

# 易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金

## 2022年第四季度报告

### 2022年12月31日

基金管理人:易米基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2023年01月14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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年1月13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

基金简称	易米国证消费100指数增强发起
基金主代码	013926
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年11月11日
报告期末基金份额总额	17,031,173.33份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对国证消费100指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不得超过8%。
投资策略	本基金主要投资策略为以国证消费100指数为标的指数，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，结合定性和定量的选股方式对投资组合进行积极的管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	国证消费100指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金属于指数增强型基金，跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	易米基金管理有限公司

基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易米国证消费100指数增强发起A	易米国证消费100指数增强发起C
下属分级基金的交易代码	013926	013927
报告期末下属分级基金的份额总额	16,244,492.78份	786,680.55份

### § 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01日 - 2022年12月31日)	
	易米国证消费100指数增强发起A	易米国证消费100指数增强发起C
1. 本期已实现收益	-358,914.59	-16,065.96
2. 本期利润	58,617.70	4,072.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0038	0.0059
4. 期末基金资产净值	13,853,946.53	667,881.51
5. 期末基金份额净值	0.8528	0.8490

注：1. 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；  
2. 本报告所列示的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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

易米国证消费100指数增强发起A净值表现

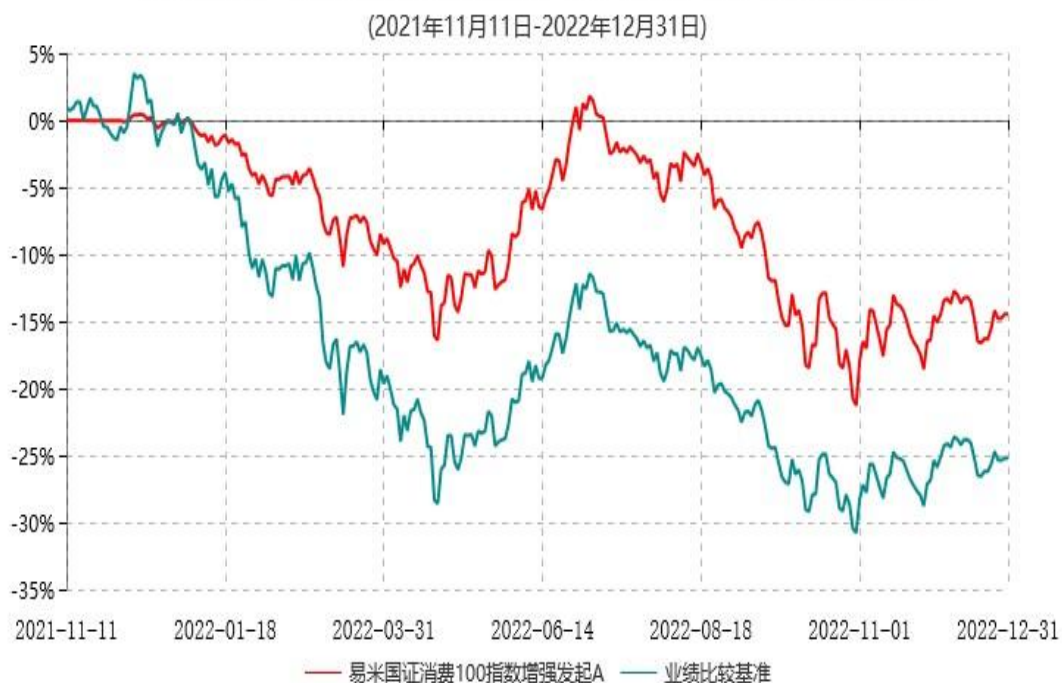
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.38%	1.30%	2.37%	1.36%	-1.99%	-0.06%
过去六个月	-15.22%	1.12%	-14.72%	1.18%	-0.50%	-0.06%
过去一年	-14.80%	1.09%	-25.34%	1.43%	10.54%	-0.34%
自基金合同生效起至今	-14.72%	1.02%	-25.19%	1.37%	10.47%	-0.35%

易米国证消费100指数增强发起C净值表现

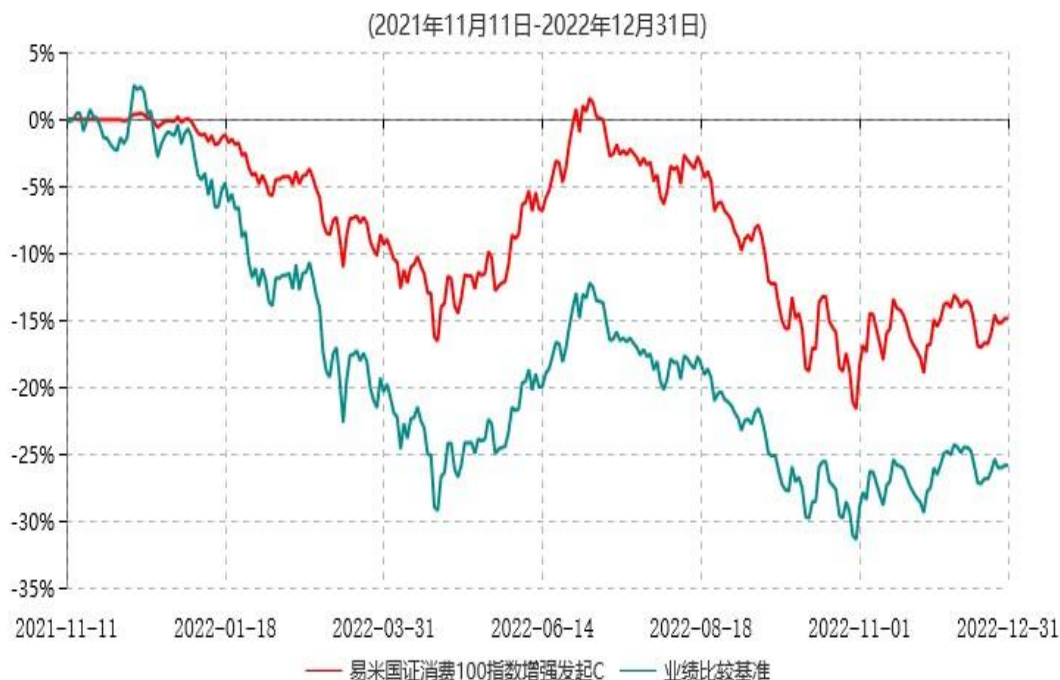
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.28%	1.30%	2.37%	1.36%	-2.09%	-0.06%
过去六个月	-15.39%	1.12%	-14.72%	1.18%	-0.67%	-0.06%
过去一年	-15.13%	1.09%	-25.34%	1.43%	10.21%	-0.34%
自基金合同生效起至今	-15.10%	1.02%	-25.19%	1.37%	10.09%	-0.35%

### 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

易米国证消费100指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



易米国证消费100指数增强发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



## § 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		
王磊	本基金基金经理	2021-11-11	-	15	王磊先生，南京大学硕士。曾任华泰证券股份有限公司投资银行部项目经理，国金证券股份有限公司行业研究员，太平洋资产管理有限责任公司高级研究员、权益投资副总裁，凯石基金管理有限公司研究副总监、基金经理，现任易米基金管理有限公司研究部总监、基金经理。
俞科进	本基金基金经理	2022-05-24	-	15	俞科进先生，南开大学硕士。曾任中国人保寿险股份有限公司员工，长江证

					券股份有限公司研究所金工分析师，中邮创业基金管理股份有限公司历任金融工程研究员、量化投资部副总经理、基金经理，上海集元资产管理有限公司合规风控负责人，现任易米基金管理有限公司多策略投资部总监、基金经理兼投资经理。
--	--	--	--	--	--

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3. 本基金无基金经理助理。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
俞科进	公募基金	1	14,521,828.04	2022-05-24
	私募资产管理计划	4	133,050,860.87	2022-11-02
	其他组合	-	-	-
	合计	5	147,572,688.91	-

注：“任职时间”为兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理在本公司首次开始管理本类产品的时间。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定，无违法、违规行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《易米基金管理有限公司公平交易制度》和《易米基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。本基金管理人通过建立科学的公平交易体系，将公平交易理念贯彻投

资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评价等环节，确保各个投资组合享有公平的投资决策机会。本报告期内公司旗下基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

报告期内，本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人旗下管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情形。

报告期内，本基金管理人未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内，美联储加息预期在维持前期力度和放缓节奏之间反复来回，即使不考虑加息影响，当前利率还在高位盘桓，从而继续压制成长性行业前景。此外，虽然俄乌战争进入僵持阶段对大宗商品的影响减弱，欧洲主要经济体受大宗商品价格持续上涨制约暂告一段落，但全球通胀仍处于高位，无法扭转全球经济发展前景的不乐观预期。因此，市场整体风险偏好有所提升但不稳定，且地区之间不均衡。报告期内，国内疫情防控政策及地产调控政策的调整一定程度上提振了市场信心，消费回暖预期有所增强。国证消费100指数成份股几大板块中，酒店旅游及出行预期改善最为直接，食品饮料板块中以白酒为代表的其他行业基本面预期触底之后也有了较大幅度的反转；信创板块在国家安全战略层面的重要性得到确认，计算机通信等相关行业表现突出，半导体行业虽然受美国相关政策影响但国产替代趋势已然确立，相关标的也受到市场认可；新能源车渗透率进入瓶颈期，销量虽然维持高位，但蓝海竞争不可避免，行业整体利润率大概率下行，板块整体震荡下行；光伏板块由于欧洲装机增速回落但需求量绝对量仍在高位，上游原材料价格维持高位使得国内组装落地有所延迟，光伏板块整体回落。综上所述，国证消费100指数本季度上涨2.46%。

本基金以国证消费100指数为目标指数，综合运用各种指数增强方法从广度和深度两个方面同时提高组合收益风险比，力争获取超额回报。本报告期内，本基金保持股票资产占比接近业绩比较基准中的上限，股票组合中维持了前期风格分布。在小市值风格延续前期占优的市场环境中，虽然有部分标的市值较小，但因为对业绩持续性的要求较为严格，与市场上对小市值个股业绩预期高频变化的追捧不相吻合，反映出量化策略阶段性的失效难以回避，组合整体相对表现不足。

投资策略方面，本基金作为指数增强型基金，将在持续对目标指数进行有效跟踪的基础上，通过综合运用各种指数增强方法，力争在控制跟踪误差的同时为投资者提供高于业绩比较基准的投资收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末易米国证消费100指数增强发起A基金份额净值为0.8528元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.38%，同期业绩比较基准收益率为2.37%；截至报告期末易米国证消费100指数增强发起C基金份额净值为0.8490元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.28%，同期业绩比较基准收益率为2.37%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无应说明的预警信息。

### §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	13,462,555.58	92.13
	其中：股票	13,462,555.58	92.13
2	基金投资	-	-
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	192,376.39	1.32
8	其他资产	957,118.65	6.55
9	合计	14,612,050.62	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	479,180.00	3.30
B	采矿业	22,802.00	0.16
C	制造业	9,976,661.05	68.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	57,980.00	0.40
F	批发和零售业	133,207.00	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	420,384.00	2.89



H	住宿和餐饮业	58,350.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	809,378.58	5.57
J	金融业	216,250.00	1.49
K	房地产业	110,540.00	0.76
L	租赁和商务服务业	117,568.00	0.81
M	科学研究和技术服务业	671,736.00	4.63
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	374,064.95	2.58
R	文化、体育和娱乐业	14,454.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	13,462,555.58	92.71

### 5.3 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	000568	泸州老窖	3,100	695,268.00	4.79
2	000333	美的集团	10,500	543,900.00	3.75
3	002594	比亚迪	2,000	513,940.00	3.54
4	601012	隆基绿能	11,420	482,609.20	3.32
5	603259	药明康德	5,400	437,400.00	3.01
6	600887	伊利股份	12,500	387,500.00	2.67
7	600276	恒瑞医药	10,000	385,300.00	2.65
8	002475	立讯精密	12,000	381,000.00	2.62
9	300760	迈瑞医疗	1,200	379,164.00	2.61
10	000858	五粮液	2,000	361,380.00	2.49

### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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持有股指期货。

## 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持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	891,781.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	65,337.48
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	957,118.65

### 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流通受限的股票。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

	易米国证消费100指数 增强发起A	易米国证消费100指数 增强发起C
报告期期初基金份额总额	14,110,992.27	524,800.79
报告期期间基金总申购份额	2,353,058.37	421,026.11
减：报告期期间基金总赎回份额	219,557.86	159,146.35
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	16,244,492.78	786,680.55

### § 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，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 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投资本基金。

### § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人 固有资金	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人 高级管理人员	10,080,504.80	59.19%	10,080,504.80	59.19%	自合同生 效之日起 不少于三 年
基金经理等 人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人 股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,102,361.42	59.32%	10,080,504.80	59.19%	-

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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
个人	1	20221001-20221231	5,080,304.80	0.00	0.00	5,080,304.80	29.83%
	2	20221001-20221231	5,000,200.00	0.00	0.00	5,000,200.00	29.36%
产品特有风险							
<p>1. 净值大幅波动的风险</p> <p>由于本基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该投资者大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。</p> <p>2. 出现巨额赎回的风险</p> <p>该投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。其他投资者的赎回申请也可能同时面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。</p> <p>3. 基金规模过小的风险</p> <p>根据基金合同的约定，基金合同生效满3年后继续存续的，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案。该投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5,000万元情形。</p>							

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件；
2. 《易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

### 10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人及基金托管人的办公场所。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

易米基金管理有限公司

2023年01月14日