 中国工商银行 | - | 996,211.28 | 996,211.28 |
| 广发证券 | - | 420,162.43 | 420,162.43 |
| 合计 | - | 8,652,641.92 | 8,652,641.92 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2020年1月1日至2020年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B | 合计 |
| 易方达基金管理有限 | - | 10,175,221.78 | 10,175,221.78 |

| | | | |
|--------|---|---------------|---------------|
| 公司 | | | |
| 中国工商银行 | - | 827,378.56 | 827,378.56 |
| 广发证券 | - | 82,648.24 | 82,648.24 |
| 合计 | - | 11,085,248.58 | 11,085,248.58 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金销售服务费按前一日 B 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、基金份额持有人服务费等。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达安心回报债券 A

无。

易方达安心回报债券 B

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2021年1月1日至2021年12月31日 | | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日 | |
|-------------|-----------------------------|------------|----------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行-活期存款 | 1,118,596.59 | 211,640.76 | 1,492,980.94 | 403,971.01 |

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

易方达安心回报债券 A

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 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|----|------------|--------|----------------|--------------------------|----------------------|----------------|----------------------|----|
| | | 场 内 | 场 外 | | | | | |
| 1 | 2021-11-04 | - | 2021- 11-04 | 1.780 | 1,136,043,123. 58 | 921,268,290.71 | 2,057,311,414. 29 | - |
| 合计 | | | | 1.780 | 1,136,043,123. 58 | 921,268,290.71 | 2,057,311,414. 29 | - |

易方达安心回报债券 B

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 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|-----|------------|---------------|----------------|----------------|----------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2021-11-04 | - | 2021-11-04 | 1.580 | 259,015,091.39 | 103,466,350.14 | 362,481,441.53 | - |
| 合计 | | | | 1.580 | 259,015,091.39 | 103,466,350.14 | 362,481,441.53 | - |

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|----------|------------|------------|-----------|--------|--------|-----------|----------------|----------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 871245 | 威博液压 | 2021-12-24 | 2022-01-06 | 新股流通受限 | 9.68 | 9.68 | 200 | 1,936.00 | 1,936.00 | - |
| 000596 | 古井贡酒 | 2021-07-21 | 2022-01-24 | 非公开发行流通受限 | 200.00 | 238.13 | 1,130,000 | 226,000,000.00 | 269,086,900.00 | - |
| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 113052 | 兴业转债 | 2021-12-29 | 2022-01-14 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 49,290 | 4,928,956.79 | 4,928,956.79 | - |
| 184181 | G21 西轨 2 | 2021-12-28 | 2022-01-11 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 500,000 | 50,000,000.00 | 50,000,000.00 | - |
| 185114 | 21 北辰 | 2021-12-29 | 2022-01-04 | 新发流通 | 100.00 | 100.00 | 400,000 | 40,000,000.00 | 40,000,000.00 | - |

| | G2 | | | 受限 | | | | | | |
|--------------------------|----------|------------|------------|----------------|--------|--------|----------|---------------|---------------|----|
| 185190 | 21 诚通 23 | 2021-12-29 | 2022-01-04 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 550,000 | 55,000,000.00 | 55,000,000.00 | - |
| 7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 136815 | 光汇 01 优 | 2021-12-14 | 2022-01-26 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |
| 136820 | 瑞新 33A1 | 2021-12-14 | 2022-01-10 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 100,000 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 136852 | 国链 33A1 | 2021-12-22 | 2022-02-07 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |
| 136877 | 东华 011A | 2021-12-28 | 2022-01-27 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 300,000 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | - |
| 136882 | 链融 53A1 | 2021-12-27 | 2022-01-26 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |
| 183105 | 21 电 4A2 | 2021-12-13 | 2022-01-18 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 200,000 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |
| 183148 | G 国电优 | 2021-12-17 | - | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 100,000 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 183194 | 铁建 032A | 2021-12-21 | 2022-01-13 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 100,000 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 183208 | 铁建 033A | 2021-12-23 | 2022-01-10 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 100,000 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 183244 | G 电租 1A | 2021-12-23 | 2022-01-14 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 300,000 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | - |
| 193933 | 和皖 A | 2021-11-26 | 2022-02-18 | 新发 流通 受限 | 100.00 | 100.00 | 100,000 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股

票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,105,994,810.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值 单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|----------------------------|------------|------------|-----------|----------------|
| 190207 | 19 国开 07 | 2022-01-04 | 100.32 | 4,700,000 | 471,504,000.00 |
| 210203 | 21 国开 03 | 2022-01-04 | 102.11 | 7,000,000 | 714,770,000.00 |
| 210205 | 21 国开 05 | 2022-01-04 | 104.04 | 2,802,000 | 291,520,080.00 |
| 210210 | 21 国开 10 | 2022-01-04 | 102.16 | 700,000 | 71,512,000.00 |
| 210304 | 21 进出 04 | 2022-01-04 | 100.03 | 2,132,000 | 213,263,960.00 |
| 210404 | 21 农发 04 | 2022-01-04 | 99.99 | 1,394,000 | 139,386,060.00 |
| 012102717 | 21 鲁能源 SCP003 | 2022-01-05 | 100.23 | 900,000 | 90,207,000.00 |
| 101800323 | 18 赣水投 MTN002 | 2022-01-05 | 103.87 | 700,000 | 72,709,000.00 |
| 101900298 | 19 金隅 MTN001 | 2022-01-05 | 103.43 | 700,000 | 72,401,000.00 |
| 101901019 | 19 鲁能源 MTN001 | 2022-01-05 | 100.86 | 432,000 | 43,571,520.00 |
| 102000053 | 20 鲁能源 MTN001 | 2022-01-05 | 101.29 | 400,000 | 40,516,000.00 |
| 102000741 | 20 国盛 MTN001 | 2022-01-05 | 100.54 | 300,000 | 30,162,000.00 |
| 102000900 | 20 鲁能源 MTN003 | 2022-01-05 | 99.86 | 400,000 | 39,944,000.00 |
| 102001593 | 20 诚通控股 MTN001A | 2022-01-05 | 101.56 | 1,278,000 | 129,793,680.00 |
| 102002159 | 20 金融街 MTN002 | 2022-01-05 | 101.68 | 500,000 | 50,840,000.00 |
| 102101795 | 21 宝钢 MTN001(可持 续挂钩) | 2022-01-05 | 100.22 | 300,000 | 30,066,000.00 |
| 102101846 | 21 陕煤化 MTN006 | 2022-01-05 | 100.99 | 292,000 | 29,489,080.00 |

| | | | | | |
|-----------|-------------------|------------|--------|------------|------------------|
| 102101920 | 21 南昌轨交 MTN001 | 2022-01-05 | 101.50 | 500,000 | 50,750,000.00 |
| 102101948 | 21 华润 MTN001 | 2022-01-05 | 100.90 | 573,000 | 57,815,700.00 |
| 102103191 | 21 陕煤化 MTN010 | 2022-01-05 | 100.28 | 500,000 | 50,140,000.00 |
| 200302 | 20 进出 02 | 2022-01-05 | 99.98 | 300,000 | 29,994,000.00 |
| 210206 | 21 国开 06 | 2022-01-05 | 100.07 | 4,350,000 | 435,304,500.00 |
| 210304 | 21 进出 04 | 2022-01-05 | 100.03 | 351,000 | 35,110,530.00 |
| 210404 | 21 农发 04 | 2022-01-05 | 99.99 | 6,000 | 599,940.00 |
| 合计 | | | | 31,510,000 | 3,191,370,050.00 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4,137,000,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 日、2022 年 1 月 5 日、2022 年 1 月 6 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 96.46%(2020 年 12 月 31 日：97.36%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | 51,044,334.79 | 80,510,958.90 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 1,870,715,221.36 | 913,053,866.92 |
| 合计 | 1,921,759,556.15 | 993,564,825.82 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

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

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 20,888,783,672.29 | 11,927,268,215.80 |
| AAA 以下 | 2,969,245,276.02 | 1,729,755,254.88 |
| 未评级 | 3,142,275,991.76 | 0.00 |
| 合计 | 27,000,304,940.07 | 13,657,023,470.68 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 1,138,874,023.70 | 492,979,302.59 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 1,138,874,023.70 | 492,979,302.59 |

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|------------------|-------------------|------------------|------------------|-------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,118,596.59 | - | - | - | 1,118,596.59 |
| 结算备付金 | 170,276,894.08 | - | - | - | 170,276,894.08 |
| 存出保证金 | 390,219.20 | - | - | - | 390,219.20 |
| 交易性金融资产 | 4,449,485,613.40 | 21,762,642,890.74 | 3,531,750,738.04 | 4,832,229,708.43 | 34,576,108,950.61 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 751,920,815.14 | 751,920,815.14 |
| 应收利息 | - | - | - | 317,136,260.95 | 317,136,260.95 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 36,327,482.95 | 36,327,482.95 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 4,621,271,323.27 | 21,762,642,890.74 | 3,531,750,738.04 | 5,937,614,267.47 | 35,853,279,219.52 |
| 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 | 7,242,994,810.00 | - | - | - | 7,242,994,810.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 752,035,468.08 | 752,035,468.08 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 28,052,820.28 | 28,052,820.28 |

| | | | | | |
|-------------------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-------------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 16,405,803.27 | 16,405,803.27 |
| 应付托管费 | - | - | - | 4,687,372.39 | 4,687,372.39 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,367,669.84 | 1,367,669.84 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 811,496.36 | 811,496.36 |
| 应交税费 | - | - | - | 1,629,702.76 | 1,629,702.76 |
| 应付利息 | - | - | - | 117,961.53 | 117,961.53 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 246,480.34 | 246,480.34 |
| 负债总计 | 7,242,994,810.00 | - | - | 805,354,774.85 | 8,048,349,584.85 |
| 利率敏感度缺口 | -2,621,723,486.73 | 21,762,642,890.74 | 3,531,750,738.04 | 5,132,259,492.62 | 27,804,929,634.67 |
| 上年度末 | | | | | |
| 2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,492,980.94 | - | - | - | 1,492,980.94 |
| 结算备付金 | 277,993,833.74 | - | - | - | 277,993,833.74 |
| 存出保证金 | 561,963.56 | - | - | - | 561,963.56 |
| 交易性金融资产 | 2,374,529,843.80 | 11,403,701,196.12 | 1,211,767,046.51 | 2,928,797,519.67 | 17,918,795,606.10 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 66,430,219.65 | - | - | - | 66,430,219.65 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 153,704,035.34 | 153,704,035.34 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 60,323,002.67 | 60,323,002.67 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 2,721,008,841.69 | 11,403,701,196.12 | 1,211,767,046.51 | 3,142,824,557.68 | 18,479,301,642.00 |
| 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 | 3,653,000,000.00 | - | - | - | 3,653,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 10,845,697.97 | 10,845,697.97 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 30,941,554.99 | 30,941,554.99 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 8,518,917.69 | 8,518,917.69 |
| 应付托管费 | - | - | - | 2,433,976.49 | 2,433,976.49 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,066,590.59 | 1,066,590.59 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 622,175.83 | 622,175.83 |
| 应交税费 | - | - | - | 1,013,745.31 | 1,013,745.31 |
| 应付利息 | - | - | - | -799,134.21 | -799,134.21 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 248,334.53 | 248,334.53 |
| 负债总计 | 3,653,000,000.00 | - | - | 54,891,859.19 | 3,707,891,859.19 |
| 利率敏感度缺口 | -931,991,158.31 | 11,403,701,196.12 | 1,211,767,046.51 | 3,087,932,698.49 | 14,771,409,782.81 |

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---------------|--------------------|---------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2021年12月31日 | 上年度末 2020年12月31日 |
| | 1.市场利率下降25个基点 | 117,669,121.33 | 38,240,955.11 |
| 2.市场利率上升25个基点 | -116,481,172.87 | -37,982,083.02 | |

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 | |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 4,832,229,708.43 | 17.38 | 2,928,797,519.67 | 19.83 |
| 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 | 4,832,229,708.43 | 17.38 | 2,928,797,519.67 | 19.83 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---------------|----------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2021 年 12 月 31 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| | 1.业绩比较基准上升 5% | 694,373,898.08 | 405,665,715.31 |
| 2.业绩比较基准下降 5% | -694,373,898.08 | -405,665,715.31 | |

注：股票投资业绩基准取上证 A 指。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 12,284,823,433.61 元,属于第二层次的余额为 22,291,285,517.00 元,无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日:第一层次 8,218,133,722.10 元,第二层次 9,700,661,884.00 元,无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公开募集证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 4,832,229,708.43 | 13.48 |
| | 其中：股票 | 4,832,229,708.43 | 13.48 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 29,743,879,242.18 | 82.96 |
| | 其中：债券 | 28,613,116,242.18 | 79.81 |
| | 资产支持证券 | 1,130,763,000.00 | 3.15 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 171,395,490.67 | 0.48 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,105,774,778.24 | 3.08 |
| 9 | 合计 | 35,853,279,219.52 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 4,012,356,404.12 | 14.43 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 153,813,187.48 | 0.55 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| J | 金融业 | 136,417,226.00 | 0.49 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 307,067,297.46 | 1.10 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 222,575,593.37 | 0.80 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,832,229,708.43 | 17.38 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 601012 | 隆基股份 | 8,293,300 | 714,882,460.00 | 2.57 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 11,652,813 | 609,675,176.16 | 2.19 |
| 3 | 000661 | 长春高新 | 2,204,152 | 598,206,852.80 | 2.15 |
| 4 | 600486 | 扬农化工 | 2,677,959 | 351,348,220.80 | 1.26 |
| 5 | 000596 | 古井贡酒 | 1,420,936 | 340,075,284.00 | 1.22 |
| 6 | 603259 | 药明康德 | 2,589,537 | 307,067,297.46 | 1.10 |
| 7 | 603806 | 福斯特 | 2,310,834 | 301,679,378.70 | 1.08 |
| 8 | 300628 | 亿联网络 | 2,775,755 | 226,085,244.75 | 0.81 |
| 9 | 603882 | 金域医学 | 1,770,601 | 197,191,833.37 | 0.71 |
| 10 | 300782 | 卓胜微 | 589,318 | 192,589,122.40 | 0.69 |
| 11 | 688188 | 柏楚电子 | 399,038 | 153,813,187.48 | 0.55 |
| 12 | 300558 | 贝达药业 | 1,830,770 | 146,150,369.10 | 0.53 |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 2,800,600 | 136,417,226.00 | 0.49 |
| 14 | 600426 | 华鲁恒升 | 4,259,333 | 133,317,122.90 | 0.48 |
| 15 | 002250 | 联化科技 | 6,348,596 | 114,084,270.12 | 0.41 |
| 16 | 600809 | 山西汾酒 | 336,000 | 106,102,080.00 | 0.38 |
| 17 | 000860 | 顺鑫农业 | 2,393,962 | 91,401,469.16 | 0.33 |
| 18 | 600161 | 天坛生物 | 1,741,912 | 50,445,771.52 | 0.18 |
| 19 | 300132 | 青松股份 | 3,215,899 | 36,307,499.71 | 0.13 |
| 20 | 002044 | 美年健康 | 3,233,600 | 25,383,760.00 | 0.09 |
| 21 | 600887 | 伊利股份 | 100 | 4,146.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 22 | 871245 | 威博液压 | 200 | 1,936.00 | 0.00 |
|----|--------|------|-----|----------|------|

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1 | 000661 | 长春高新 | 533,535,370.16 | 3.61 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 501,465,981.99 | 3.39 |
| 3 | 601012 | 隆基股份 | 358,169,218.74 | 2.42 |
| 4 | 603882 | 金域医学 | 231,428,624.97 | 1.57 |
| 5 | 300558 | 贝达药业 | 230,332,096.74 | 1.56 |
| 6 | 000596 | 古井贡酒 | 226,000,000.00 | 1.53 |
| 7 | 300782 | 卓胜微 | 185,258,724.15 | 1.25 |
| 8 | 600426 | 华鲁恒升 | 180,055,331.25 | 1.22 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 137,718,372.18 | 0.93 |
| 10 | 600570 | 恒生电子 | 93,553,333.16 | 0.63 |
| 11 | 688188 | 柏楚电子 | 85,331,858.97 | 0.58 |
| 12 | 600588 | 用友网络 | 72,230,370.67 | 0.49 |
| 13 | 600161 | 天坛生物 | 48,999,984.56 | 0.33 |
| 14 | 601658 | 邮储银行 | 27,960,540.00 | 0.19 |
| 15 | 002250 | 联化科技 | 18,391,255.00 | 0.12 |
| 16 | 601728 | 中国电信 | 135,900.00 | 0.00 |
| 17 | 600905 | 三峡能源 | 87,450.00 | 0.00 |
| 18 | 601825 | 沪农商行 | 8,900.00 | 0.00 |
| 19 | 688538 | 和辉光电 | 5,300.00 | 0.00 |
| 20 | 600887 | 伊利股份 | 3,881.00 | 0.00 |

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1 | 603806 | 福斯特 | 419,173,938.28 | 2.84 |
| 2 | 601012 | 隆基股份 | 126,581,150.98 | 0.86 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 88,040,270.00 | 0.60 |
| 4 | 600161 | 天坛生物 | 79,215,587.84 | 0.54 |
| 5 | 600570 | 恒生电子 | 77,510,212.09 | 0.52 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 6 | 600588 | 用友网络 | 66,087,659.78 | 0.45 |
| 7 | 002938 | 鹏鼎控股 | 59,371,411.50 | 0.40 |
| 8 | 000661 | 长春高新 | 58,371,206.46 | 0.40 |
| 9 | 603712 | 七一二 | 46,862,686.17 | 0.32 |
| 10 | 600426 | 华鲁恒升 | 44,806,666.42 | 0.30 |
| 11 | 300628 | 亿联网络 | 39,129,713.70 | 0.26 |
| 12 | 688008 | 澜起科技 | 35,204,821.18 | 0.24 |
| 13 | 601658 | 邮储银行 | 28,238,631.41 | 0.19 |
| 14 | 600905 | 三峡能源 | 236,601.00 | 0.00 |
| 15 | 601728 | 中国电信 | 183,776.00 | 0.00 |
| 16 | 601825 | 沪农商行 | 10,750.00 | 0.00 |
| 17 | 688538 | 和辉光电 | 8,448.00 | 0.00 |
| 18 | 688425 | 铁建重工 | 8,040.00 | 0.00 |
| 19 | 001213 | 中铁特货 | 3,491.00 | 0.00 |

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 2,930,679,279.54 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,169,045,061.81 |

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 4,806,392,000.00 | 17.29 |
| | 其中：政策性金融债 | 3,174,154,000.00 | 11.42 |
| 4 | 企业债券 | 5,560,726,280.00 | 20.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | 471,164,000.00 | 1.69 |
| 6 | 中期票据 | 8,902,741,900.00 | 32.02 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 8,872,092,062.18 | 31.91 |

| | | | |
|----|------|-------------------|--------|
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 28,613,116,242.18 | 102.91 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 113011 | 光大转债 | 8,770,390 | 982,459,087.80 | 3.53 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 7,991,970 | 945,929,569.20 | 3.40 |
| 3 | 132018 | G 三峡 EB1 | 6,162,640 | 862,153,336.00 | 3.10 |
| 4 | 110059 | 浦发转债 | 7,733,390 | 817,032,653.50 | 2.94 |
| 5 | 210203 | 21 国开 03 | 7,000,000 | 714,770,000.00 | 2.57 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 159647 | PR 凯晨 A1 | 1,500,000 | 150,780,000.00 | 0.54 |
| 2 | 193797 | 21 工鑫 8A | 700,000 | 70,350,000.00 | 0.25 |
| 3 | 189847 | 21LJZ 优 | 500,000 | 50,345,000.00 | 0.18 |
| 4 | 136594 | 荟柒 4A | 500,000 | 50,095,000.00 | 0.18 |
| 5 | 193676 | 至博 03A1 | 400,000 | 40,168,000.00 | 0.14 |
| 6 | 179213 | 华文 01 优 | 400,000 | 40,120,000.00 | 0.14 |
| 7 | 137699 | 绿金 15A1 | 300,000 | 30,213,000.00 | 0.11 |
| 8 | 193256 | 明远 03A3 | 300,000 | 30,147,000.00 | 0.11 |
| 9 | 136877 | 东华 011A | 300,000 | 30,000,000.00 | 0.11 |
| 9 | 183244 | G 电租 1A | 300,000 | 30,000,000.00 | 0.11 |
| 11 | 137630 | 21 中交 1A | 200,000 | 20,154,000.00 | 0.07 |
| 12 | 137991 | 济建 1 优 | 200,000 | 20,150,000.00 | 0.07 |
| 13 | 137657 | 中铁 8 优 A | 200,000 | 20,142,000.00 | 0.07 |
| 13 | 137684 | 潮鸣 1 优 | 200,000 | 20,142,000.00 | 0.07 |
| 15 | 193677 | 至博 03A2 | 200,000 | 20,120,000.00 | 0.07 |
| 16 | 137000 | 信借 05A | 200,000 | 20,064,000.00 | 0.07 |
| 17 | 193545 | 至通 01A1 | 200,000 | 20,030,000.00 | 0.07 |
| 17 | 193552 | 至博 02A1 | 200,000 | 20,030,000.00 | 0.07 |
| 19 | 189668 | 缙云 01 优 | 200,000 | 20,026,000.00 | 0.07 |
| 20 | 136815 | 光汇 01 优 | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.07 |
| 20 | 136852 | 国链 33A1 | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.07 |
| 20 | 136882 | 链融 53A1 | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|----|--------|----------|---------|---------------|------|
| 20 | 169017 | 光借 5A | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.07 |
| 20 | 183105 | 21 电 4A2 | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.07 |
| 25 | 169031 | 益行 06A1 | 100,000 | 10,113,000.00 | 0.04 |
| 26 | 168880 | 益行 04A1 | 100,000 | 10,097,000.00 | 0.04 |
| 27 | 168620 | 益行 03A1 | 100,000 | 10,092,000.00 | 0.04 |
| 28 | 137700 | 21 如樾 1A | 100,000 | 10,072,000.00 | 0.04 |
| 29 | 137655 | 仟金顶 1A | 100,000 | 10,070,000.00 | 0.04 |
| 30 | 193601 | 百新 01 优 | 100,000 | 10,059,000.00 | 0.04 |
| 31 | 137087 | 厚德 08A | 100,000 | 10,039,000.00 | 0.04 |
| 32 | 136077 | 荟享 061A | 100,000 | 10,037,000.00 | 0.04 |
| 33 | 136142 | 荟享 065A | 100,000 | 10,035,000.00 | 0.04 |
| 34 | 168605 | 健弘 03A | 100,000 | 10,033,000.00 | 0.04 |
| 34 | 168617 | 益行 02A1 | 100,000 | 10,033,000.00 | 0.04 |
| 36 | 136045 | 荟享 057A | 100,000 | 10,031,000.00 | 0.04 |
| 36 | 136702 | 至泰 3A2 | 100,000 | 10,031,000.00 | 0.04 |
| 38 | 168977 | 建借 1A | 100,000 | 10,030,000.00 | 0.04 |
| 39 | 136418 | 特建发优 | 100,000 | 10,029,000.00 | 0.04 |
| 40 | 136685 | 荟享 083A | 100,000 | 10,025,000.00 | 0.04 |
| 41 | 193538 | 至博 01A1 | 100,000 | 10,024,000.00 | 0.04 |
| 41 | 193553 | 至博 02A2 | 100,000 | 10,024,000.00 | 0.04 |
| 43 | 193546 | 至通 01A2 | 100,000 | 10,023,000.00 | 0.04 |
| 44 | 136339 | 荟享 067A | 100,000 | 10,013,000.00 | 0.04 |
| 45 | 169222 | 智禾 04A | 100,000 | 10,011,000.00 | 0.04 |
| 46 | 189980 | 华能 22 优 | 100,000 | 10,010,000.00 | 0.04 |
| 46 | 193443 | 至琛 04A2 | 100,000 | 10,010,000.00 | 0.04 |
| 48 | 136550 | 荟柒 7A | 100,000 | 10,009,000.00 | 0.04 |
| 49 | 136444 | 荟享 055A | 100,000 | 10,006,000.00 | 0.04 |
| 50 | 136781 | 荟享 085A | 100,000 | 10,002,000.00 | 0.04 |
| 50 | 189773 | 2 天智 02A | 100,000 | 10,002,000.00 | 0.04 |
| 52 | 136820 | 瑞新 33A1 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.04 |
| 52 | 183148 | G 国电优 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.04 |
| 52 | 183194 | 铁建 032A | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.04 |
| 52 | 183208 | 铁建 033A | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.04 |
| 52 | 193933 | 和皖 A | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.04 |
| 57 | 165814 | PR 安吉 5A | 300,000 | 3,927,000.00 | 0.01 |
| 58 | 165209 | PR 安吉 3A | 800,000 | 2,800,000.00 | 0.01 |

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、中国银行保险监督管理委员会上海监管局、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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------------|
| 1 | 存出保证金 | 390,219.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | 751,920,815.14 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 317,136,260.95 |
| 5 | 应收申购款 | 36,327,482.95 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,105,774,778.24 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产 净值比例 (%) |
|----|------|------|------|----------------------|
|----|------|------|------|----------------------|

| | | | | |
|----|--------|----------|----------------|------|
| 1 | 113011 | 光大转债 | 982,459,087.80 | 3.53 |
| 2 | 110053 | 苏银转债 | 945,929,569.20 | 3.40 |
| 3 | 132018 | G 三峡 EB1 | 862,153,336.00 | 3.10 |
| 4 | 110059 | 浦发转债 | 817,032,653.50 | 2.94 |
| 5 | 123111 | 东财转 3 | 614,539,138.08 | 2.21 |
| 6 | 113050 | 南银转债 | 383,251,495.20 | 1.38 |
| 7 | 113021 | 中信转债 | 271,268,674.20 | 0.98 |
| 8 | 110079 | 杭银转债 | 270,723,806.60 | 0.97 |
| 9 | 110073 | 国投转债 | 268,907,584.20 | 0.97 |
| 10 | 113025 | 明泰转债 | 240,340,478.10 | 0.86 |
| 11 | 113043 | 财通转债 | 192,383,059.70 | 0.69 |
| 12 | 110075 | 南航转债 | 183,154,990.50 | 0.66 |
| 13 | 113044 | 大秦转债 | 167,390,668.80 | 0.60 |
| 14 | 123107 | 温氏转债 | 161,906,080.36 | 0.58 |
| 15 | 110063 | 鹰 19 转债 | 124,300,800.00 | 0.45 |
| 16 | 110034 | 九州转债 | 112,303,314.00 | 0.40 |
| 17 | 113048 | 晶科转债 | 103,721,762.40 | 0.37 |
| 18 | 110061 | 川投转债 | 86,707,125.00 | 0.31 |
| 19 | 113013 | 国君转债 | 85,157,925.30 | 0.31 |
| 20 | 127030 | 盛虹转债 | 85,000,817.04 | 0.31 |
| 21 | 132008 | 17 山高 EB | 73,976,000.00 | 0.27 |
| 22 | 132009 | 17 中油 EB | 73,136,000.00 | 0.26 |
| 23 | 127022 | 恒逸转债 | 71,633,945.56 | 0.26 |
| 24 | 128129 | 青农转债 | 71,593,884.45 | 0.26 |
| 25 | 127005 | 长证转债 | 68,648,523.60 | 0.25 |
| 26 | 110048 | 福能转债 | 65,268,963.00 | 0.23 |
| 27 | 123004 | 铁汉转债 | 46,875,434.80 | 0.17 |
| 28 | 127032 | 苏行转债 | 41,944,538.24 | 0.15 |
| 29 | 128107 | 交科转债 | 33,203,650.56 | 0.12 |
| 30 | 127025 | 冀东转债 | 32,995,526.10 | 0.12 |
| 31 | 113051 | 节能转债 | 32,865,486.50 | 0.12 |
| 32 | 128128 | 齐翔转 2 | 31,679,965.40 | 0.11 |
| 33 | 113615 | 金诚转债 | 30,263,765.40 | 0.11 |
| 34 | 132020 | 19 蓝星 EB | 28,840,851.00 | 0.10 |
| 35 | 127029 | 中钢转债 | 18,410,077.70 | 0.07 |
| 36 | 113024 | 核建转债 | 18,268,600.00 | 0.07 |
| 37 | 110080 | 东湖转债 | 17,997,016.80 | 0.06 |
| 38 | 123086 | 海兰转债 | 17,962,028.00 | 0.06 |
| 39 | 113516 | 苏农转债 | 17,328,247.20 | 0.06 |
| 40 | 113026 | 核能转债 | 17,004,290.40 | 0.06 |
| 41 | 128144 | 利民转债 | 15,630,275.20 | 0.06 |
| 42 | 113033 | 利群转债 | 15,375,640.80 | 0.06 |
| 43 | 127033 | 中装转 2 | 13,496,234.40 | 0.05 |
| 44 | 113046 | 金田转债 | 12,804,904.00 | 0.05 |

| | | | | |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 45 | 128081 | 海亮转债 | 11,012,088.85 | 0.04 |
| 46 | 128109 | 楚江转债 | 10,767,887.20 | 0.04 |
| 47 | 113504 | 艾华转债 | 9,785,095.60 | 0.04 |
| 48 | 110077 | 洪城转债 | 9,176,755.50 | 0.03 |
| 49 | 110045 | 海澜转债 | 8,944,290.80 | 0.03 |
| 50 | 127012 | 招路转债 | 7,911,932.04 | 0.03 |
| 51 | 113009 | 广汽转债 | 7,575,199.40 | 0.03 |
| 52 | 123071 | 天能转债 | 7,175,159.90 | 0.03 |
| 53 | 118000 | 嘉元转债 | 6,569,854.20 | 0.02 |
| 54 | 128130 | 景兴转债 | 6,303,891.66 | 0.02 |
| 55 | 113568 | 新春转债 | 4,399,612.80 | 0.02 |
| 56 | 128108 | 蓝帆转债 | 4,210,870.70 | 0.02 |
| 57 | 113605 | 大参转债 | 3,965,809.20 | 0.01 |
| 58 | 110055 | 伊力转债 | 3,695,990.00 | 0.01 |
| 59 | 113042 | 上银转债 | 3,454,904.80 | 0.01 |
| 60 | 128134 | 鸿路转债 | 3,289,025.40 | 0.01 |
| 61 | 127027 | 靖远转债 | 3,228,182.08 | 0.01 |
| 62 | 127017 | 万青转债 | 3,144,942.20 | 0.01 |
| 63 | 128048 | 张行转债 | 3,099,905.50 | 0.01 |
| 64 | 123108 | 乐普转 2 | 3,022,530.74 | 0.01 |
| 65 | 110062 | 烽火转债 | 2,827,508.50 | 0.01 |
| 66 | 113610 | 灵康转债 | 2,776,774.40 | 0.01 |
| 67 | 113039 | 嘉泽转债 | 2,601,009.20 | 0.01 |
| 68 | 113037 | 紫银转债 | 2,453,048.10 | 0.01 |
| 69 | 123092 | 天壕转债 | 1,185,027.00 | 0.00 |
| 70 | 123070 | 鹏辉转债 | 1,140,204.80 | 0.00 |
| 71 | 113623 | 凤 21 转债 | 211,461.60 | 0.00 |

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|-----------|
| 1 | 000596 | 古井贡酒 | 269,086,900.00 | 0.97 | 非公开发行流通受限 |

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-------------|----------|-----------|------------------|--------|------------------|--------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 易方达安心回报债券 A | 266,176 | 44,876.86 | 6,941,537,431.35 | 58.11% | 5,003,605,584.25 | 41.89% |
| 易方达安心回报债券 B | 47,325 | 42,590.26 | 881,529,232.47 | 43.74% | 1,134,054,739.09 | 56.26% |
| 合计 | 313,501 | 44,531.68 | 7,823,066,663.82 | 56.04% | 6,137,660,323.34 | 43.96% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|-------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 易方达安心回报债券 A | 1,599,251.43 | 0.0134% |
| | 易方达安心回报债券 B | 100,734.87 | 0.0050% |
| | 合计 | 1,699,986.30 | 0.0122% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|--------------------------------|-------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 易方达安心回报债券 A | 10~50 |
| | 易方达安心回报债券 B | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 易方达安心回报债券 A | 0 |
| | 易方达安心回报债券 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 易方达安心回报债券 A | 易方达安心回报债券 B |
|---------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日(2011年6月21日)基金份额总额 | 476,546,478.86 | 1,313,683,053.68 |

| | | |
|---------------|-------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 5,801,601,804.89 | 1,553,961,228.79 |
| 本报告期基金总申购份额 | 14,242,809,107.89 | 3,361,194,292.26 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 8,099,267,897.18 | 2,899,571,549.49 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 11,945,143,015.60 | 2,015,583,971.56 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员；2021 年 7 月 17 日发布公告，自 2021 年 7 月 15 日起陈丽园女士不再担任公司副总经理级高级管理人员；2021 年 7 月 24 日发布公告，自 2021 年 7 月 24 日起聘任萧楠先生担任公司副总经理级高级管理人员，聘任管勇先生担任公司首席信息官；2021 年 7 月 30 日发布公告，自 2021 年 7 月 30 日起聘任杨冬梅女士担任公司副总经理级高级管理人员。

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 11 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 111,100.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|-------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 长江证券 | 1 | 425,961,170.85 | 12.98% | 340,768.95 | 14.15% | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | 834,204,969.02 | 25.42% | 667,363.98 | 27.71% | - |
| 海通证券 | 1 | 118,626,802.52 | 3.62% | 94,901.51 | 3.94% | - |
| 华泰证券 | 2 | 539,373,580.93 | 16.44% | 323,625.28 | 13.44% | - |
| 申万宏源 | 1 | 481,579,687.48 | 14.68% | 288,947.81 | 12.00% | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | 763,258,254.41 | 23.26% | 610,606.48 | 25.35% | - |
| 中信建投 | 1 | 59,180,526.06 | 1.80% | 35,508.55 | 1.47% | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | 58,867,086.63 | 1.79% | 47,093.60 | 1.96% | - |

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司。

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

- 1) 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------------------|--------------|--------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 长江证券 | 1,116,291,296.20 | 7.71% | 34,974,600,000.00 | 9.14% | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 3,943,245,781.60 | 27.25% | 169,116,500,000.00 | 44.19% | - | - |
| 海通证券 | 499,175,692.45 | 3.45% | 4,650,000,000.00 | 1.22% | - | - |
| 华泰证券 | 1,633,423,361.51 | 11.29% | 29,986,000,000.00 | 7.84% | - | - |
| 申万宏源 | 4,377,825,640.90 | 30.25% | 113,822,100,000.00 | 29.74% | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1,282,450,617.20 | 8.86% | 13,500,000,000.00 | 3.53% | - | - |
| 中信建投 | 1,528,280,369.93 | 10.56% | 15,143,500,000.00 | 3.96% | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 91,425,570.67 | 0.63% | 1,500,000,000.00 | 0.39% | - | - |

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 1 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加东方财富证券为销售机构的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-12 |
| 2 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加基煜基金为销售机构的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-19 |
| 3 | 易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中欧财富为销售机构的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-21 |
| 4 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证券报 | 2021-01-21 |
| 5 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-23 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------|
| 6 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配卓胜微（300782）非公开发行 A 股的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-01-30 |
| 7 | 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 |
| 8 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-02-10 |
| 9 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告 | 中国证券报 | 2021-03-30 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-02 |
| 11 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证券报 | 2021-04-19 |
| 12 | 易方达基金管理有限公司关于终止攀枝花市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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-27 |
| 13 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-04-28 |
| 14 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-17 |
| 15 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告 | 中国证券报 | 2021-07-20 |
| 16 | 易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配古井贡酒（000596）非公开发行 A 股的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-23 |
| 17 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-24 |
| 18 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-24 |
| 19 | 易方达基金管理有限公司关于南京分公司营业场所变更的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-28 |
| 20 | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-07-30 |
| 21 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告 | 中国证券报 | 2021-08-28 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 22 | 易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-09-29 |
| 23 | 关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-10-13 |
| 24 | 关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-10-27 |
| 25 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告 | 中国证券报 | 2021-10-27 |
| 26 | 易方达安心回报债券型证券投资基金分红公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-11-03 |
| 27 | 关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-11-10 |
| 28 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-11-15 |
| 29 | 关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-11-24 |
| 30 | 关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-08 |
| 31 | 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 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-10 |
| 32 | 易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-17 |
| 33 | 关于易方达安心回报债券型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的提示性公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-22 |

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达安心回报债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《易方达安心回报债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达安心回报债券型证券投资基金托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日