

易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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：中国工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。

基金托管人中国工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

2.1 基金产品概况

基金简称	易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII)
基金主代码	007813
交易代码	007813
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 24 日
报告期末基金份额总额	9,362,993.50 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达中证浙江新动能 ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证浙江新动能 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，本基金力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内。本基金将在综合考虑合规、

	<p>风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或二级市场方式进行易方达中证浙江新动能 ETF 的投资。本基金可投资于标的指数成份股、备选成份股（含美国存托凭证等），以更好的跟踪业绩比较基准。同时，在条件允许的情况下还可通过买入标的指数成份股、备选成份股（含美国存托凭证等）来构建组合以申购目标 ETF。对可投资于标的指数成份股、备选成份股（含美国存托凭证等）的资金头寸，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股（含美国存托凭证等）组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。</p>
业绩比较基准	中证浙江新动能指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	<p>本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于易方达中证浙江新动能 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证浙江新动能指数的表现密切相关。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。</p>
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
境外投资顾问	英文名称：无

	中文名称：无	
境外资产托管人	英文名称：The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	
	中文名称：香港上海汇丰银行有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达中证浙江新动能 ETF 联接（QDII）A	易方达中证浙江新动能 ETF 联接（QDII）C
下属分级基金的交易代码	007813	007814
报告期末下属分级基金的份额总额	5,786,850.92 份	3,576,142.58 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159803
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2020 年 4 月 27 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 26 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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（含美国存托凭证等）组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成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（含美国存托凭证等）时，基金管理人可采取包括成份股（含美国存托凭证等）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。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品，如与标的指数或标

	的指数成份股、备选成份股（含美国存托凭证等）等相关的衍生工具。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。此外，本基金可根据届时有效的法律法规和监管机构的有关规定开展融券业务。本基金力争将年化跟踪误差控制在 3% 以内。
业绩比较基准	中证浙江新动能指数收益率
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。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。

§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)	
	易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) A	易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) C
	1.本期已实现收益	-8,981.09
2.本期利润	424,293.42	178,520.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0602	0.0450
4.期末基金资产净值	6,037,220.44	3,728,092.43
5.期末基金份额净值	1.0433	1.0425

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

易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) A

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	3.30%	0.98%	9.97%	1.51%	-6.67%	-0.53%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.33%	0.76%	24.26%	1.33%	-19.93%	-0.57%

易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) C

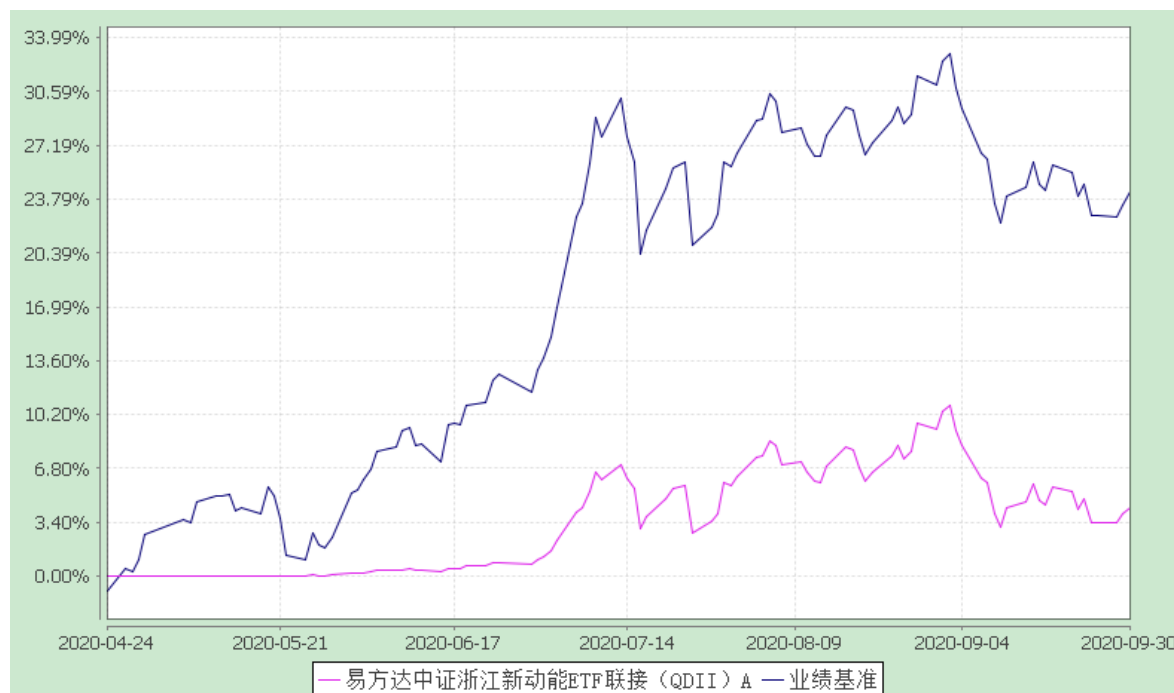
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.25%	0.98%	9.97%	1.51%	-6.72%	-0.53%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.25%	0.76%	24.26%	1.33%	-20.01%	-0.57%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

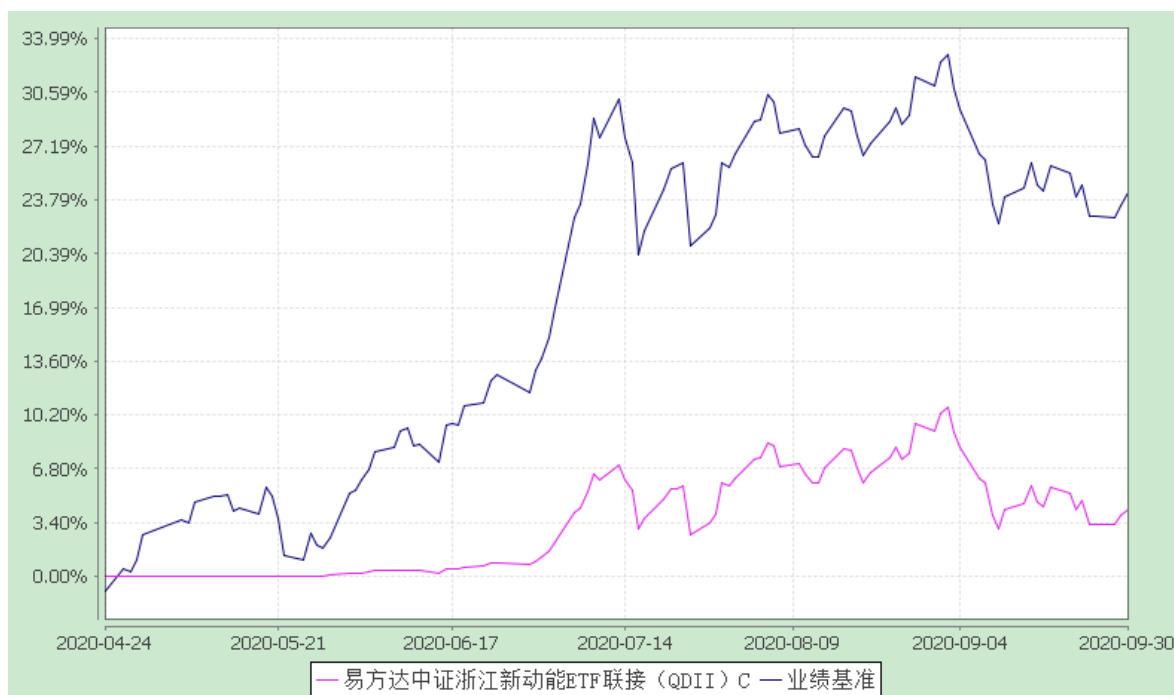
易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 4 月 24 日至 2020 年 9 月 30 日)

易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) A



易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) C



注：1.本基金合同于2020年4月24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，自基金合同生效之日起六个月内使基金
的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、
投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为4.33%，C类基金
份额净值增长率为4.25%，同期业绩比较基准收益率为24.26%。

§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		
杨俊	本基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证国企一带一路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、易方达中证浙江新动	2020-04-24	-	11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北京分公司

	能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、指数增强投资部总经理助理				渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理、解决方案部总经理助理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达中证 500 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。
刘树荣	本基金的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经	2020-04-28	-	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理

<p>理（自 2017 年 07 月 18 日至 2020 年 08 月 06 日）、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、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）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、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 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、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证国企一带一路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、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）的基金经理</p>			<p>有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、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金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达标普信息技术指数证券投资基金（LOF）基金经理。</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，“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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程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相应的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 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。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金跟踪的标的指数为中证浙江新动能指数。中证浙江新动能指数选取全球主要交易所上市的浙江省企业作为样本股，采用自由流通市值加权，以全面反映浙江省上市企业的表现。目前，浙江新动能指数成份股上市地集中在沪深交易所、香港及美国交易所。

中证浙江新动能指数由浙江省上市企业组成，指数二级市场表现与国内经济发展形势密切相关。经济方面，9 月 PMI 继续回升，其中制造业、非制造业商务活动、服务业景气度均继续上升，建筑业高位持平；8 月规模以上工业企业利润当月同比增长 19.1%，规模以上工业增加值当月同比增长 5.6%，以上数据均显示国内经济基本面正在温和复苏。货币和流动性的边际变化是影响投资者的风险偏好与资产价格的重要因素，当前 A 股部分行业估值较高，对利率和流动性的

敏感性明显上升。三季度，市场流动性出现边际收紧的迹象，与此同时，市场担忧经济刺激政策退出对经济复苏进展的影响、疫情可能出现的再度爆发对经济的冲击、中美摩擦加剧等外围不确定性因素的干扰，A 股走势呈现冲高回落态势。以阿里巴巴、海康威视为代表的浙江省上市企业三季度二级市场表现较好，中证浙江新动能指数冲高后横盘震荡，最终上涨 10.47%，小幅跑赢沪深 300 指数。

本基金是易方达中证浙江新动能 ETF 的联接基金，主要投资于易方达中证浙江新动能 ETF。基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作，本基金仍处于建仓期，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标仍在调整之中。

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0433 元，本报告期份额净值增长率为 3.30%，同期业绩比较基准收益率为 9.97%；C 类基金份额净值为 1.0425 元，本报告期份额净值增长率为 3.25%，同期业绩比较基准收益率为 9.97%。年化跟踪误差 11.05%，大于合同规定的目标控制范围，因本报告期包含了基金合同规定的建仓期，故跟踪误差等指标在调整之中。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

自 2020 年 8 月 21 日至本报告期末，本基金均存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

§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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-

	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	8,994,544.63	90.27
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	963,381.92	9.67
8	其他资产	5,889.21	0.06
9	合计	9,963,815.76	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	8,994,544.63	92.11

5.3 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有权益投资。

5.4 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有权益投资。

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十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有权益投资。

5.6 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.9 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.10 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式(ETF)	易方达基金管理有限公司	8,994,544.63	92.11

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2019 年 11 月 15 日，杭州市税务局针对杭州泰格医药科技股份有限公司以下违法违规行为：1、员工支付补充商业医疗保险，支出未并计当月的工资薪金收入代扣代缴相应的个人所得税；2、将非本公司员工的补充商业医疗保险在管理费用列支，分别处以罚款 69673 元和 20077.24 元。

2019 年 12 月 5 日，宁波银保监局对宁波银行作出“罚款人民币 40 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分”的行政处罚。违法违规事由：设立时点性规模考核指标，股权质押管理不合规。

本基金为目标 ETF 的联接基金，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。除泰格医药、宁波银行外，本基金目标 ETF 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。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。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	1,612.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	121.13
5	应收申购款	4,155.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,889.21

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

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证浙江新动能ETF联接(QDII)	易方达中证浙江新动能ETF联接(QDII)

	A	C
报告期期初基金份额总额	11,510,310.80	5,310,724.72
报告期基金总申购份额	609,998.63	655,864.31
减：报告期基金总赎回份额	6,333,458.51	2,390,446.45
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	5,786,850.92	3,576,142.58

§7 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浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的文件；
2. 《易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
3. 《易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

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