

易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资 基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达中证香港证券投资主题 ETF
场内简称	香港证券、香港证券 ETF
基金主代码	513090
交易代码	513090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 13 日
报告期末基金份额总额	596,488,000.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的

	指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	中证香港证券投资主题指数收益率（使用估值汇率折算）
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金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、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。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020年7月1日-2020年9月30日)
1.本期已实现收益	18,050,546.88
2.本期利润	-25,333,803.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0462
4.期末基金资产净值	710,234,955.96
5.期末基金份额净值	1.1907

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。

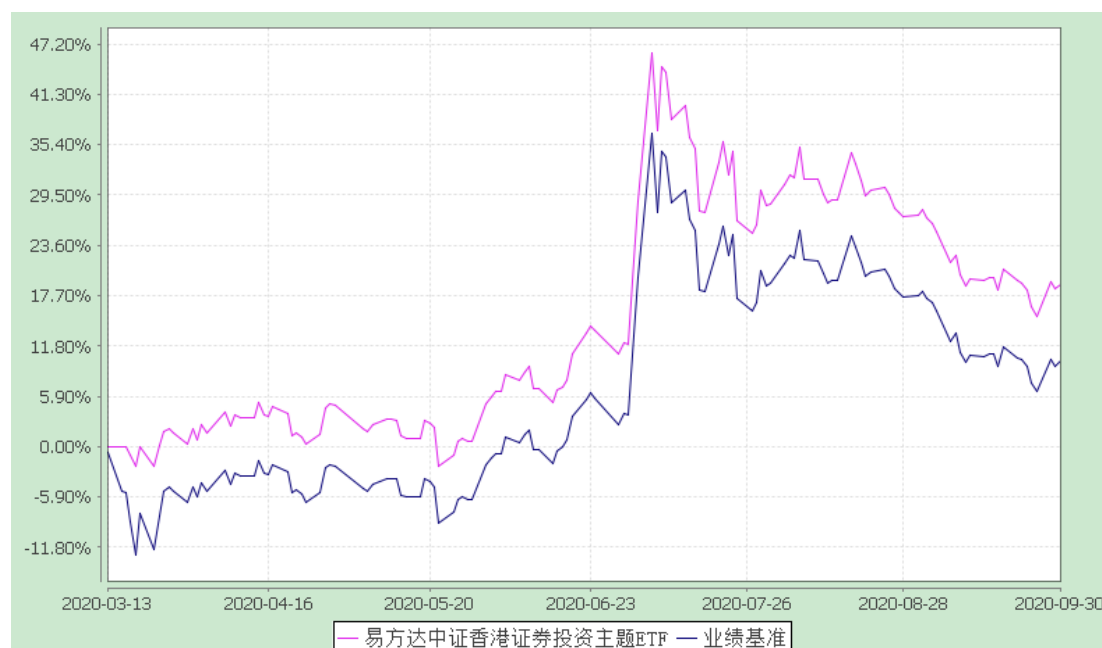
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	6.13%	3.00%	5.93%	3.10%	0.20%	-0.10%
过去六个月	16.59%	2.41%	15.39%	2.49%	1.20%	-0.08%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	19.07%	2.34%	10.00%	2.58%	9.07%	-0.24%

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

易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 （2020 年 3 月 13 日至 2020 年 9 月 30 日）



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.本基金合同于 2020 年 3 月 13 日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

3.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(第十四部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

4.自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为 19.07%,同期业绩比较基准收益率为 10.00%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
FA N BI NG	本基金的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达原油证券投资基金(QDII)的基金	2020-03-13	-	15 年	新加坡籍,硕士研究生,具有基金从业资格。曾任皇家加拿大银行托管部核算专员,美国道富集团中台交易支持专员,巴克莱资产管理

范冰)	<p>经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理</p>				<p>公司悉尼金融数据部高级金融数据分析师、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管，贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理，易方达基金管理有限公司易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金基金经理。</p>
成曦	<p>本基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金</p>	2020-03-13	-	12 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基</p>

	经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达原油证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				金经理、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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，“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。

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 公平交易专项说明

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。本基金管理人制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 8 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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2020 年三季度，在宽松的政策刺激及流动性的推动下，全球股市延续了涨势。美联储维持利率水平不变，并公布新的货币政策框架，把充分就业放在核心，市场预期当前的低利率水平将维持到 2022 年。全球疫情出现再次扩散，美国共和党与民主党就新一轮财政救助的谈判处于僵局。中国经济先于全球复苏，资本市场改革进一步推进，科创板上市公司数量继续增加，蚂蚁金服 IPO 的进程引起市场广泛关注，陆港通双向资金流动稳步增长。7 月初，在金融板块整体强劲表现的带动下，香港证券指数出现大幅上涨，随后震荡回调。

作为追踪中证香港证券投资主题指数的被动式指数基金，我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，力求追踪误差最小化。

4.5 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 1.1907 元，本报告期份额净值增长率为 6.13%，同期业绩比较基准收益率为 5.93%，年化跟踪误差 1.87%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	694,448,082.16	95.30
	其中：股票	694,448,082.16	95.30
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	33,640,609.76	4.62
7	其他资产	598,139.99	0.08
8	合计	728,686,831.91	100.00

注：1.上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

2.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 694,448,082.16 元,占净值比例 97.78%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 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	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	694,448,082.16	97.78
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	694,448,082.16	97.78

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 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	00388	香港交易所	360,600	114,642,275.10	16.14
2	06030	中信证券	7,061,000	106,843,933.86	15.04
3	03908	中金公司	5,285,600	82,951,885.04	11.68
4	06837	海通证券	11,836,800	68,232,087.80	9.61
5	06886	华泰证券	5,967,600	66,387,134.32	9.35
6	01776	广发证券	5,937,400	50,973,139.49	7.18
7	06881	中国银河	12,859,000	49,152,653.09	6.92
8	06066	中信建投证 券	3,080,000	29,338,000.38	4.13
9	06099	招商证券	3,557,840	28,762,375.52	4.05
10	02611	国泰君安	2,429,400	22,927,347.83	3.23

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2019 年 11 月 13 日，中国人民银行兰州市中心支行对招商证券股份有限公司兰州庆阳路证券营业部于 2018 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日未按照规定

履行反洗钱客户身份识别义务的违法违规事实，责令整改并处罚款 20 万元的行政处罚。

2020 年 4 月 8 日，中国人民银行长春中心支行对招商证券股份有限公司长春人民大街证券营业部未按照规定履行客户身份识别义务的违法违规事实，责令整改并处罚款 22 万元的行政处罚。

2019 年 12 月 27 日，中国人民银行呼和浩特中心支行对银河证券股份有限公司内蒙古分公司未按规定有效履行反洗钱客户身份识别义务和未按规定报送可疑交易报告的违法违规事实，责令整改并处罚款 40 万元的行政处罚。

2020 年 2 月 10 日，中国人民银行针对华泰证券股份有限公司如下违法事实：1、未按规定履行客户身份识别义务；2、未按规定报送可疑交易报告；3、与身份不明的客户进行交易，处以责令改正，并处罚款 1010 万元的行政处罚。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除华泰证券、银河证券、招商证券外，本基金投资的其他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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	461,699.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	95,145.46
4	应收利息	2,179.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	39,115.66
8	其他	-
9	合计	598,139.99

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	328,488,000.00
报告期基金总申购份额	403,500,000.00
减：报告期基金总赎回份额	135,500,000.00
报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	596,488,000.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

8.2 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。

8.3 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

二〇二〇年十月二十八日