

易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资 基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47

7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12	投资组合报告附注	47
8	基金份额持有人信息	48
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2	期末上市基金前十名持有人	49
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	49
9	开放式基金份额变动	50
10	重大事件揭示	50
10.1	基金份额持有人大会决议	50
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4	基金投资策略的改变	50
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8	其他重大事件	52
11	备查文件目录	53
11.1	备查文件目录	53
11.2	存放地点	54
11.3	查阅方式	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金
基金简称	易方达创新未来 18 个月封闭混合
场内简称	易基未来、易方达创新未来
基金主代码	501203
交易代码	501203
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 29 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,912,395,345.85 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 1 月 21 日

注：根据 2021 年 1 月 9 日发布的《易方达基金管理有限公司关于易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金修订基金合同、开通跨系统转托管及基金份额上市相关安排的公告》，本基金的基金代码由 010317 变更为 501203。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于对宏观经济走势及市场估值与流动性的分析，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。本基金界定的与创新未来主题相关的企业是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求，主要服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的企业，重点关注新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保、生物医药、新兴消费等产业。股票投资方面，本基金将通过对行业发展趋势和行业景气度、行业竞争格局及其变化等方面的分析，进行本基金的行业配置。此外，本基金将通过对企业经营和核心竞争力、企业研发和创新能力、发展前景、公司治理、管理团队等因素的综合考虑，寻找具备突出竞争壁垒、良好商业模式、具备长期投资价值的公司。封闭运作期内，本基金将积极关注并深入分析和论证战略配售股票的投资机会。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65%+中证港股通综合指数收益率×15%+中债总指数收益率×20%

风险收益特征	本基金为混合基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，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、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。
--------	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	胡波
	联系电话	020-85102688	021-61618888
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95528
传真		020-38798812	021-63602540
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）	上海市中山东一路12号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	上海市北京东路689号
邮政编码		510620	200001
法定代表人		刘晓艳	郑杨

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

注：根据 2021 年 1 月 9 日发布的《易方达基金管理有限公司关于易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金修订基金合同、开通跨系统转托管及基金份额上市相关安排的公告》，本

基金登记结算机构由易方达基金管理有限公司变更为中国证券登记结算有限责任公司。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	453,522,389.85
本期利润	1,343,839,233.15
加权平均基金份额本期利润	0.1698
本期加权平均净值利润率	14.89%
本期基金份额净值增长率	15.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	504,950,099.06
期末可供分配基金份额利润	0.0638
期末基金资产净值	9,768,704,066.96
期末基金份额净值	1.2346
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	23.46%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.82%	1.33%	-0.94%	0.58%	1.76%	0.75%
过去三个月	17.16%	1.31%	3.22%	0.67%	13.94%	0.64%
过去六个月	15.95%	1.74%	1.99%	0.94%	13.96%	0.80%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	23.46%	1.45%	11.57%	0.87%	11.89%	0.58%

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

易方达创新未来 18 个月封闭运作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
 (2020 年 9 月 29 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：1.本基金合同于 2020 年 9 月 29 日生效,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,本基金的建仓期为六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为 23.46%,同期业绩比较基准收益率为 11.57%。

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		
陈皓	本基金的基金经理、易方达均衡成长股票型证券投资基金的基金经理、易方达科讯混合型证券投资基金的基金经理、易方达新经济灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、易方达科翔混合型证券投资基金的基金经理、易方达平稳增长证券投资基金的基金经理、副总经理级高级管理人员、投资一部总经理、权益投资决策委员会委员	2020-09-29	-	14 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、投资一部总经理助理、投资一部副总经理、投资经理、易方达价值精选混合型证券投资基金基金经理、易方达供给改革灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达国防军工混合型证券投资基金基金经理、易方达科融混合型证券投资基金基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年上证指数上涨 3.40%，创业板指数上涨 17.22%，中证 500 指数上涨 6.93%，恒生指数上涨 5.86%，市场整体表现较好，但总体波动幅度较大。春节前市场在白马蓝筹板块带动下大幅上涨，节后则经历了较为剧烈的调整；二季度新能源、半导体等成长板块在基本面的带动下上涨幅度较大，顺周期板块一季度大幅上涨后二季度总体表现平稳。

本基金上半年采取了较为积极的投资策略，维持了组合的较高仓位运行，并调整优化了组合的持仓结构。我们在一季度市场情绪较高时减持了部分风险收益比不高的消费和金融行业相关个股以及部分港股资产，在市场大幅波动时逆市加仓了基本面较强、估值相对合理的新能源车板块，并在五、六月份前瞻布局了光伏板块，为组合贡献了较大超额。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2346 元，本报告期份额净值增长率为 15.95%，同期业绩比较基准收益率为 1.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为在当前的估值水平和宏观环境下，市场较难出现单边趋势性行情，未来一段时间可能会是整体指数波动较小、结构性机会相对丰富的阶段。成长板块在二季度的反弹中表现突出，医药、新能源、半导体等板块估值回到高位，消费板块绝对估值水平也不低。市场的贝塔行情进入后半程，热门板块总体超额收益较难持续，需要发掘基本面和业绩超预期的个股来实现超额。港股经历一季度的大幅上涨后调整较多，部分优质个股开始具备长期投资性价比。中长期维度下，以新能源、科技、医药、高端消费为代表的新兴成长板块依旧是我们看好的方向。

我们将结合宏观市场以及中观行业判断，寻找具备中长期投资价值的行业和个股，在操作中更

加注重逆向和前瞻，力争为投资者奉献更加持续、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在对易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金的投资运作进行了监督,对

基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内,由易方达基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金

报告截止日: 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	308,529,919.99	1,133,032,646.04
结算备付金		23,312,555.73	544,547,411.09
存出保证金		2,520,001.94	45,719,034.32
交易性金融资产	6.4.7.2	9,420,538,612.76	6,251,720,968.78
其中: 股票投资		9,418,983,812.76	6,251,720,968.78
基金投资		-	-
债券投资		1,554,800.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	1,200,000,000.00
应收证券清算款		48,246,454.66	49,116,566.22
应收利息	6.4.7.5	142,173.77	569,451.99
应收股利		1,625,168.27	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,804,914,887.12	9,224,706,078.44
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021 年 6 月 30 日	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		15,594,843.75	785,242,163.43
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,666,668.59	2,681,542.97
应付托管费		1,555,555.80	357,539.05
应付销售服务费		3,111,111.64	715,078.12
应付交易费用	6.4.7.7	4,190,867.69	10,779,921.03
应交税费		32.84	0.03
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	91,739.85	65,000.00
负债合计		36,210,820.16	799,841,244.63
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	7,912,395,345.85	7,912,395,345.85
未分配利润	6.4.7.10	1,856,308,721.11	512,469,487.96
所有者权益合计		9,768,704,066.96	8,424,864,833.81
负债和所有者权益总计		9,804,914,887.12	9,224,706,078.44

注：1.本基金合同生效日为 2020 年 9 月 29 日，2020 年度实际报告期间为 2020 年 9 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2346 元，基金份额总额 7,912,395,345.85 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		1,459,621,545.16
1.利息收入		5,829,218.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,402,754.75
债券利息收入		1,344.89
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		425,118.96
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		563,475,483.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	527,483,000.56
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,989,867.68
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	34,002,615.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	890,316,843.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、费用		115,782,312.01
1. 管理人报酬		67,247,151.54
2. 托管费		8,966,286.90
3. 销售服务费		17,932,573.77
4. 交易费用	6.4.7.18	21,528,166.40
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		4.84
7. 其他费用	6.4.7.19	108,128.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,343,839,233.15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,343,839,233.15

注：本基金合同生效日为 2020 年 9 月 29 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。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,912,395,345.85	512,469,487.96	8,424,864,833.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	1,343,839,233.15	1,343,839,233.15

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)	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	7,912,395,345.85	1,856,308,721.11	9,768,704,066.96

注: 本基金合同生效日为 2020 年 9 月 29 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 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 刘晓艳, 主管会计工作负责人: 陈荣, 会计机构负责人: 邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2282 号《关于准予易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 12,000,001,172.42 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(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。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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]127 号

文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	308,529,919.99
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	308,529,919.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,000,830,060.52	9,418,983,812.76	1,418,153,752.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,554,800.00	1,554,800.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,554,800.00	1,554,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,002,384,860.52	9,420,538,612.76	1,418,153,752.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	131,629.68
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	8,357.35
应收债券利息	143.13
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2,043.61
合计	142,173.77

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,190,867.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,190,867.69

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	91,739.85
合计	91,739.85

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	7,912,395,345.85	7,912,395,345.85
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,912,395,345.85	7,912,395,345.85

注：申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	51,427,709.21	461,041,778.75	512,469,487.96
本期利润	453,522,389.85	890,316,843.30	1,343,839,233.15
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	504,950,099.06	1,351,358,622.05	1,856,308,721.11

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	4,610,260.61
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	697,756.88
其他	94,737.26
合计	5,402,754.75

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	6,374,578,247.60
减：卖出股票成本总额	5,847,095,247.04
买卖股票差价收入	527,483,000.56

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,150,809.75

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,159,700.00
减：应收利息总额	1,242.07
买卖债券差价收入	1,989,867.68

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	34,002,615.02
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	34,002,615.02

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	890,316,843.30
——股票投资	890,316,843.30
——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	890,316,843.30

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	21,528,166.40

银行间市场交易费用	-
合计	21,528,166.40

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,488.71
银行间账户维护费	13,500.00
其他	400.00
合计	108,128.56

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	67,247,151.54
其中：支付销售机构的客户维护费	30,784,805.21

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,966,286.90

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。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

基金托管费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 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6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费
易方达基金管理有 限公司	773,035.63
合计	773,035.63

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入

浦发银行-活期存款	308,529,919.99	4,610,260.61
-----------	----------------	--------------

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

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

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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-

				受限						
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
30095	英力	2021-0	2021-0	新股	12.85	25.80	371	4,767.	9,571.	-

6	股份	3-16	9-27	流通受限				35	80	
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021-03-29	2021-10-11	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-

30098 6	志特新材	2021-0 4-21	2021-1 1-01	新股 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904. 56	8,070. 48	-
30099 1	创益通	2021-0 5-12	2021-1 1-22	新股 流通 受限	13.06	26.51	254	3,317. 24	6,733. 54	-
30099 2	泰福泵业	2021-0 5-17	2021-1 1-25	新股 流通 受限	9.36	20.32	200	1,872. 00	4,064. 00	-
30099 5	奇德新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811. 52	4,454. 12	-
30099 7	欢乐家	2021-0 5-26	2021-1 2-02	新股 流通 受限	4.94	13.05	928	4,584. 32	12,110 .40	-
30099 8	宁波方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	新股 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210. 02	4,285. 32	-
30100 2	崧盛股份	2021-0 5-27	2021-1 2-07	新股 流通 受限	18.71	57.62	201	3,760. 71	11,581 .62	-
30100 7	德迈仕	2021-0 6-04	2021-1 2-16	新股 流通 受限	5.29	14.44	303	1,602. 87	4,375. 32	-
30100 9	可靠股份	2021-0 6-08	2021-1 2-17	新股 流通 受限	12.54	27.89	801	10,044 .54	22,339 .89	-
30101 0	晶雪节能	2021-0 6-09	2021-1 2-20	新股 流通 受限	7.83	17.61	218	1,706. 94	3,838. 98	-
30101 2	扬电科技	2021-0 6-15	2021-1 2-22	新股 流通 受限	8.05	24.26	170	1,368. 50	4,124. 20	-
30101 5	百洋医药	2021-0 6-22	2021-1 2-30	新股 流通 受限	7.64	38.83	462	3,529. 68	17,939 .46	-
30101 6	雷尔伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	新股 流通 受限	13.75	32.98	275	3,781. 25	9,069. 50	-
30101 7	漱玉平民	2021-0 6-23	2021-0 7-05	新股 流通 受限	8.86	8.86	4,995	44,255 .70	44,255 .70	-
30101 7	漱玉平民	2021-0 6-23	2022-0 1-05	新股 流通	8.86	8.86	555	4,917. 30	4,917. 30	-

				受限						
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688328	深科达	2021-03-01	2021-09-09	新股流通受限	16.49	37.79	1,499	24,718.51	56,647.21	-
688616	西力科技	2021-03-10	2021-09-22	新股流通受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
688626	翔宇医疗	2021-03-23	2021-10-08	新股流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688700	东威科技	2021-06-07	2021-12-15	新股流通受限	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-
000661	长春高新	2020-12-31	2021-07-01	大宗交易流通受限	415.00	387.00	160,000	66,400,000.00	61,920,000.00	-
300628	亿联网络	2021-06-28	2021-12-28	大宗交易流通受限	79.84	77.54	630,000	50,299,200.00	48,850,200.00	-
688208	道通科技	2021-05-14	2021-11-15	大宗交易流通受限	64.66	80.66	440,000	28,450,400.00	35,490,400.00	-
00040	派林	2021-0	2021-0	非公	33.33	30.23	1,500,	49,999	45,349	-

3	生物	2-22	8-23	开发 行流 通受 限			149	,966.1 7	,504.2 7	
00249 7	雅化 集团	2021-0 1-27	2021-0 7-29	非公 开发 行流 通受 限	14.01	21.93	3,505, 822	49,116 ,566.2 2	76,882 ,676.4 6	-
30078 2	卓胜 微	2021-0 1-29	2021-0 8-09	非公 开发 行流 通受 限	565.85	521.04	150,33 6	47,259 ,792.0 0	78,331 ,069.4 4	-
60379 9	华友 钴业	2021-0 2-18	2021-0 8-09	非公 开发 行流 通受 限	84.00	108.54	1,190, 476	99,999 ,984.0 0	129,21 4,265. 04	-

6.4.12.1.2 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
12703 8	国微 转债	2021-0 6-10	2021-0 7-14	新发 流 通 受 限	100.00	100.00	15,548	1,554, 800.00	1,554, 800.00	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 (股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
03800	保利协 鑫能源	2021-04 -01	重大事 项停牌	1.65	-	-	21,746,000	42,034,240.64	35,826,935.1 3	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%(2020 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	1,554,943.13	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,554,943.13	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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

合计	0.00	0.00
----	------	------

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	308,529,919.99	-	-	-	308,529,919.99
结算备付金	23,312,555.73	-	-	-	23,312,555.73
存出保证金	2,520,001.94	-	-	-	2,520,001.94
交易性金融资产	-	-	1,554,800.00	9,418,983,812.76	9,420,538,612.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	48,246,454.66	48,246,454.66
应收利息	-	-	-	142,173.77	142,173.77
应收股利	-	-	-	1,625,168.27	1,625,168.27
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	334,362,477.66	-	1,554,800.00	9,468,997,609.46	9,804,914,887.12
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	-	-	-	15,594,843.75	15,594,843.75
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	11,666,668.59	11,666,668.59
应付托管费	-	-	-	1,555,555.80	1,555,555.80
应付销售服务费	-	-	-	3,111,111.64	3,111,111.64
应付交易费用	-	-	-	4,190,867.69	4,190,867.69
应交税费	-	-	-	32.84	32.84
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	91,739.85	91,739.85
负债总计	-	-	-	36,210,820.16	36,210,820.16

					16
利率敏感度缺口	334,362,477.66	-	1,554,800.00	9,432,786,789.30	9,768,704,066.96
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	1,133,032,646.04	-	-	-	1,133,032,646.04
结算备付金	544,547,411.09	-	-	-	544,547,411.09
存出保证金	45,719,034.32	-	-	-	45,719,034.32
交易性金融资产	-	-	-	6,251,720,968.78	6,251,720,968.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,200,000,000.00	-	-	-	1,200,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	49,116,566.22	49,116,566.22
应收利息	-	-	-	569,451.99	569,451.99
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,923,299,091.45	-	-	6,301,406,986.99	9,224,706,078.44
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	-	-	-	785,242,163.43	785,242,163.43
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,681,542.97	2,681,542.97
应付托管费	-	-	-	357,539.05	357,539.05
应付销售服务费	-	-	-	715,078.12	715,078.12
应付交易费用	-	-	-	10,779,921.03	10,779,921.03
应交税费	-	-	-	0.03	0.03

应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	65,000.00	65,000.00
负债总计	-	-	-	799,841,244.63	799,841,244.63
利率敏感度缺口	2,923,299,091.45	-	-	5,501,565,742.36	8,424,864,833.81

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。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30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				
交易性金融资产	-	2,317,698,580.77	-	2,317,698,580.77
资产合计	-	2,317,698,580.77	-	2,317,698,580.77
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,317,698,580.77	-	2,317,698,580.77
项目	上年度末 2020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				
交易性金融资产	-	1,873,334,591.52	-	1,873,334,591.52
资产合计	-	1,873,334,591.52	-	1,873,334,591.52
外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,873,334,591.52	-	1,873,334,591.52

6.4.13.4.2.2 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 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-115,884,929.04	-93,666,729.58
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	115,884,929.04	93,666,729.58

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,418,983,812.76	96.42	6,251,720,968.78	74.21
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	9,418,983,812.76	96.42	6,251,720,968.78	74.21

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	588,686,484.02	390,732,557.94
	2.业绩比较基准下降5%	-588,686,484.02	-390,732,557.94

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 8,901,925,927.15 元，属于第二层次的余额为 518,612,685.61 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 5,780,969,607.39 元，第二层次 470,751,361.39 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,418,983,812.76	96.06
	其中：股票	9,418,983,812.76	96.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,554,800.00	0.02
	其中：债券	1,554,800.00	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	331,842,475.72	3.38
8	其他各项资产	52,533,798.64	0.54
9	合计	9,804,914,887.12	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 2,317,698,580.77 元，占净值比例 23.73%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,359,080,144.87	65.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,151,678.21	0.05
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	82,472.34	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	589,699,780.58	6.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	112,487,368.69	1.15
J	金融业	34,716,704.10	0.36
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,101,285,231.99	72.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	38,755,224.35	0.40
材料	-	-
工业	41,839,853.08	0.43
非必需消费品	265,324,450.95	2.72
必需消费品	155,640,855.23	1.59
保健	257,872,949.89	2.64
金融	451,398,540.65	4.62
信息技术	377,430,098.43	3.86
电信服务	729,436,608.19	7.47
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	2,317,698,580.77	23.73

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	1,501,100	729,436,608.19	7.47
2	603128	华贸物流	41,852,362	589,699,780.58	6.04
3	603799	华友钴业	5,159,400	582,465,385.84	5.96
4	600438	通威股份	13,223,403	572,176,647.81	5.86
5	000858	五粮液	1,888,950	562,699,315.50	5.76
6	00388	香港交易所	1,172,200	451,398,540.65	4.62
7	300014	亿纬锂能	4,331,432	450,165,727.76	4.61
8	600196	复星医药	4,015,965	289,671,555.45	2.97
8	02196	复星医药	1,015,500	52,980,072.95	0.54
9	00981	中芯国际	14,209,500	282,580,234.16	2.89
10	000650	仁和药业	25,000,000	273,000,000.00	2.79
11	300750	宁德时代	485,682	259,742,733.60	2.66
12	688617	惠泰医疗	671,680	255,903,363.20	2.62
13	600519	贵州茅台	101,346	208,438,318.20	2.13
14	06078	海吉亚医疗	2,163,400	183,612,430.94	1.88
15	002460	赣锋锂业	1,493,778	180,881,578.02	1.85
16	300558	贝达药业	1,558,396	168,680,783.04	1.73
17	601012	隆基股份	1,834,861	163,009,051.24	1.67
18	002415	海康威视	2,339,400	150,891,300.00	1.54

19	002594	比亚迪	373,071	93,640,821.00	0.96
19	01211	比亚迪股份	288,500	55,740,789.58	0.57
20	300476	胜宏科技	6,131,912	133,982,277.20	1.37
21	688059	华锐精密	780,014	130,964,350.60	1.34
22	300775	三角防务	3,375,000	128,925,000.00	1.32
23	002013	中航机电	12,717,888	128,069,132.16	1.31
24	603520	司太立	1,953,021	120,403,744.65	1.23
25	002497	雅化集团	5,232,122	116,207,790.46	1.19
26	03690	美团-W	432,300	115,250,502.15	1.18
27	300782	卓胜微	191,196	100,293,319.44	1.03
28	002049	紫光国微	628,982	96,982,734.58	0.99
29	300274	阳光电源	809,400	93,129,564.00	0.95
30	300233	金城医药	3,083,000	87,865,500.00	0.90
31	06969	思摩尔国际	2,303,000	82,495,864.33	0.84
32	002153	石基信息	3,180,866	74,782,159.66	0.77
33	06186	中国飞鹤	5,245,000	73,144,990.90	0.75
34	000625	长安汽车	2,628,663	69,081,263.64	0.71
35	00175	吉利汽车	3,354,000	68,234,970.02	0.70
36	000403	派林生物	2,200,149	67,133,504.27	0.69
37	000661	长春高新	160,000	61,920,000.00	0.63
38	000547	航天发展	3,226,000	60,874,620.00	0.62
39	600416	湘电股份	4,108,800	59,947,392.00	0.61
40	00268	金蝶国际	2,692,000	59,022,929.14	0.60
41	603010	万盛股份	2,523,917	52,926,539.49	0.54
42	300628	亿联网络	630,000	48,850,200.00	0.50
43	002353	杰瑞股份	1,044,700	46,698,090.00	0.48
44	603612	索通发展	2,575,200	46,276,344.00	0.47
45	600089	特变电工	3,396,560	43,645,796.00	0.45
46	003012	东鹏控股	2,613,407	43,487,092.48	0.45
47	300577	开润股份	1,984,433	42,526,399.19	0.44
48	688006	杭可科技	499,494	42,456,990.00	0.43
49	03898	中车时代电气	1,095,500	41,839,853.08	0.43
50	02883	中海油田服务	6,692,000	38,755,224.35	0.40
51	300119	瑞普生物	1,104,834	37,365,485.88	0.38
52	03800	保利协鑫能源	21,746,000	35,826,935.13	0.37
53	688208	道通科技	440,000	35,490,400.00	0.36
54	300059	东方财富	1,057,700	34,681,983.00	0.36
55	000333	美的集团	468,300	33,422,571.00	0.34
56	600338	西藏珠峰	2,322,800	32,914,076.00	0.34
57	002384	东山精密	1,536,800	32,026,912.00	0.33
58	688667	菱电电控	281,834	31,004,558.34	0.32
59	300957	贝泰妮	98,053	26,623,189.88	0.27
60	02238	广汽集团	4,500,000	26,098,189.20	0.27
61	600588	用友网络	781,751	26,001,038.26	0.27

62	688008	澜起科技	375,116	23,399,736.08	0.24
63	01521	方达控股	3,100,000	21,280,446.00	0.22
64	688122	西部超导	303,293	19,674,616.91	0.20
65	688390	固德威	47,552	15,882,368.00	0.16
66	603678	火炬电子	220,900	14,910,750.00	0.15
67	002410	广联达	171,300	11,682,660.00	0.12
68	002237	恒邦股份	914,400	10,506,456.00	0.11
69	000902	新洋丰	653,100	10,207,953.00	0.10
70	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.05
71	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.00
72	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.00
73	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.00
74	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
75	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
76	688328	深科达	1,499	56,647.21	0.00
77	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
78	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.00
79	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
80	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
81	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
82	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
83	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
84	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
85	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
86	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
87	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
88	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
89	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
90	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
91	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
92	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
93	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
94	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
95	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
96	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
97	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
98	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
99	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
100	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
101	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
102	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
103	300925	法本信息	353	9,280.37	0.00
104	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
105	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00

106	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
107	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
108	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
109	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
110	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
111	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
112	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
113	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
114	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
115	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
116	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
117	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
118	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
119	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
120	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
121	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
122	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
123	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
124	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
125	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
126	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
127	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
128	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
129	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
130	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
131	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	490,431,546.12	5.82
2	603799	华友钴业	483,001,021.19	5.73
3	600438	通威股份	480,326,964.41	5.70
4	00388	香港交易所	361,234,286.30	4.29
5	600196	复星医药	270,224,092.58	3.21
5	02196	复星医药	52,133,446.78	0.62
6	300558	贝达药业	234,787,500.87	2.79
7	300014	亿纬锂能	229,355,969.94	2.72
8	688617	惠泰医疗	185,936,871.10	2.21

9	00700	腾讯控股	156,685,227.58	1.86
10	002415	海康威视	154,893,254.93	1.84
11	00883	中国海洋石油	152,457,811.79	1.81
12	03690	美团-W	148,339,917.72	1.76
13	00688	中国海外发展	145,522,197.70	1.73
14	00981	中芯国际	140,785,300.74	1.67
15	002594	比亚迪	83,807,621.68	0.99
15	01211	比亚迪股份	54,735,427.09	0.65
16	601012	隆基股份	136,490,863.56	1.62
17	02357	中航科工	132,127,384.09	1.57
18	00941	中国移动	130,523,599.00	1.55
19	603993	洛阳钼业	111,668,104.96	1.33
19	03993	洛阳钼业	8,543,368.30	0.10
20	03908	中金公司	117,400,113.02	1.39

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	03690	美团-W	433,663,757.41	5.15
2	603799	华友钴业	342,269,812.93	4.06
3	002466	天齐锂业	299,496,613.89	3.55
4	002415	海康威视	237,939,642.03	2.82
5	603993	洛阳钼业	133,273,552.22	1.58
5	03993	洛阳钼业	63,132,884.06	0.75
6	601166	兴业银行	180,489,900.22	2.14
7	300037	新宙邦	171,886,284.57	2.04
8	601888	中国中免	170,459,446.18	2.02
9	00883	中国海洋石油	162,001,245.30	1.92
10	000547	航天发展	158,959,045.11	1.89
11	00700	腾讯控股	151,014,905.70	1.79
12	00688	中国海外发展	149,724,409.38	1.78
13	002460	赣锋锂业	102,285,790.01	1.21
13	01772	赣锋锂业	45,950,236.19	0.55
14	00941	中国移动	132,460,794.15	1.57
15	01810	小米集团-W	116,730,229.14	1.39
16	600036	招商银行	108,809,073.51	1.29
17	000001	平安银行	108,750,338.35	1.29
18	02357	中航科工	106,477,287.60	1.26
19	00939	建设银行	101,684,931.27	1.21
20	002129	中环股份	95,611,877.61	1.13

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,124,041,247.72
卖出股票收入（成交）总额	6,374,578,247.60

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,554,800.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,554,800.00	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	127038	国微转债	15,548	1,554,800.00	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2021 年 2 月 5 日，上海市交通委员会针对华贸物流不规范经营、服务的行为，予以罚款处罚。

2021 年 3 月 12 日，国家市场监督管理总局针对腾讯控股有限公司收购猿辅导（YUAN INC）股权构成未依法申报违法实施的经营者集中，给予腾讯 50 万元人民币罚款的行政处罚。

2021 年 4 月 28 日，市场监管总局对腾讯控股有限公司收购 Bitauto Holdings Limited 股权未依法申报违法实施经营者集中案作出行政处罚决定，给予腾讯 50 万元罚款的行政处罚。

2021 年 4 月 28 日，市场监管总局对腾讯控股有限公司收购上海阑途信息技术有限公司股权未依法申报违法实施经营者集中案作出行政处罚决定，给予腾讯 50 万元罚款的行政处罚。

本基金投资华贸物流、腾讯控股的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除华贸物流、腾讯控股外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,520,001.94
2	应收证券清算款	48,246,454.66
3	应收股利	1,625,168.27
4	应收利息	142,173.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,533,798.64

7.12.4 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。

7.12.5 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	603799	华友钴业	129,214,265.04	1.32	非公开发行流通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,431,356	5,527.90	28,347,682.00	0.36%	7,884,047,663.85	99.64%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信证券信安盈利混合型养老金产品— 中信银行股份有限公司	17,039,551.00	5.78%
2	罗萍	3,779,076.00	1.28%
3	吉烈钧	3,100,000.00	1.05%
4	新华养老保险股份有限公司—自有资金	3,007,270.00	1.02%
5	中信证券—中信银行—中信证券星云 30 号集合资产管理计划	2,189,329.00	0.74%
6	黄志霖	1,850,672.00	0.63%
7	吕梅	1,502,532.00	0.51%
8	中信证券—民生银行—中信证券星云 22 号集合资产管理计划	1,498,435.00	0.51%
9	汤伟	1,241,832.00	0.42%
10	刘世开	1,223,055.00	0.41%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 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	9,622,627.30	0.1216%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 9 月 29 日）基金份额总额	12,000,001,172.42
本报告期期初基金份额总额	7,912,395,345.85
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	7,912,395,345.85

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	2	2,913,727,491.27	20.46%	2,330,981.98	20.99%	-
招商证券	1	2,905,734,120.21	20.41%	2,324,587.30	20.93%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	1,772,751,821.44	12.45%	1,418,197.97	12.77%	-
信达证券	1	87,707,964.19	0.62%	52,624.76	0.47%	-
开源证券	1	1,725,781,933.77	12.12%	1,380,625.33	12.43%	-
申万宏源	2	3,492,029,948.60	24.52%	2,793,624.98	25.15%	-
中泰证券	1	1,341,819,936.08	9.42%	805,091.98	7.25%	-

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信达证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	1,200,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	8,150,809.75	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金修订基金合同、开通跨系统转托管及基金份额上市相关安排的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-09
2	易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-16
3	易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证券时报	2021-01-16
4	易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金溢价风险提示公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-21
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2021-01-21
6	关于易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金溢价风险提示及临时停牌公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
7	易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券	证券时报、基金管理人网	2021-01-22

	投资基金溢价风险提示公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
9	易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金溢价风险提示及临时停牌公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-25
10	易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金溢价风险提示及临时停牌公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-26
11	易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金溢价风险提示及临时停牌公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-27
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配雅化集团（002497）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-29
13	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配华友钴业（603799）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-20
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金获配双林生物（000403）非公开发行 A 股的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-24
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报	2021-03-30
17	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
18	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第一季度报告提示性公告	证券时报	2021-04-19

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金注册的文件；
- 2、《易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《易方达创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二一年八月二十八日