

**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**

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 | 易方达沪深 300 非银联接 |
| 基金主代码 | 000950 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 1 月 22 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,627,904,790.99 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 | 本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩 |

| | | |
|-----------------|--|------------------|
| | <p>大。本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的投资。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。本基金可投资存托凭证。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上，选择投资价值较高的资产支持证券进行投资。</p> | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 非银行金融指数收益率×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。本基金主要通过投资于易方达沪深 300 非银行金融 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。</p> | |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达沪深 300 非银联接 A | 易方达沪深 300 非银联接 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000950 | 007882 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,216,425,344.84 份 | 411,479,446.15 份 |

注：自2019年8月20日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2019年8

月21日。

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------------|
| 基金名称 | 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 |
| 基金主代码 | 512070 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式（ETF） |
| 基金合同生效日 | 2014 年 6 月 26 日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2014 年 7 月 18 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 | 中国建设银行股份有限公司 |

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（含存托凭证）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，基金管理人将采取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。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 非银行金融指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金，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，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。 |

§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) | |
|----------------|---|----------------------|
| | 易方达沪深 300 非银 联接 A | 易方达沪深 300 非银 联接 C |
| | 1.本期已实现收益 | 482,431.99 |
| 2.本期利润 | -24,507,936.50 | -8,977,758.15 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0208 | -0.0286 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,240,387,445.68 | 418,749,288.61 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0197 | 1.0177 |

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

易方达沪深 300 非银联接 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 | -2.00% | 1.28% | -3.35% | 1.30% | 1.35% | -0.02% |
| 过去六个月 | -12.88% | 1.36% | -14.16% | 1.37% | 1.28% | -0.01% |
| 过去一年 | 4.58% | 1.69% | 2.01% | 1.72% | 2.57% | -0.03% |
| 过去三年 | 35.18% | 1.68% | 25.73% | 1.71% | 9.45% | -0.03% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去五年 | 39.67% | 1.48% | 22.83% | 1.50% | 16.84% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.97% | 1.81% | -10.33% | 1.86% | 12.30% | -0.05% |

易方达沪深 300 非银联接 C:

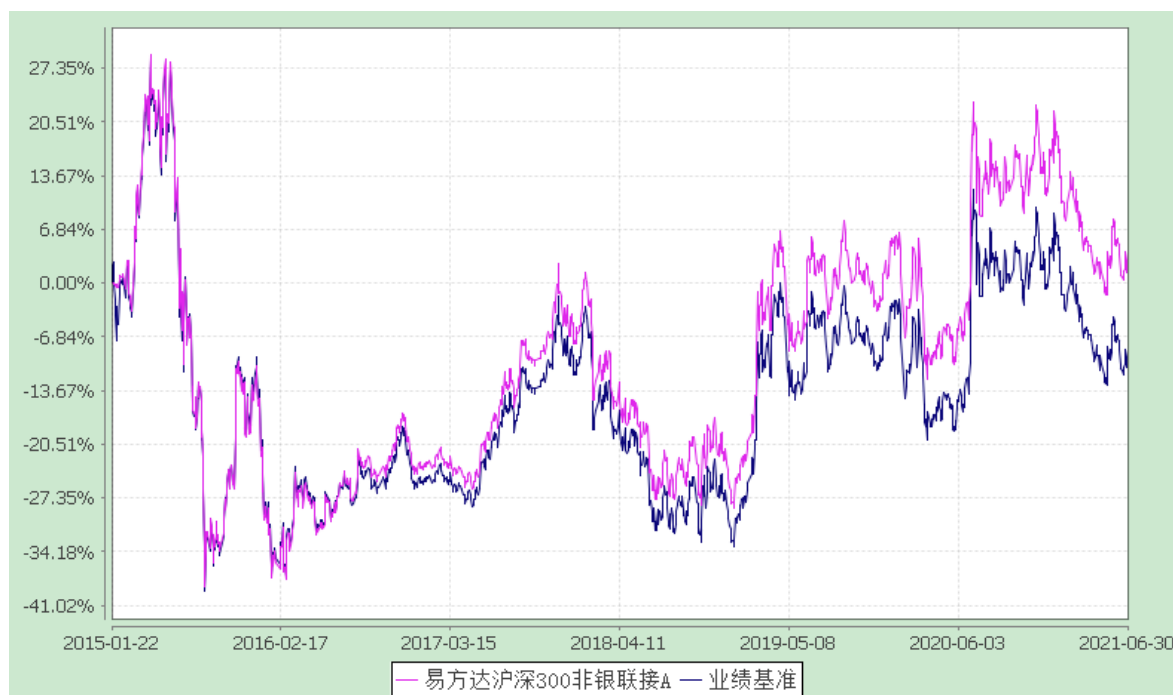
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -2.02% | 1.29% | -3.35% | 1.30% | 1.33% | -0.01% |
| 过去六个月 | -12.92% | 1.36% | -14.16% | 1.37% | 1.24% | -0.01% |
| 过去一年 | 4.49% | 1.69% | 2.01% | 1.72% | 2.48% | -0.03% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 0.70% | 1.58% | -4.31% | 1.60% | 5.01% | -0.02% |

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
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

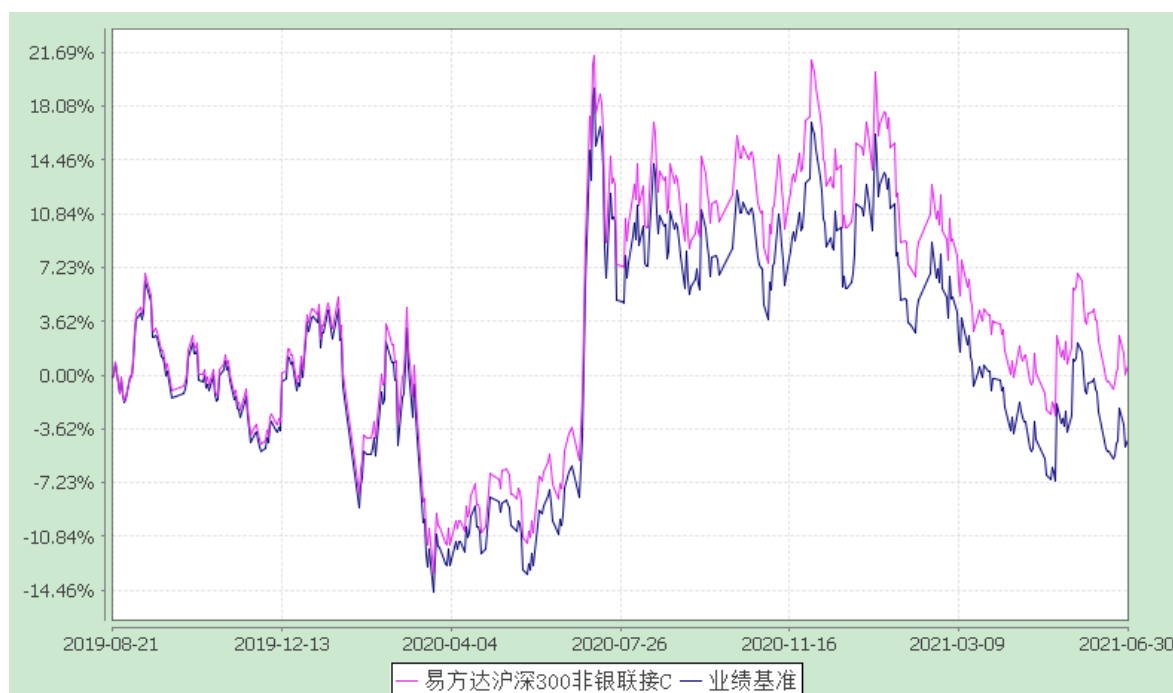
易方达沪深 300 非银联接 A:

(2015 年 1 月 22 日至 2021 年 6 月 30 日)



易方达沪深 300 非银联接 C:

(2019 年 8 月 21 日至 2021 年 6 月 30 日)



注: 1.自 2019 年 8 月 20 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2019 年 8 月 21 日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末, A 类基金份额净值增长率为 1.97%, 同期业绩比较基准收益率为-10.33%。C 类基金份额净值增长率为 0.70%, 同期业绩比较基准收益

率为-4.31%。

§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 | | |
| 余海燕 | 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 | 2015-01-22 | - | 16 年 | 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>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</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 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 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 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年二季度中国经济依旧维持稳步复苏趋势，整体运行稳中加固、稳中向好，推动中国经济在疫情后快速恢复的出口和房地产投资这两大动能都有放缓迹象。国家统计局公布的数据显示，2021 年 1-5 月份全国规模以上工业企业利润同比增长 83.4%，较 2019 年同期增长 48.0%。制造业景气度整体稳定，6 月份中国制造业采购经理指数（制造业 PMI）为 50.9%。宏观政策方面，货币政策延续“温和正常化”态势，市场流动性依然保持在合理充裕的水平。资本市场方面，A 股市场整体震荡上涨，不同指数间表现差异明显，最终二季度上证综指以上涨 4.34% 收官。在风格方面，创业板、科创板等成长板块在前期大幅调整后显著反弹，大幅领先价值板块，本季度上证 50 指数、沪深 300 指数、创业板指、科创 50 指数收益率分别为 -1.15%、3.48%、26.05%、27.23%；行业方面，电气设备、电子、汽车、化工、医药生物、有色金属等板块涨幅居前，保险、家用电器、农林牧渔、房地产、公用事业等板块表现相对落后。报告期

内沪深 300 非银行金融指数下跌 3.55%。

本基金是易方达沪深 300 非银 ETF 的联接基金，主要投资于易方达沪深 300 非银 ETF。报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，依据基金申购赎回变动的情况进行日常操作，控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低水平上。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0197 元，本报告期份额净值增长率为-2.00%，同期业绩比较基准收益率为-3.35%；C 类基金份额净值为 1.0177 元，本报告期份额净值增长率为-2.02%，同期业绩比较基准收益率为-3.35%，年化跟踪误差 1.26%，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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 1,564,417,705.10 | 93.96 |
| 3 | 固定收益投资 | 435,996.18 | 0.03 |
| | 其中：债券 | 435,996.18 | 0.03 |
| | 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 | 90,279,972.32 | 5.42 |
| 8 | 其他资产 | 9,813,312.99 | 0.59 |

| | | | |
|---|----|------------------|--------|
| 9 | 合计 | 1,664,946,986.59 | 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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-------------------------------|------|-------------|-------------|------------------|--------------|
| 1 | 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 | 股票型 | 交易型开放式（ETF） | 易方达基金管理有限公司 | 1,564,417,705.10 | 94.29 |

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 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。

5.4 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

5.4.1 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投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.5 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 | - | - |
| | 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） | 435,996.18 | 0.03 |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|------------|------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 435,996.18 | 0.03 |

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 | 113050 | 南银转债 | 4,360 | 435,996.18 | 0.03 |

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。

5.8 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。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 2021 年 5 月 26 日，中国人民银行深圳市中心支行对招商证券股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款人民币 173 万元的行政处罚决定：1、未按规定履行客户身份识别义务；2、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告。

2020 年 11 月 10 日，北京市海淀区水务局针对中国人寿保险股份有限公司的未依法履行职责，对公司予以罚款人民币 2.1 万元的处罚。

2020 年 12 月 28 日，人民银行南京分行对南京银行股份有限公司罚款 736 万，没收违法所得 20.8 万，违法违规事项包括：未按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；未按规定报送账户开户资料；未按规定开立账户使用；未按规定加强特约商户与受理终端管理；违规占压财政资金。

本基金为目标 ETF 的联接基金，招商证券、中国人寿系标的指数成份股，其投资决策程序符合公司投资制度的规定。除招商证券、中国人寿外，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。本基金投资南银转债的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除南银转债外，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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 195,525.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,044.93 |
| 5 | 应收申购款 | 9,188,525.14 |
| 6 | 其他应收款 | 420,217.00 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,813,312.99 |

5.12.4 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。

5.12.5 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 | 易方达沪深300非银 联接A | 易方达沪深300非银 联接C |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,151,700,067.86 | 274,802,432.82 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 193,316,902.05 | 225,713,009.20 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 128,591,625.07 | 89,035,995.87 |
| 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 | 1,216,425,344.84 | 411,479,446.15 |

§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. 中国证监会注册易方达沪深 300 非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
2. 《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基金合同》；
3. 《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、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