

# 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

## 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：招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。

基金托管人招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

### 2.1 基金产品概况

基金简称	易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)
基金主代码	006327
交易代码	006327
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 18 日
报告期末基金份额总额	7,678,929,194.80 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	本基金为易方达中证海外中国互联网 50 指数 ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证海外中国互联网 50 指数 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟

	跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，主要投资策略包括资产配置策略、目标 ETF 投资策略、成份股、备选成份股投资策略、债券投资策略、金融衍生品投资策略等。	
业绩比较基准	中证海外中国互联网 50 指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金是 ETF 联接基金，预期风险与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中证海外中国互联网 50 指数 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海外中国互联网 50 指数的表现密切相关。此外，本基金为境外股票指数基金，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
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	
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	易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII) A	易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII) C
下属分级基金的交易代码	006327	006328
报告期末下属分级基金的份额总额	6,513,027,785.18 份	1,165,901,409.62 份

注：易方达中证海外中国互联网50ETF联接（QDII）A含A类人民币份额（份额代码：006327）及A类美元现汇份额（份额代码：006329），交易代码仅列示A类人民币份额代码；易方达中证海外中国互联网50ETF联接（QDII）C含C类人

人民币份额（份额代码：006328）及C类美元现汇份额（份额代码：006330），交易代码仅列示C类人民币份额代码。

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	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
基金主代码	513050
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2017 年 1 月 4 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017 年 1 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	招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，即参考中证海外中国互联网 50 指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据中证海外中国互联网 50 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	中证海外中国互联网 50 指数
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。

## §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)	
	易方达中证海外中国 互联网 50ETF 联接 (QDII) A	易方达中证海外中国 互联网 50ETF 联接 (QDII) C
1.本期已实现收益	-19,281,507.03	-4,422,181.61
2.本期利润	-1,724,791,032.70	-311,705,199.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3540	-0.3642
4.期末基金资产净值	7,061,042,034.07	1,244,886,710.50
5.期末基金份额净值	1.0841	1.0677

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

##### 易方达中证海外中国互联网 50ETF 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	-27.05%	2.62%	-26.78%	2.78%	-0.27%	-0.16%
过去六个月	-30.89%	2.11%	-30.49%	2.24%	-0.40%	-0.13%
过去一年	-29.76%	2.14%	-28.93%	2.23%	-0.83%	-0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.41%	1.79%	24.29%	1.88%	-15.88%	-0.09%

## 易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII) C

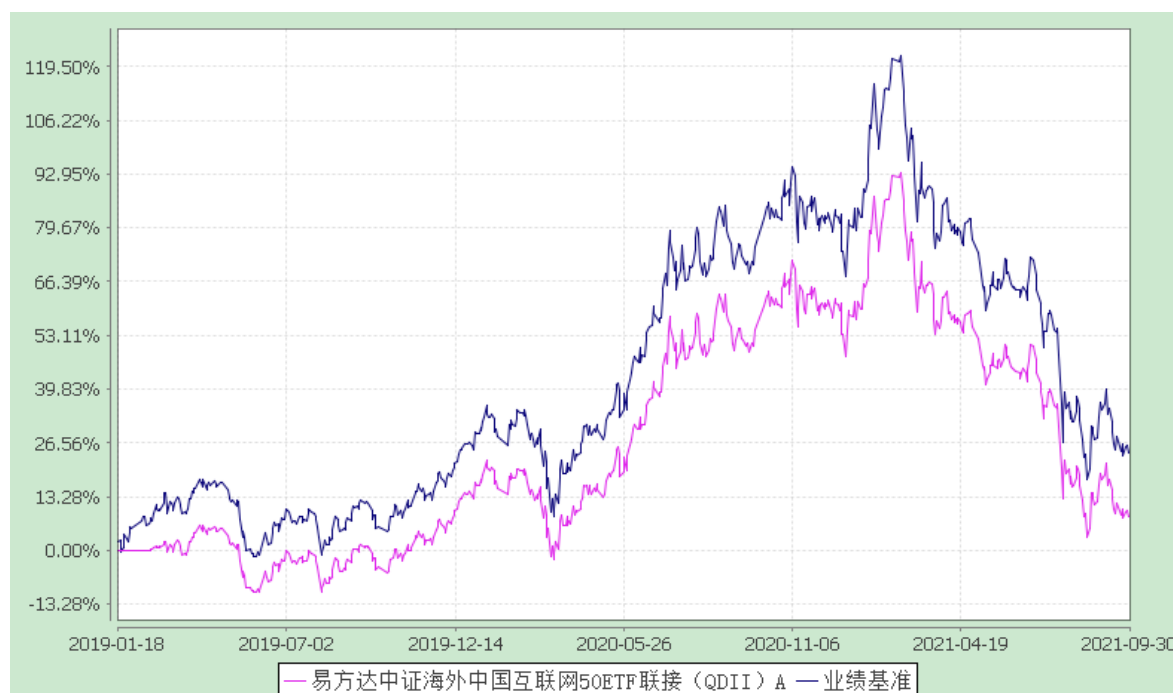
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-27.10%	2.61%	-26.78%	2.78%	-0.32%	-0.17%
过去六个月	-31.00%	2.11%	-30.49%	2.24%	-0.51%	-0.13%
过去一年	-30.03%	2.14%	-28.93%	2.23%	-1.10%	-0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.77%	1.79%	24.29%	1.88%	-17.52%	-0.09%

## 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

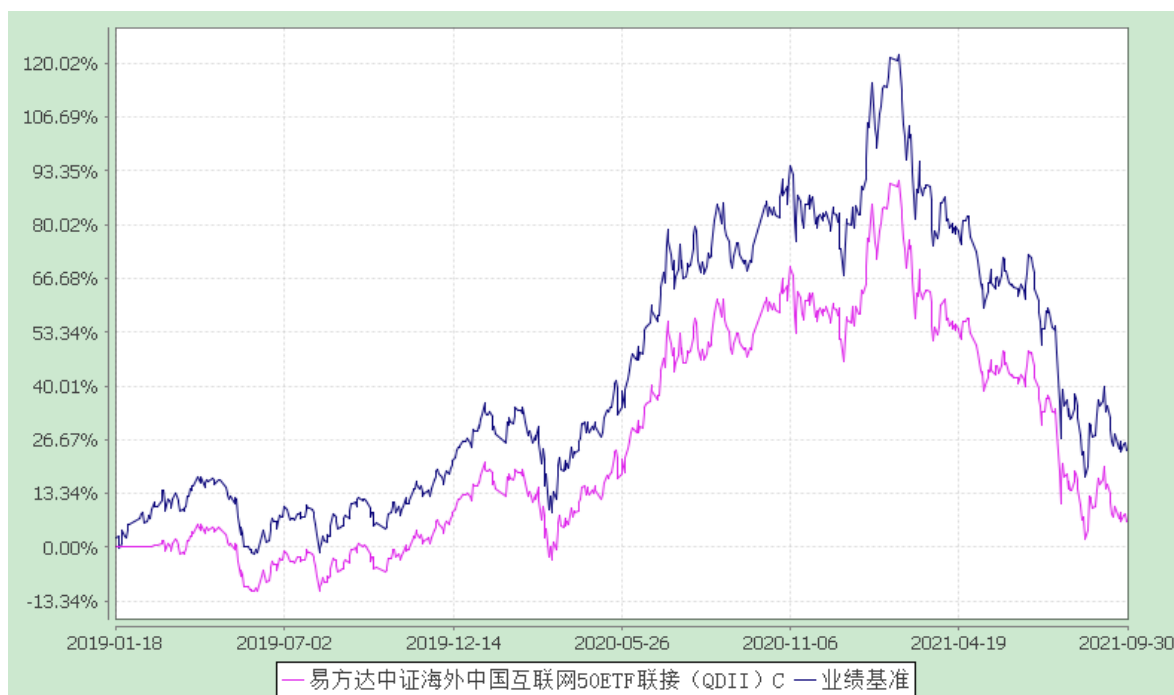
易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 1 月 18 日至 2021 年 9 月 30 日)

## 易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII) A



## 易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII) C



注：自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为8.41%，C类基金份额净值增长率为6.77%，同期业绩比较基准收益率为24.29%。

## §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		
FAN BING (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、易方达黄金交易型开放式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	2019-01-18	-	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

	<p>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 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基金(QDII)的基金经理、指数投资决策委员会委员</p>				<p>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。</p>
余海燕	<p>本基金的基金经理、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、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 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 交易型开放式指数发</p>	2019-01-18	-	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</p>



	<p>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 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、指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员</p>			<p>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、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券</p>
--	---	--	--	--

					投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------------

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 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遵规守信情况说明

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、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 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。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

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。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。国内方面，互联网行业监管政策的力度超过市场预期，改变了某些互联网赛道的投资逻辑，叠加美国证监会暂停中概股通过 VIE 架构赴美上市，海外中概股出现大跌，境内外投资者寻求更大的风险补偿，资金明显流出中概互联网板块。9 月以来，伴随监管层稳定市场的讲话和投资者恐慌情绪的释放，市场出现企稳迹象。

本基金是易方达中证海外互联 ETF 的联接基金，作为追踪中证海外中国互联网 50 指数的被动式海外指数基金，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。

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0841 元，本报告期份额净值增长率为-27.05%，同期业绩比较基准收益率为-26.78%；C 类基金份额净值为 1.0677 元，本报告期份额净值增长率为-27.10%，同期业绩比较基准收益率为-26.78%，年化跟踪误差 2.89%，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	7,561,051,683.07	90.29

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	502,457,052.48	6.00
8	其他资产	310,704,971.39	3.71
9	合计	8,374,213,706.94	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	易方达中证海外中国互联网 50 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	7,561,051,683.07	91.03

## 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权益投资明细

### 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

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	股指期货	HSTECH Futures Dec21	-	-
2	股指期货	HSTECH Futures Oct21	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，根据《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的公允价值变动金额为-1,883,475.15 元，已包含在结算备付金中。

#### 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	易方达中证海外 中国互联网 50	股票	交易型开放 式 (ETF)	易方达 基金管	7,561,051,683.07	91.03

	交易型开放式指 数证券投资基金	型		理有限 公司		
--	--------------------	---	--	-----------	--	--

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，阿里巴巴集团控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监管总局的处罚。美团在本报告期内曾被国家市场监管总局调查。腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监管总局的处罚。

本基金为目标 ETF 的联接基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，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	48,960,880.22
2	应收证券清算款	44,194,493.06
3	应收股利	-
4	应收利息	74,689.71
5	应收申购款	217,474,908.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	310,704,971.39

#### 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	易方达中证海外中国 互联网50ETF联接 (QDII) A	易方达中证海外中国 互联网50ETF联接 (QDII) C
报告期期初基金份额总额	3,230,344,952.88	536,340,223.69
报告期期间基金总申购份额	3,657,302,972.30	916,259,763.79
减：报告期期间基金总赎回份额	374,620,140.00	286,698,577.86
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	6,513,027,785.18	1,165,901,409.62

注：易方达中证海外中国互联网50ETF联接（QDII）A份额变动含A类人民币份额及A类美元份额；易方达中证海外中国互联网50ETF联接（QDII）C份额变动含C类人民币份额及C类美元份额。

## §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.中国证监会注册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募集的文件；

2.《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基金合同》；

3.《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

二〇二一年十月二十七日