

# 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

## 2022 年第 4 季度报告

### 2022 年 12 月 31 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：二〇二三年一月二十日

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 18 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 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品概况

基金简称	易方达上证中盘 ETF 联接
基金主代码	110021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 3 月 31 日
报告期末基金份额总额	107,900,313.21 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。力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金为上证中盘 ETF 的联接基金。上证中盘 ETF 是采用完全复制法实现对上证中盘指数紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于上证中盘 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日

	均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行上证中盘 ETF 的买卖。为更好地实现投资目标，本基金可投资存托凭证。待指数衍生金融产品推出以后，基金管理人在履行适当程序后，本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。	
业绩比较基准	上证中盘指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为上证中盘 ETF 的联接基金，其预期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上证中盘 ETF 追踪业绩比较基准，具有与业绩比较基准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	
下属分级基金的基金简称	易方达上证中盘 ETF 联接 A	易方达上证中盘 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	110021	004743
报告期末下属分级基金的份额总额	98,418,641.94 份	9,481,671.27 份

注：自2017年6月2日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2017年6月5日。

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金
------	-----------------------

基金主代码	510130
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2010 年 3 月 29 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010 年 6 月 23 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，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资，即按照上证中盘指数的成份股（含存托凭证）组成及权重构建股票投资组合。但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生，基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。本基金力争将年化跟踪误差控制在 2% 以内。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，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。本基金为指数型基金，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 (2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日)	
	易方达上证中盘 ETF	易方达上证中盘 ETF

	联接 A	联接 C
1.本期已实现收益	615,348.33	51,175.21
2.本期利润	3,888,451.48	274,381.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.0397	0.0354
4.期末基金资产净值	171,251,809.20	16,798,049.79
5.期末基金份额净值	1.7400	1.7716

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

##### 易方达上证中盘 ETF 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	2.32%	0.96%	2.27%	0.97%	0.05%	-0.01%
过去六个月	-8.62%	0.91%	-10.03%	0.93%	1.41%	-0.02%
过去一年	-14.76%	1.10%	-16.70%	1.11%	1.94%	-0.01%
过去三年	25.02%	1.15%	5.32%	1.17%	19.70%	-0.02%
过去五年	27.37%	1.16%	0.19%	1.19%	27.18%	-0.03%
自基金合同生效起至今	74.00%	1.36%	15.42%	1.40%	58.58%	-0.04%

##### 易方达上证中盘 ETF 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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

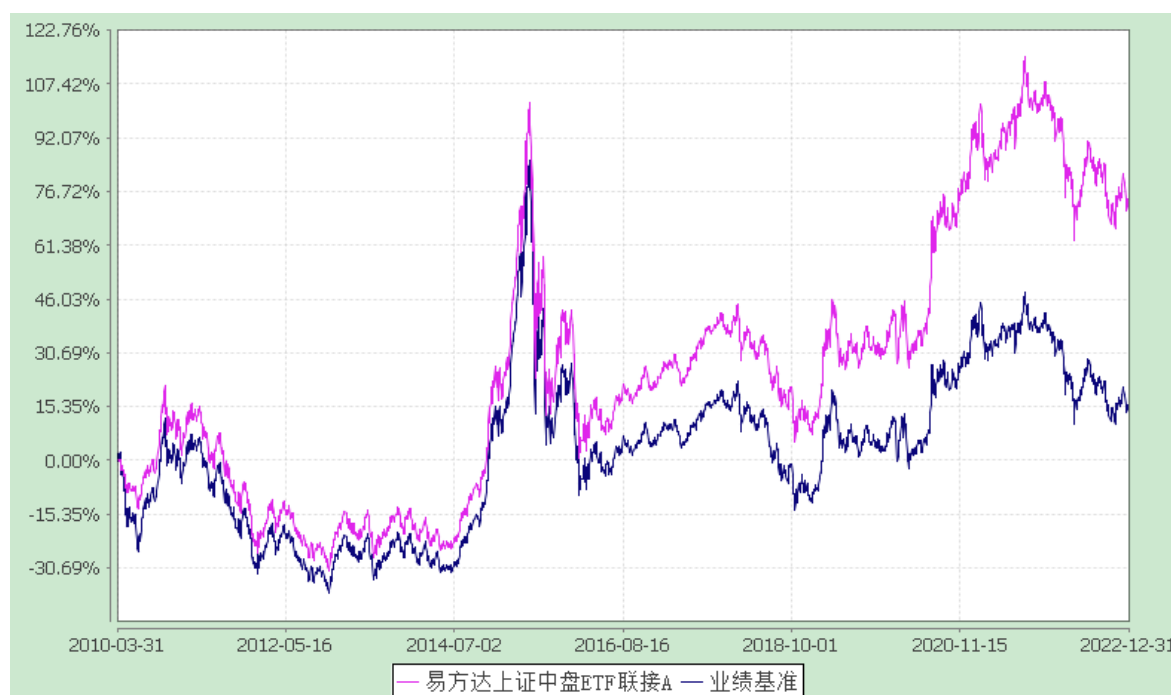
				④		
过去三个月	2.26%	0.96%	2.27%	0.97%	-0.01%	-0.01%
过去六个月	-8.74%	0.91%	-10.03%	0.93%	1.29%	-0.02%
过去一年	-14.98%	1.10%	-16.70%	1.11%	1.72%	-0.01%
过去三年	24.09%	1.15%	5.32%	1.17%	18.77%	-0.02%
过去五年	25.99%	1.16%	0.19%	1.19%	25.80%	-0.03%
自基金合同生效起至今	42.94%	1.11%	9.14%	1.14%	33.80%	-0.03%

### 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

易方达上证中盘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

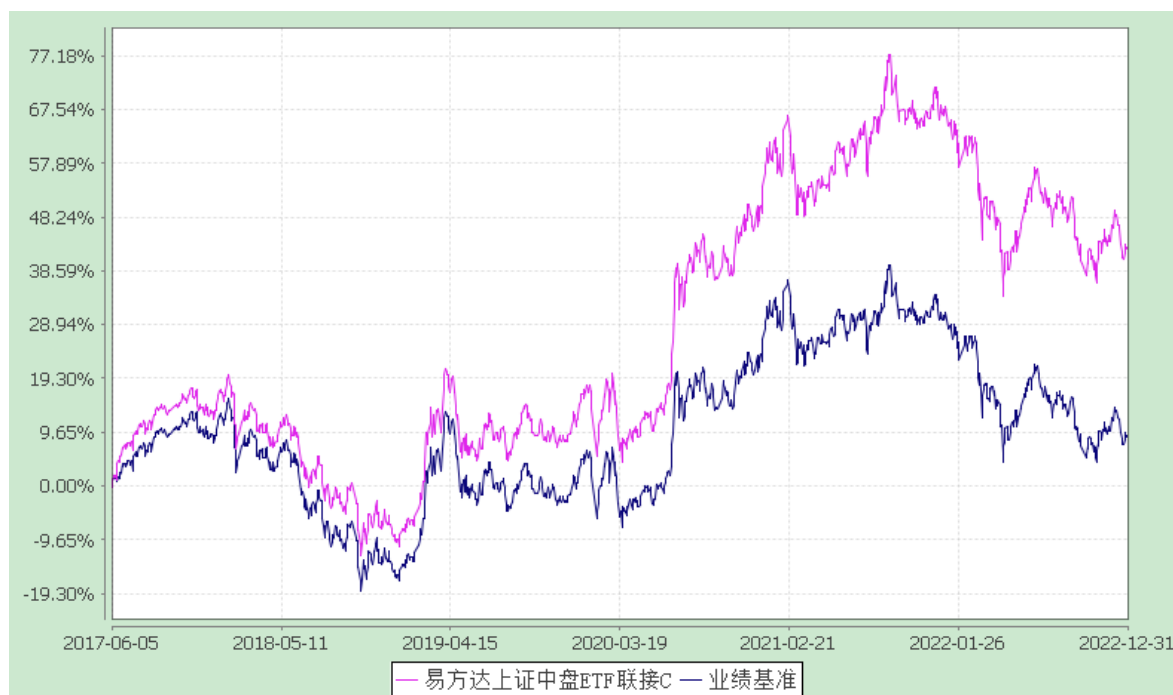
易方达上证中盘 ETF 联接 A:

(2010 年 3 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日)



易方达上证中盘 ETF 联接 C:

(2017 年 6 月 5 日至 2022 年 12 月 31 日)



注：1.自 2017 年 6 月 2 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2017 年 6 月 5 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 74.00%，同期业绩比较基准收益率为 15.42%；C 类基金份额净值增长率为 42.94%，同期业绩比较基准收益率为 9.14%。

## §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		
刘树荣	本基金的基金经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达中小企业 100 指数（LOF）、易方达中证万得并购重组指数（LOF）、易方达香	2018-08-11	-	15 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，易方达深证成指 ETF 联接、易方达深证成指

<p>港恒生综合小型股指数 (QDII-LOF)、易方达上证中盘 ETF、易方达中证 800ETF、易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达中证银行指数 (LOF)、易方达中证银行 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF、易方达中证 1000ETF 的基金经理, 易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理助理</p>				<p>ETF、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、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(QDII)的基金经理。</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行业协会相关规定。

#### 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、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 12 次，其中 9 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，3 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

本基金为易方达上证中盘 ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资于易方达上证中盘 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达上证中盘 ETF 跟踪上证中盘指数，该指数由上证 180 指数样本中非上证 50 指数样本的 130 家上市公司证券构成，以综合反映沪市中盘公司的整体状况。

2022 年四季度，我国经济经受住了超预期冲击因素的影响，展现出较强韧性和潜力，发展质量稳步提升，经济回稳向好趋势没有改变；随着疫情防控优化措施的持续落实，稳经济各项政策效应逐步释放，我国经济增速有望持续回升。在上述背景下，上证中盘指数 2022 年四季度上涨 2.37%。

上证中盘指数属于上交所单市场宽基指数，成份股市值风格介于代表大盘风格的上证 50 指数和代表中小市值风格的上证 380 指数之间，体现出中盘市值风格特征。上证中盘指数前三大权重行业为银行、非银金融、电力设备，指数的周期性行业权重占比较高，指数表现与经济周期密切相关。投资者在进行指数基金投资时应充分了解指数的特点，并选择与自身风险承受能力相匹配的产品。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，依据基金申赎变动等情况进行日常组合管理，力求跟踪误差最小化。

#### 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 1.7400 元，本报告期份额净值增长率为 2.32%，同期业绩比较基准收益率为 2.27%；C 类基金份额净值为 1.7716 元，本报告期份额净值增长率为 2.26%，同期业绩比较基准收益率为 2.27%，年化跟踪误差 0.33%，在合同规定的控制范围内。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §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	2,060,651.00	1.09
	其中：股票	2,060,651.00	1.09
2	基金投资	175,793,471.40	93.23
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	10,614,467.65	5.63
8	其他资产	85,912.67	0.05
9	合计	188,554,502.72	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	易方达上证中盘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	175,793,471.40	93.48
---	-----------------------	-----	--------------	-------------	----------------	-------

### 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

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,504.00	0.00
B	采矿业	70,709.00	0.04
C	制造业	928,367.00	0.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,309.00	0.04
E	建筑业	99,898.00	0.05
F	批发和零售业	8,915.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	53,699.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	155,905.00	0.08
J	金融业	613,658.00	0.33
K	房地产业	24,568.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,119.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,060,651.00	1.10

### 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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	601328	交通银行	13,500	63,990.00	0.03
2	600919	江苏银行	5,800	42,282.00	0.02
3	600000	浦发银行	5,800	42,224.00	0.02
4	600050	中国联通	9,400	42,112.00	0.02
5	600016	民生银行	12,200	42,090.00	0.02
6	688981	中芯国际	1,000	41,140.00	0.02
7	600837	海通证券	4,700	40,843.00	0.02
8	600089	特变电工	1,900	38,152.00	0.02
9	601988	中国银行	10,400	32,864.00	0.02
10	601728	中国电信	7,600	31,844.00	0.02

#### 5.5 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。

#### 5.6 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

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 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、上海市市场监督管理局、中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。中国电信股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到浙江省杭州市西湖区综合行政执法局、浙江省杭州市拱墅区人民政府武林街道办事处、浙江省舟山市市场监督管理局新城分局的处罚。中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会北京监管局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

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，基金管理人未发现本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体出现本期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中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、上海市市场监督管理局、中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。中国电信股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到浙江省杭州市西湖区综合行政执法局、浙江省杭州市拱墅区人民政府武林街道办事处、浙江省舟山市市场监督管理局新城分局的处罚。中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会北京监管局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对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，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,961.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	82,951.42
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	85,912.67

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达上证中盘ETF 联接A	易方达上证中盘ETF 联接C
报告期期初基金份额总额	96,168,658.56	6,358,597.57
报告期期间基金总申购份额	4,701,574.16	5,742,779.30
减：报告期期间基金总赎回份额	2,451,590.78	2,619,705.60
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	98,418,641.94	9,481,671.27

## §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.中国证监会核准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募集的文件；
- 2.《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基金合同》；
- 3.《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

二〇二三年一月二十日