易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）上市交易公告书

易方达基金管理有限公司
二〇一九年三月二十六日

一、重要声明与提示

易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）上市交易公告书（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号＜上市交易公告书的内容与格式＞》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金基金管理人易方达基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和深圳证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请详细阅读2019年2月19日刊登在本公司网站（www.efunds.com.cn）上的《易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书》（以下简称“《更新的招募说明书》”）。

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期内本基金不开放赎回业务，本基金上市后，投资者可通过二级市场交易卖出基金份额。但是，在证券市场持续下跌、基金二级市场交易不活跃等情形下，有可能出现基金份额二级市场交易价格低于基金份额净值的情形，即基金折价交易，从而影响持有人收益或产生损失。基金折价交易是二级市场交易的正常现象，请投资者在理性判断的基础上做出投资选择。

二、基金概览

（一）基金名称

易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

1. 基金代码：161131
2. 基金简称：易方达3年封闭战略配售混合（LOF）
3. 场内简称：易基配售

（二）基金类型

混合型证券投资基金

（三）基金的运作方式

契约型开放式。

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金每6个月受限开放一次，每个受限开放期的首日为本基金基金合同生效日起每6个月的月度对日，即首个受限开放期的起始日为本基金的基金合同生效日起6个月的月度对日，第二个受限开放期的起始日为本基金的基金合同生效日起12个月的月度对日，依此类推。本基金的每个受限开放期不少于5个工作日，不超过10个工作日，具体的受限开放时间由基金管理人在开始办理申购前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“易方达科润混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。

（四）基金存续期限

不定期

（五）基金份额总额

24,449,265,786.76份（截至2019年3月22日）

（六）基金份额净值

1.0481元（截至2019年3月22日）

（七）本次上市交易份额

1,136,960,538.00份（截至2019年3月22日）

（八）上市交易的证券交易所

深圳证券交易所

（九）上市交易日期

2019年3月29日

（十）基金管理人

易方达基金管理有限公司

（十一）基金托管人

中国建设银行股份有限公司

（十二）上市推荐人

无

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前募集情况

1. 本基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可【2018】926号。
2. 基金的运作方式：契约型开放式，本基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金每6个月受限开放一次，每个受限开放期的首日为本基金基金合同生效日起每6个月的月度对日，即首个受限开放期的起始日为本基金的基金合同生效日起6个月的月度对日，第二个受限开放期的起始日为本基金的基金合同生效日起12个月的月度对日，依此类推。本基金的每个受限开放期不少于5个工作日，不超过10个工作日，具体的受限开放时间由基金管理人在开始办理申购前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。
3. 基金合同期限：不定期。
4. 发售日期及发售期限：本基金采取阶段发售方式，募集期分为两个阶段，第一阶段面向个人投资者公开销售，第二阶段面向全国社会保障基金、基本养老保险基金、企业年金基金和职业年金基金等机构投资者销售。

本基金第一阶段募集期自2018年6月11日至2018年6月15日共5个工作日。第一阶段募集期结束后基金募集规模没有达到500亿元的，基金进入第二阶段募集期。

本基金第二阶段募集期为2018年6月19日共1个工作日。第二阶段募集期基金优先向全国社会保障基金、基本养老保险基金发售，仍有不足的，再向企业年金基金和职业年金基金发售。本基金第二阶段募集期仅通过直销机构发售。

5. 发售价格：每份基金份额初始面值为1.00元人民币。
6. 发售方式：本基金只通过场外公开发售。
7. 发售机构：

（1）第一阶段募集期销售机构

①直销机构：易方达基金管理有限公司

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）

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

法定代表人：刘晓艳

电话：020–85102506

传真：400 881 8099

联系人：李红枫

网址：www.efunds.com.cn

直销机构网点信息：

1）易方达基金管理有限公司广州直销中心

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楼

电话：020–85102506

传真：400 881 8099

联系人：李红枫

2）易方达基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市西城区武定侯街2号泰康国际大厦18层

电话：010–63213377

传真：400 881 8099

联系人：刘蕾

3）易方达基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦46楼

电话：021–50476668

传真：400 881 8099

联系人：于楠

4）易方达基金管理有限公司网上直销系统

网址：www.efunds.com.cn

②非直销销售机构

见以下附件1

如变更场外销售机构，本公司将另行公告。

（2）第二阶段募集期销售机构

直销机构：易方达基金管理有限公司

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）

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

法定代表人：刘晓艳

电话：020–85102506

传真：400 881 8099

联系人：李红枫

网址：www.efunds.com.cn

直销机构网点信息

1）易方达基金管理有限公司广州直销中心

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楼

电话：020–85102506

传真：400 881 8099

联系人：李红枫

2）易方达基金管理有限公司北京直销中心

办公地址：北京市西城区武定侯街2号泰康国际大厦18层

电话：010–63213377

传真：400 881 8099

联系人：李红枫

2）易方达基金管理有限公司上海直销中心

办公地址：上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦46楼

电话：021–50476668

传真：400 881 8099

联系人：于楠

8. 验资机构名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。
9. 募集资金总额及入账情况

本次募集的有效净认购金额为24,432,990,071.39元人民币，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计4,420,284.40元人民币。按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本息合计募集基金份额总额为24,437,410,355.79份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。上述有效净认购金额已于2018年6月20日内划入本基金在基金托管人中国建设银行开立的基金托管专户。在基金募集期内，本公司的基金从业人员认购基金份额14,665,489.90份，占基金份额总量的0.0600%。本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为100万份以上；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为100万份以上。本公司未使用固有资金认购本基金的基金份额。

10. 基金备案情况

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2018年7月6日获中国证监会书面确认，基金合同自2018年7月6日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11. 基金合同生效日：2018年7月5日
12. 基金合同生效日的基金份额总额：24,437,410,355.79份。

（二）本基金上市交易的主要内容

1. 基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2019]144号。
2. 上市交易日期：2019年3月29日。
3. 上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。
4. 本次上市交易的基金份额场内简称及代码：易基配售、161131。
5. 本次上市交易份额：1,136,960,538.00份（截至2019年3月22日）。
6. 基金净值的披露：基金管理人每个估值日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。本基金上市交易后，基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传送给深圳证券交易所，深圳证券交易所于每个估值日的下一个工作日通过行情系统揭示。
7. 未上市交易份额的流通规定：未上市交易的基金份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下，可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统在深圳证券交易所上市交易。本基金开通跨系统转托管业务情况详见于2019年3月18日刊登的《关于易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）开通跨系统转托管业务的公告》。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2019年3月22日，本基金份额持有人户数为604,667户，平均每户持有的基金份额为40,434.41份。其中上市交易的场内基金份额持有人户数为8,935户，平均每户持有的基金份额为127,247.96份。

（二）持有人结构

截至2019年3月22日，本基金总份额24,449,355,786.76份，其中机构投资者持有的基金份额为5,448,929,470.70份，占总基金份额比例为22.29%；个人投资者持有的基金份额为19,000,426,316.06份，占总基金份额比例为77.71%。

本基金上市交易的场内基金份额1,136,960,538.00份，其中机构投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为258,139,160.00份，占本次上市交易基金份额比例为22.70%；个人投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为878,821,378.00份，占本次上市交易基金份额比例为77.30%。

（三）前十名场内基金份额持有人的情况：

截至2019年3月22日，本基金前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称	持有基金份额（份）	占场内基金份额比例
1	易方达稳健配置二号混合型养老金产品－中国工商银行股份有限公司	59,999,000.00	5.28%
2	易方达稳健配置混合型养老金产品－中国工商银行股份有限公司	53,099,000.00	4.67%
3	中国石油天然气集团公司企业年金计划－中国工商银行股份有限公司	49,999,000.00	4.40%
4	平安工行中国石油化工集团公司企业年金计划	16,702,044.00	1.47%
5	平安农行中国银行股份有限公司企业年金计划	6,435,134.00	0.57%
6	平安农行山东省农村信用社联合社企业年金计划	3,659,679.00	0.32%
7	光大证券股份有限公司企业年金计划－中国光大银行	2,691,808.00	0.24%
8	平安浦发上海申通地铁集团有限公司企业年金计划	2,455,861.00	0.22%
9	平安工行广东省邮政公司企业年金计划	2,411,882.00	0.21%
10	平安建行日照港（集团）有限公司企业年金计划	2,074,462.00	0.18%
合计		199,527,870.00	17.56%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1. 名称：易方达基金管理有限公司
2. 法定代表人：刘晓艳
3. 总裁：刘晓艳
4. 注册资本：12,000万元人民币
5. 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）
6. 设立批准文号：证监基金字[2001]4号
7. 工商登记注册的法人营业执照文号：914400007278786６D
8. 经营范围：公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理
9. 股权结构：广东粤财信托有限公司，持有股份25%；广发证券股份有限公司，持有股份25%；盈峰投资控股集团有限公司，持有股份25%；广东省广晟资产经营有限公司，持有股份16.67%；广州市广永国有资产经营有限公司，持有股份8.33%。
10. 内部组织结构及职能：

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规和中国证监会的规定和要求，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，保持公司规范运作，维护基金份额持有人的利益。

公司下设43个部门：权益投资管理部、投资一部、投资二部、投资三部、研究部、固定收益投资部、现金管理部、固定收益组合管理部、固定收益研究部、固定收益交易部、混合资产投资部、年金投资部、指数与量化投资管理总部、国际投资部、多资产投资部、机构客户总部、渠道与营销管理总部、北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、大连分公司、互联网金融部、客户服务与销售支持总部、全球投资客户部、养老金部、实体经济服务部、投资风险管理部、监察与合规管理总部、公司法律事务部、综合管理部、公司财务中心、技术运营部、系统研发部、系统规划架构部、金融科技部、核算部、集中交易室、数据信息支持部、宣传策划部、主册登记部、投资发展部、人力资源部。

1）权益投资管理部负责主动权益类投资产品的管理工作。

2）投资一部以团队形式负责所辖资产的投资管理工作。

3）投资二部以团队形式负责所辖资产的投资管理工作。

4）投资三部以专注于“长期投资有持续内生增长能力的价值型个股”的投资策略，以紧密团队合作的形式，负责该种策略下各类产品的投资管理工作。

5）研究部负责对宏观经济、行业、上市公司以及可转债、基金等投资品种的研究。

6）固定收益投资部负责纯债类基金、专户的投资管理工作。

7）现金管理部负责货币类以及短期理财类基金的投资管理工作。

8）固定收益组合管理部负责固定收益纯债类组合、混合多策略组合、现金管理类组合的账户运作支持工作。

9）固定收益研究部负责固定收益类投资品种的研究。

10）固定收益交易部负责固定收益类投资品种的交易。

11）混合资产投资部负责混合策略类基金、专户的投资管理工作。

12）年金投资部负责企业年金、职业年金的投资管理工作。

13）指数与量化投资管理总部下设指数及增强投资部、量化策略部，负责指数基金以及量化策略基金的投资管理及相关工作。

14）国际投资部负责管理和发展公司QDII、RQDII以及其他境外证券市场投资业务，参与相关产品设计，配合客户服务工作，同时担当易方达公司境内和境外投资研究体系互动和交流的桥梁。

15）多资产投资部负责跨区域、跨类别的多种资产的研究及投资工作。

16）机构客户总部负责公司机构客户的销售和服务工作，下设银行客户部、非银行客户部两个二级部门，分别负责所属客户群体的销售和服务工作。

17）渠道与营销管理总部下设渠道部、营销部，负责各类基金代销机构的合作开发及总部层面的维护工作；营销策划方案的制订、推动，营销效果及客群的数据挖掘、分析；公司产品宣传材料制作。

18）北京分公司负责以北京为中心的华北地区的渠道销售和服务工作。

19）上海分公司负责以上海为中心的华东地区的渠道销售和服务工作。

20）广州分公司负责以广州为中心的华南地区的渠道销售和服务工作。

21）成都分公司负责以成都为中心的西南西北地区的渠道销售和服务工作。

22）大连分公司负责以大连为中心的东北及山东地区的渠道销售和服务工作。

23）互联网金融部负责研发基于互联网的交易模式和服务模式，建设相应系统并持续改进用户体验，开展互联网金融业务的营销策划、方案制作、方案实施及对外的合作洽谈，负责公司网站及App建设、维护，为互联网上的客户提供服务等工作。

24）客户服务与销售支持总部下设客户服务部、销售支持部，负责销售支持工作，为渠道、电子商务业务的客户和大客户提供服务支持。

25）全球投资客户部负责执行公司在国际市场的战略目标和定位；开拓国际市场客户，促进公司产品的境外销售，管理和维护客户关系；甄选公司的国际合作投资顾问，对其服务和产品进行管理。

26）养老金部负责养老金业务规划、市场开发与营销、客户服务等职能。

27）实体经济服务部直接为实体经济服务。

28）投资风险管理部负责投资风险管理、投资绩效评估，投资与市场的相关数据支持服务工作。

29）监察与合规管理总部下设合规风控部、合规内审部，负责独立地对公司各业务环节合法合规运作的情况进行检查监督，协助并督促各部门履行内控职责，确保公司各项经营活动稳健合规，实现公司经营目标。

30）公司法律事务部负责处理与公司运营相关的法律文件审核、法务咨询等事务（含母子公司等集团法律事务），有效防范法律风险，保障公司合法合规经营。

31）综合管理部负责公司股东会、董事会、监事会联络及日常工作，负责公司行政保卫和文书档案等工作。

32）公司财务中心负责公司财务管理业务。

33）技术运营部负责公司IT基础设施的规划与建设，公司日常运营的技术支持与服务，保障公司信息系统安全可靠高效运行。

34）系统研发部负责公司信息系统的需求管理、规划设计、项目管理、开发测试、以及上线运营后的应用支持工作。

35）系统规划架构部负责研究公司信息系统的规划和架构，规范指导公司信息系统的建设。

36）金融科技部跟踪研究人工智能、大数据等创新技术，推动智能技术与公司业务的融合及智能化成果在公司的应用，推进相关项目的建设实施运营。

37）核算部负责公司管理资产的会计核算、估值、信息披露工作，负责开放式基金募集期、开放期销售款项的集中结算工作，以及各银行账户的管理工作。

38）集中交易室负责执行基金经理和投资经理下达的投资指令及特殊投资业务的具体操作，保存交易记录，备份交易数据。

39）数据信息支持部负责参与公司数据中心的建设与应用，负责产品运作中跨部门数据的制作或统筹报送、产品生命周期中特殊事项的支持以及部分基金信息披露材料的牵头制作等工作。

40）宣传策划部负责制作宣传材料，传播公司信息，管理媒体关系，管理广告投放等。

41）注册登记部负责进行开放式基金、特定多个客户资产管理计划及养老金产品的注册登记业务。

42）投资发展部负责公司新业务的规划管理及新金融产品的设计、开发；为市场营销工作提供专业支持。

43）人力资源部负责拟订公司人力资源战略并付诸实施，具体负责公司的招聘、培训、薪酬福利、绩效考核、人事管理等工作。

11. 人员情况

截至2018年12月31日，本公司有正式员工734人，硕士及以上学历人员占比75%，其中524人具有硕士研究生学历，27人具有博士研究生学历。

12. 信息披露负责人：张南

电话：020–85102688

13. 基金管理业务介绍

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于2001年4月17日，总部设在广州，在北京、上海、香港、深圳、成都、大连等地设有办公场所，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为投资人的资产实现持续稳定的保值增值，成为国内领先的综合性资产管理机构，具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一，拥有公募、社保、年金、专户、QDII、QFII、RQFII、保险资金委托投资、基本养老保险基金投资等业务资格，投资业务包括主动权益、指数量化、固定收益、国际投资、多资产投资、另类投资等六大板块，为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至2018年12月31日，易方达的总资产管理规模达到1.2万亿元，其中公募基金管理规模6540亿元。

14. 本基金基金经理

胡剑先生，经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理（自2012年11月8日至2014年3月28日）、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理（自2013年4月22日至2015年3月13日）、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2013年4月22日至2015年3月13日）、易方达纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2013年7月30日至2015年3月13日）、易方达裕景添利6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2016年4月12日至2018年2月9日）。现任易方达基金管理有限公司固定收益投资部总经理、固定收益研究部总经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理（自2012年2月29日起任职）、易方达信用债债券型证券投资基金基金经理（自2013年4月24日起任职）、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理（自2013年12月17日起任职）、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年2月4日起任职）、易方达高等级信用债债券型证券投资基金基金经理（自2017年3月7日起任职）、易方达丰惠混合型证券投资基金基金经理（自2017年3月24日起任职）、易方达瑞富灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年5月12日起任职）、易方达瑞智灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年6月21日起任职）、易方达瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年6月23日起任职）、易方达瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2018年1月19日起任职）、易方达瑞棋灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2018年1月29日起任职）、易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理（自2018年7月5日起任职）、易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金经理（自2019年1月4日起任职）。

纪玲云女士，经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司固定收益研究员、投资经理助理兼固定收益研究员、现任易方达基金管理有限公司固定收益研究部总经理助理、易方达信用债债券型证券投资基金基金经理（自2013年9月14日起任职）、易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理（自2018年7月5日起任职）、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2019年1月11日起任职）、易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理助理、易方达丰惠混合型证券投资基金基金经理助理。

付浩先生，经济学硕士。曾任广东粤财信托投资有限公司国际金融部职员，深圳和君创业研究咨询有限公司管理咨询项目经理，湖南证券投资银行总部项目经理，融通基金管理有限公司研究策划部研究员，易方达基金管理有限公司权益投资总部副总经理、养老金与专户权益投资管理副总经理、公募基金投资部总经理、基金经理助理、投资经理、易方达策略成长证券投资基金基金经理（2004年2月14日至2005年12月31日）、科瑞证券投资基金基金经理（自2006年1月1日至2012年9月27日）、易方达科翔股票型证券投资基金基金经理（自2011年1月1日至2014年5月9日）。现任易方达基金管理有限公司权益投资管理部总经理、易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理（自2018年7月5日起任职）、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2018年8月4日起任职）。

肖林先生，经济学学士。曾任易方达基金管理有限公司交易员、运作支持专员、研究员、易方达瑞惠灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理（自2016年5月31日至2018年12月30日）。现任易方达基金管理有限公司易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理（自2018年7月5日起任职）。

（二）基金托管人

1. 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年9月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

信息披露负责人：田青

联系电话：(010)6759 5096

资产托管部负责人：纪伟

2.主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。具拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部开担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑然平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原打，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3. 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2018年二季度末，中国建设银行已托管957只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

（三）基金验资机构

会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：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

主要经营场所：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

执行事务合伙人：TonyMao毛毅宁

电话：(010)58153000

传真：(010)85188298

经办注册会计师：赵雅、李明明

联系人：赵雅

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件2。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019年3月22日资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资产	本报告期末（2019年3月22日）
资产：	
银行存款	5,982,826.85
结算备付金	52,396,463.69
存出保证金	27,681.70
交易性金融资产	26,702,760,513.57
其中：股票投资	680,045,413.57
基金投资	–
债券投资	26,022,715,100.00
资产支持证券投资	–
贵金属投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	19,800,129.90
应收证券清算款	67,597.34
应收利息	586,879,768.85
应收股利	–
应收申购款	–
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	27,367,914,981.90
负债和所有者权益	
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	1,739,000,000.00
应付证券清算款	419,161.64
应付赎回款	–
应付管理人报酬	1,543,973.24
应付托管费	463,191.97
应付销售服务费	–
应付交易费用	60,661.15
应交税费	912,481.77
应付利息	–279,441.09
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	88,578.32
负债合计	1,742,208,607.00
所有者权益：	
实收基金	24,449,355,786.76
未分配利润	1,176,350,588.14
所有者权益合计	25,625,706,374.90
负债和所有者权益总计	27,367,914,981.90

八、基金投资组合

截至2019年3月22日，易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	680,045,413.57	2.48
	其中：股票	680,045,413.57	2.48
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	26,022,715,100.00	95.08
	其中：债券	26,022,715,100.00	95.08
	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	19,800,129.90	0.07
	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	58,379,290.54	0.21
8	其他资产	586,975,047.89	2.14
9	合计	27,367,914,981.90	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

（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	8,308,938.00	0.03
B	采矿业	–	–
C	制造业	155,546.58	0.00
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	15,604.44	0.00
J	金融业	664,869,138.55	2.59
K	房地产业	6,696,186.00	0.03
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	–	–
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	680,045,413.57	2.65

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601319	中国人保	74,850,000	652,692,000.00	2.55
2	300498	温氏股份	221,100	8,308,938.00	0.03
3	000002	万科A	229,400	6,696,186.00	0.03
4	601288	农业银行	1,674,800	6,230,256.00	0.02
5	601318	中国平安	75,500	5,641,360.00	0.02
6	600928	西安银行	19,377	235,430.55	0.00
7	002958	青农商行	17,700	70,092.00	0.00
8	300762	上海瀚讯	1,233	51,206.49	0.00
9	300765	新诺威	1,412	49,758.88	0.00
10	002951	金时科技	1,675	38,575.25	0.00

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	3,561,663,000.00	13.90
	其中：政策性金融债	3,561,663,000.00	13.90
4	企业债券	3,548,826,100.00	13.85
5	企业短期融资券	1,660,700,000.00	6.48
6	中期票据	4,882,396,000.00	19.05
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	12,369,130,000.00	48.27
9	其他	–	–
10	合计	26,022,715,100.00	101.55

（五）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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	111811221	18平安银行CD221	30,000,000	2,909,400,000.00	11.35
2	111809224	18浦发银行CD224	22,000,000	2,123,660,000.00	8.29
3	180212	18国开12	18,600,000	1,884,366,000.00	7.35
4	111882211	18南京银行CD101	12,000,000	1,163,400,000.00	4.54
5	111817167	18光大银行CD167	11,000,000	1,061,830,000.00	4.14

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金于2019年3月22日未持有资产支持证券。

（七）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

本基金于2019年3月22日未持有贵金属。

（八）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权证投资明细

本基金于2019年3月22日未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金于2019年3月22日未投资股指期货。

（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金于2019年3月22日未投资国债期货。

（十一）投资组合报告附注

1.18浦发银行CD224（代码：111809224）为易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的前十大持仓证券。2018年7月26日，中国人民银行针对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易的违法违规事实，罚款人民币170万元。

18光大银行CD167（代码：111817167）为易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的前十大持仓证券。2018年11月9日，中国银行保险监督管理委员会对中国光大银行股份有限公司关于以下违规事实：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）以员工方式违规销售理财产品；（三）以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；（四）违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；（五）同业投资违规授受担保；（六）通过同业投资或贷款虚增存款规模，处以没收违法所得100万元，罚款1020万元，合计1120万元。

18上海银行CD269（代码：111816269）、18上海银行CD266（代码：111816266）为易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的前十大持仓证券。2018年9月27日，上海银监局针对上海银行股份有限公司信用卡中心2014年至2017年间，该中心部分信用卡卢氏分期资金用途核查未执行标准统一的业务流程，以及2017年，该中心未对某涉嫌套现的特约商户停止服务的违法违规事实，责令上海银行改正，并处罚款共计100万元。2018年10月8日，上海银监局针对上海银行股份有限公司2015年5月至2016年5月，该行违规向其关系人发放信用贷款的违法违规事实，责令上海银行改正，并罚没合计1091460.03元。2018年10月18日，上海银监局针对上海银行股份有限公司2017年，该行对某同业金融业务违规授同贷本金不足的房地产项目合规性审查未尽职的违法违规事实，责令上海银行改正，并处罚款50万元。

18平安银行CD221（代码：111811221）为易方达3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的前十大持仓证券。2018年6月28日，天津银监局针对平安银行贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；