

易方达黄金交易型开放式证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 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：二〇二一年十月二十七日

§ 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 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达黄金 ETF
场内简称	黄金 ETF
基金主代码	159934
交易代码	159934
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2013 年 11 月 29 日
报告期末基金份额总额	1,456,062,646.00 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金投资于黄金现货合约的比例不低于基金资产净值的 95%。为紧密追踪业绩比较基准的表现，本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。当黄金现货实盘合约

	流动性不足或黄金现货延期交收合约投资成本更低时，本基金也可适当投资于黄金现货延期交收合约。
业绩比较基准	上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价
风险收益特征	本基金追踪上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价表现，具有与上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约相似的风险收益特征。
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

§ 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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-5,586,899.42
2.本期利润	-56,633,399.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0413
4.期末基金资产净值	5,110,206,443.92
5.期末基金份额净值	3.5096

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	净值增	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

	长率①	长率标准差②	较基准收益率③	较基准收益率标准差④		
过去三个月	-1.17%	0.65%	-1.01%	0.65%	-0.16%	0.00%
过去六个月	1.17%	0.69%	1.50%	0.69%	-0.33%	0.00%
过去一年	-10.69%	0.78%	-10.13%	0.78%	-0.56%	0.00%
过去三年	34.47%	0.90%	37.14%	0.90%	-2.67%	0.00%
过去五年	23.81%	0.77%	27.09%	0.77%	-3.28%	0.00%
自基金合同生效起至今	42.98%	0.81%	48.05%	0.82%	-5.07%	-0.01%

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

易方达黄金交易型开放式证券投资基金
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
(2013 年 11 月 29 日至 2021 年 9 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 42.98%，同期业绩比较基准收益率为 48.05%。

§ 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 (范 冰)	本基金的基金经理、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、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 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、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、易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资	2017-03-25	-	16 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，巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、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、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。

	基金(QDII)的基金经理、 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 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、决策流程和交易流程，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 5 次，其中 3 次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，2 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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 2021 年三季度，美国新冠疫情新感染病例出现明显抬升，美国延续经

济重启的进程，但 GDP 增长预期有所放缓。在 9 月的 FOMC 议息会议上，美联储维持利率水平不变，但是传递了较为强烈的减量可能很快开始的信号，同时大幅上调了对于今年通胀的预测，并下调了对于经济增长的预测。鹰派的美联储信号叠加不断攀升的油价，推升了美国国债收益率和美元指数，压制了黄金价格的表现。

作为被动管理型基金，报告期内，本基金紧密跟踪上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格，取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。

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 3.5096 元，本报告期份额净值增长率为 -1.17%，同期业绩比较基准收益率为-1.01%，年化跟踪误差 0.05%，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	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	5,063,524,562.20	98.99
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	46,850,290.86	0.92
7	其他资产	4,959,163.58	0.10

8	合计	5,115,334,016.64	100.00
---	----	------------------	--------

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。

5.3 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

5.3.1 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。

5.4 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	Au99.99	Au99.99	13,979,230	5,062,438,352.20	99.07
2	Au99.95	Au99.95	3,000	1,086,210.00	0.02

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 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（元）
1	存出保证金	4,166,795.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	792,368.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,959,163.58

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

报告期期初基金份额总额	1,209,462,646.00
报告期期间基金总申购份额	603,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	356,400,000.00
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	1,456,062,646.00

§ 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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国工商银行股份有限公司一易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金	1	2021年07月01日~2021年09月30日	961,811,491.00	307,834,900.00	216,300,000.00	1,053,346,391.00	72.34%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如场外个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达黄金交易型开放式证券投资基金募集的文件；

2. 《易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金合同》;
3. 《易方达黄金交易型开放式证券投资基金托管协议》;
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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

二〇二一年十月二十七日