

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

2021 年第 2 季度报告

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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 16 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	易方达恒生国企联接（QDII）
基金主代码	110031
交易代码	110031
基金运作方式	契约型开放式、指数基金、联接基金
基金合同生效日	2012 年 8 月 21 日
报告期末基金份额总额	1,290,400,915.86 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达恒生中国企业 ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达恒生中国企业 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用

	申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行易方达恒生中国企业 ETF 的投资。本基金可投资恒生中国企业指数成份股及备选成份股、恒生中国企业指数期货或期权等金融衍生工具。本基金力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内。	
业绩比较基准	恒生中国企业指数（使用估值汇率折算）收益率 $\times 95\%$ + 活期存款利率（税后） $\times 5\%$	
风险收益特征	<p>本基金是 ETF 联接基金，理论上其风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。</p> <p>本基金主要通过投资于易方达恒生中国企业 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恒生中国企业指数的表现密切相关。此外，本基金通过主要投资于易方达恒生中国企业 ETF 间接投资于香港证券市场，需承担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	交通银行股份有限公司	
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	易方达恒生国企联接（QDII）A	易方达恒生国企联接（QDII）C
下属分级基金的交易代码	110031	005675
报告期末下属分级基金的份额总额	989,615,238.72 份	300,785,677.14 份

注：1.自2018年2月9日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2018

年2月12日。

2.易方达恒生国企联接（QDII）A含A类人民币份额（份额代码：110031）、A类美元现汇份额（份额代码：110032）及A类美元现钞份额（份额代码：110033），交易代码仅列示A类人民币份额代码。易方达恒生国企联接（QDII）C含C类人民币份额（份额代码：005675）。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510900
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2012年8月9日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012年10月22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	交通银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资，即参考恒生中国企业指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据恒生中国企业指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整。当市场流动性不足等情况导致本基金无法按照指数构成及权重进行组合构建时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品进行替代。为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差以及提高投资效率，本基金可投资恒生H股指数期货或期权等金融衍生工具。本基金力争将年化跟踪误差控制在3%以内。
业绩比较基准	恒生中国企业指数（使用估值汇率折算）
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本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。本基金主要投资香港证券市场上市的中国企业，需承担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 (2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	易方达恒生国企联接 (QDII) A	易方达恒生国企联接 (QDII) C
1.本期已实现收益	-2,451,431.34	-975,069.53
2.本期利润	-41,683,574.75	-12,533,801.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0404	-0.0405
4.期末基金资产净值	1,138,951,880.05	350,668,222.75
5.期末基金份额净值	1.1509	1.1658

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

易方达恒生国企联接（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	-3.34%	0.89%	-4.09%	0.90%	0.75%	-0.01%
过去六个月	-0.98%	1.24%	-1.68%	1.24%	0.70%	0.00%
过去一年	0.74%	1.18%	-0.33%	1.19%	1.07%	-0.01%

过去三年	-0.05%	1.23%	-4.38%	1.25%	4.33%	-0.02%
过去五年	26.40%	1.16%	18.75%	1.19%	7.65%	-0.03%
自基金合同生效起至今	15.09%	1.24%	11.33%	1.29%	3.76%	-0.05%

易方达恒生国企联接（QDII）C

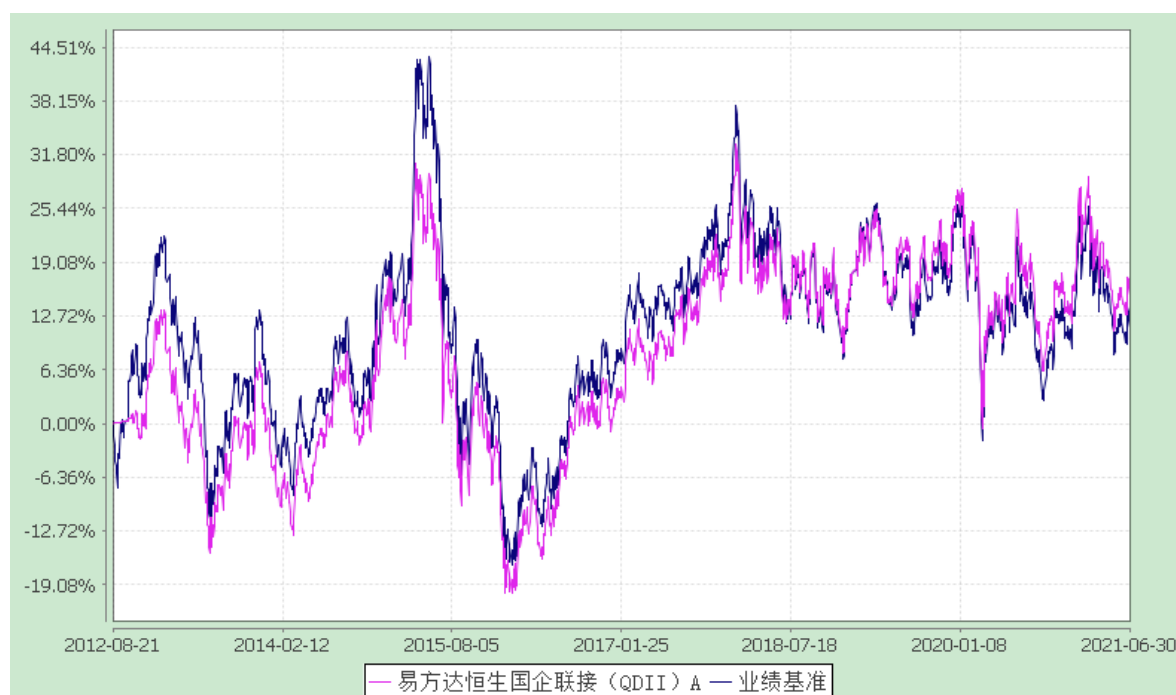
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.41%	0.89%	-4.09%	0.90%	0.68%	-0.01%
过去六个月	-1.11%	1.24%	-1.68%	1.24%	0.57%	0.00%
过去一年	0.47%	1.18%	-0.33%	1.19%	0.80%	-0.01%
过去三年	1.86%	1.23%	-4.38%	1.25%	6.24%	-0.02%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-0.30%	1.23%	-7.01%	1.25%	6.71%	-0.02%

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

易方达恒生中国企业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

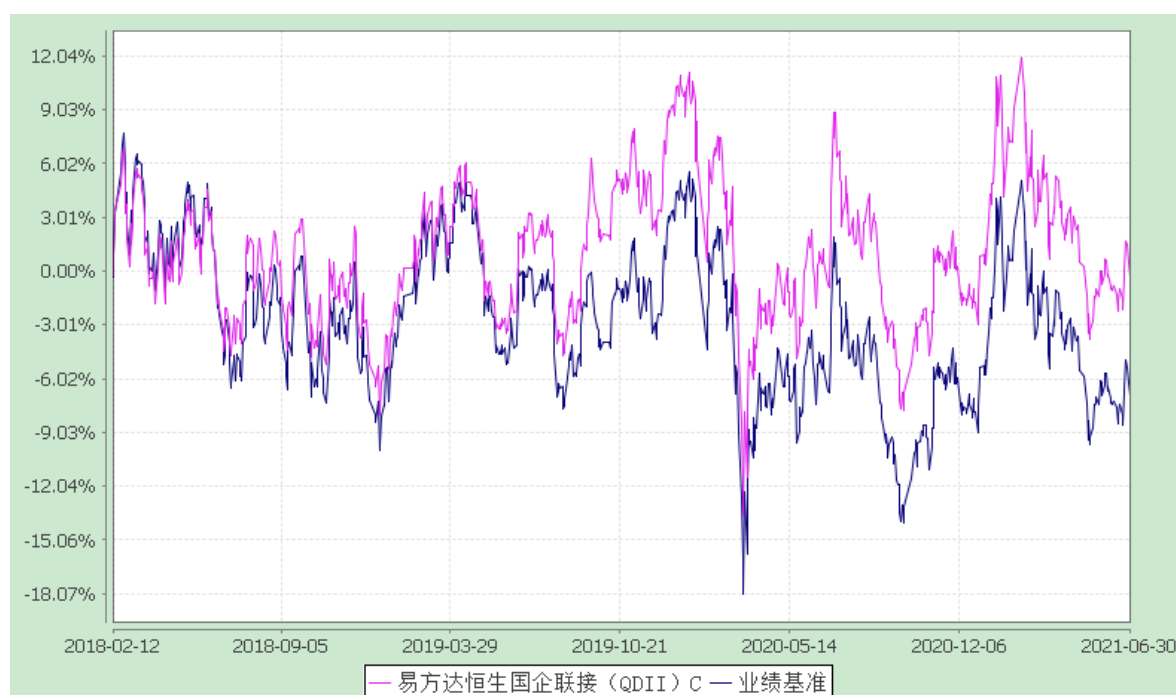
易方达恒生国企联接（QDII）A

（2012 年 8 月 21 日至 2021 年 6 月 30 日）



易方达恒生国企联接（QDII）C

（2018 年 2 月 12 日至 2021 年 6 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.自2018年2月9日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2018年2月12日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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15.09%，同期业

绩比较基准收益率为11.33%。C类基金份额净值增长率为-0.30%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

§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		
成曦	本基金的基金经理、易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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联接基金的基金经理、易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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、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的基金经理（自 2020 年 03 月 13 日至 2021 年 04 月 14 日）、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、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资	2018-08-11	-	13 年	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金经理、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）基

	<p>资基金的基金经理</p>			<p>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、易方达原油证券投资基金 (QDII) 基金经理、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达</p>
--	-----------------	--	--	---

					上证 50 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。
余海燕	<p>本基金的基金经理、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 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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、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、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理 (自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理 (自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日)、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、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理 (自 2017 年 07 月 27 日至 2021 年 04 月 14 日)、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理 (自 2017 年 07 月 14 日至 2021 年 04 月 14 日)、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、易方达沪深 300 交易型开放式</p>	2018-08-11	-	16 年	<p>硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理、易方达上证 50 指数分级证券投资基金基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金基金经理。</p>

	指数发起式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深 300 医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员			
--	---	--	--	--

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 12 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恒生中国企业指数，恒生中国企业指数的成份股为在香港上市交易的内地公司，涵盖了 H 股、红筹股及民营企业。上市公司的基本面变化取决于国内经济的增长前景，但市场交易主体包括欧美等海外资金，流动性受欧美等发达经济体的直接影响。该指数是香港市场最具影响力的基准指数之一。本基金主要采取完全复制法及适当的替代性策略以更好的跟踪指数，实现投资目标。

2021 年二季度，港股市场表现不佳，主要源于海外疫情的反复，间接影响了全球经济复苏进度。报告期间，海外发达国家和中国经济复苏速度分化加大，地缘政治风险有所抬头，同时大宗商品市场价格波动加剧，综合导致全球经济波动加大。此外，美联储开始收紧流动性，通胀也有所抬头，经济复苏进程不确定性提升，进而影响全球资金的风险偏好。最后，二季度的美元指数也是一路走低，也带低了港币汇率。

国内经济复苏稳定推进，除了科技成长公司外，周期类公司业绩逐渐抬升，港股基本面无忧。但是受到汇率波动，海外货币政策干扰，风险偏好停留在较低水平。恒生中国企业指数二季度表现受互联网公司反垄断的影响较大，短期业绩被压制。并且，港股本身以业绩为锚，所以短期表现受限。

报告期间，中概股陆续回归港股，使得恒生中国企业指数新经济占比继续上升，也保证指数未来的增长空间。

恒生中国企业指数近两年陆续纳入了阿里巴巴、小米、美团、快手、百度、阿里健康、海底捞、京东集团等新经济成份股。优化后的指数更全面地代表了香港上市的中国企业整体表现，随着新经济产业及对应公司的调入，指数成长性显著提升。

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

以及成分股调整事项，保障基金的正常运作。

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.1509 元，本报告期份额净值增长率为-3.34%，同期业绩比较基准收益率为-4.09%；C 类基金份额净值为 1.1658 元，本报告期份额净值增长率为-3.41%，同期业绩比较基准收益率为-4.09%，年化跟踪误差 0.66%，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（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	1,409,540,148.37	91.61
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	128,096,185.68	8.33
8	其他资产	943,506.12	0.06
9	合计	1,538,579,840.17	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	易方达恒生中国企业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	1,409,540,148.37	94.62

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.5.1 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	易方达恒生中国企业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	1,409,540,148.37	94.62

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对中国建设银行股份有限公司的如下违法违规行作出“罚款合计 3920 万元”的行政处罚决定：（一）内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件；（二）理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；（三）逆流程开展业务操作；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）未做到理财业务与自营业务风险隔离；（六）个人理财资金违规投资；（七）违规为理财产品提供隐性担保；（八）同业投资违规接受担保。

2020 年 11 月 6 日，中国人民银行衡水市中心支行对中国工商银行股份有限公司违反反洗钱法的行为，处以 21 万元罚款，对高管及直接责任人各处 1 万元罚款，共计 23 万元。

2020 年 11 月 10 日，国家外汇管理局北京外汇管理部针对中国工商银行股份有限公司违规开展外汇掉期业务、外汇远期业务和外汇期权业务的违法事实，处以 100 万元人民币罚款，要求该行对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予处分。

2020 年 12 月 25 日中国银行保险监督管理委员会针对中国工商银行股份有限公司如下违法违规行为作出罚款 5470 万元的行政处罚决定：1、未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告；2、关键岗位未进行实质性轮岗；3、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞；4、为同业投资业务提供隐性担保；5、理财产品通过申购/赎回净值型理财产品调节收益；6、非标准化

债权资产限额测算不准确；7、理财资金通过投资集合资金信托计划优先级的方式变相放大劣后级受益人的杠杆比例；8、部分重点领域业务未向监管部门真实反映；9、为违规的政府购买服务项目提供融资；10、理财资金违规用于缴纳或置换土地款；11、通过转让分级互投实现不良资产虚假出表；12、理财资金投资本行不良资产或不良资产收益权；13、面向一般个人客户发行的理财产品投资权益性资产；14、理财资金投资他行信贷资产收益权或非标资产收益权；15、全权委托业务不规范；16、用其他资金支付结构性存款收益；17、自营贷款承接本行理财融资、贷款用途管理不尽职；18、理财资金承接本行自营贷款；19、封闭式理财产品相互交易调节收益；20、滚动发行产品承接风险资产，且按原价交易调节收益；21、高净值客户认定不审慎；22、理财产品信息披露不到位；23、部分理财产品在全国银行业理财信息登记系统中未登记或超时限登记。

2020 年 7 月 28 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出责令改正、并处罚款 100 万元的行政处罚决定：1、2019 年 7 月，该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务；2、2014 年 12 月至 2019 年 5 月，该中心对某信用卡申请人资信水平调查严重不审慎。

2020 年 9 月 29 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司涉嫌违反法律法规的行为处以责令整改，并处以罚款人民币 120 万元。

2020 年 11 月 27 日，国家外汇管理局深圳市分局对招商银行股份有限公司违反规定办理结汇、售汇的行为，作出“责令改正、罚款人民币 55 万元，没收违法所得 128.82 万元人民币”的行政处罚决定。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款 7170 万元的行政处罚决定：1、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；2、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；3、理财产品之间风险隔离不到位；4、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；5、同业投资接受第三方金融机构信用担保；6、理财资金池化运作；7、利用理财产品准备金调节收益；8、高净值客户认定不审慎；9、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；10、

投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；11、投资集合资金信托计划人数超限；12、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；13、信贷资产非真实转让；14、全权委托业务不规范；15、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；16、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；17、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；18、票据转贴现假卖断屡查屡犯；19、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；20、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；21、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；22、理财资金认购商业银行增发的股票；23、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；24、为定制公募基金提供投资顾问；25、为本行承销债券兑付提供资金支持；26、协助发行人以非市场化的价格发行债券；27、瞒报案件信息。

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澜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。

2020 年 12 月 14 日，阿里巴巴集团控股有限公司因未报告过去的并购交易行为被中华人民共和国国家市场监督管理总局处以 50 万元人民币罚款。

2021 年 4 月 10 日，阿里巴巴集团控股有限公司因实施“二选一”等涉嫌垄断行为被中华人民共和国国家市场监督管理总局责令阿里巴巴集团停止违法行为，并处罚 182.28 亿元。

2021 年 4 月 26 日，美团因实施“二选一”等涉嫌垄断行为被中华人民共和国国家市场监督管理总局进行调查。

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。除建设银行、工商银行、招商银行、腾讯控股、阿里巴巴、美团外，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	112,786.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,343.49
5	应收申购款	823,376.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	943,506.12

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	易方达恒生国企联接（QDII）A	易方达恒生国企联接（QDII）C

报告期期初基金份额总额	1,053,071,403.46	309,539,601.78
报告期期间基金总申购份额	64,463,879.57	25,866,637.68
减：报告期期间基金总赎回份额	127,920,044.31	34,620,562.32
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	989,615,238.72	300,785,677.14

注：易方达恒生国企联接（QDII）A份额变动含A类人民币份额、A类美元现汇份额及A类美元现钞份额；易方达恒生国企联接（QDII）C份额变动含C类人民币份额。

§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.中国证监会核准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募集的文件；
- 2.《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基金合同》；
- 3.《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

二〇二一年七月二十日