

易米中证科创创业50指数增强型发起式证券投资基金

2024年第三季度报告

2024年09月30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:2024年10月25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2024年10月24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2024年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易米中证科创创业50指数增强发起
基金主代码	016392
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年01月04日
报告期末基金份额总额	46,955,453.39份
投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在力求对中证科创创业50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%，年化跟踪误差不超过8%。
投资策略	本基金主要投资策略以中证科创创业50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	中证科创创业50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、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	易米中证科创创业50 指数增强发起A	易米中证科创创业50 指数增强发起C
下属分级基金的交易代码	016392	016393
报告期末下属分级基金的份额总额	42,303,340.88份	4,652,112.51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(2024年07月01日 - 2024年09月30日)	
	易米中证科创创业50 指数增强发起A	易米中证科创创业50 指数增强发起C
1.本期已实现收益	-2,631,574.24	-278,486.11
2.本期利润	6,934,681.21	777,134.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.1505	0.1672
4.期末基金资产净值	38,428,416.03	4,196,765.37
5.期末基金份额净值	0.9084	0.9021

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

易米中证科创创业50指数增强发起A净值表现

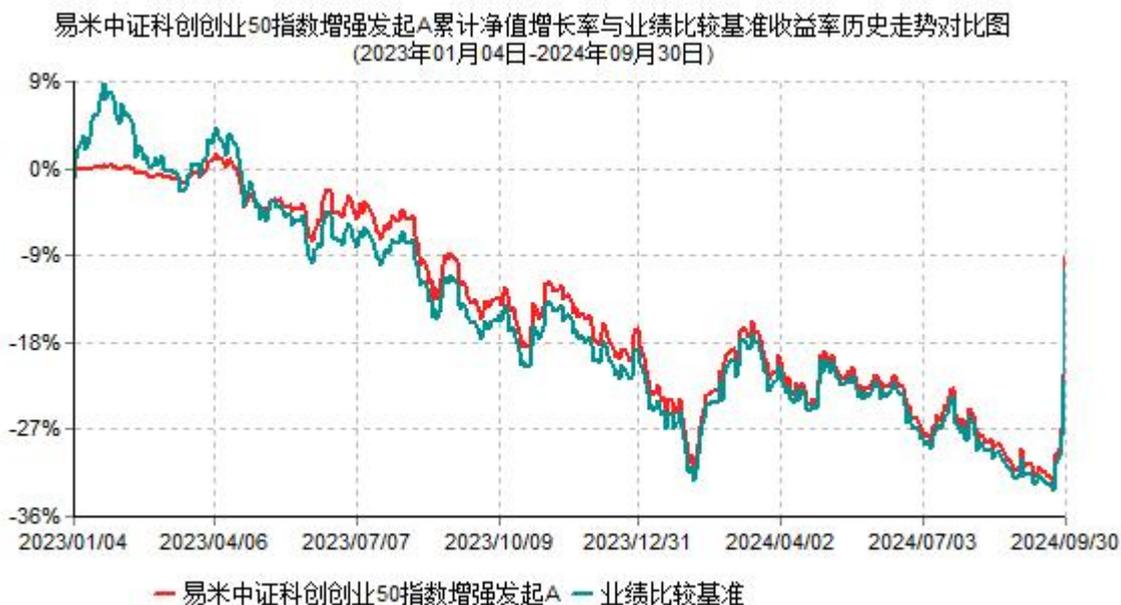
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

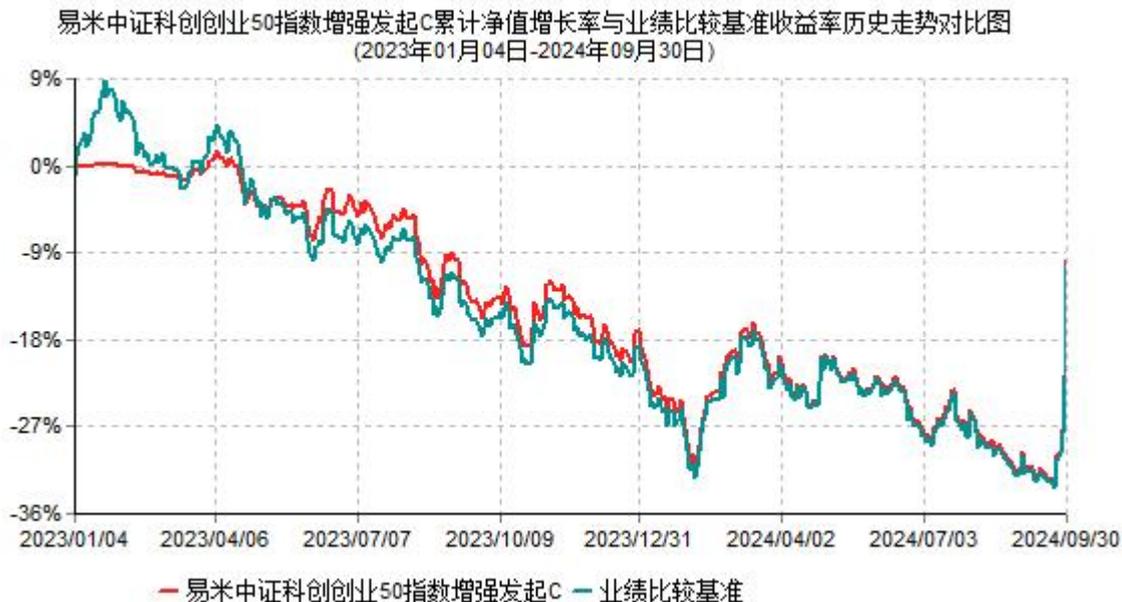
过去三个月	22.72%	2.51%	22.57%	2.51%	0.15%	0.00%
过去六个月	15.00%	2.01%	15.03%	2.01%	-0.03%	0.00%
过去一年	5.07%	1.74%	6.36%	1.75%	-1.29%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-9.16%	1.41%	-10.32%	1.48%	1.16%	-0.07%

易米中证科创创业50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	22.58%	2.51%	22.57%	2.51%	0.01%	0.00%
过去六个月	14.77%	2.01%	15.03%	2.01%	-0.26%	0.00%
过去一年	4.64%	1.74%	6.36%	1.75%	-1.72%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-9.79%	1.41%	-10.32%	1.48%	0.53%	-0.07%

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





§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	2023-01-04	-	16	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。
贺文奇	本基金基金经理	2023-01-04	-	16	贺文奇女士，华东师范大学硕士。曾任国泰基金管理有限公司产品经理助理、渠道销售，磐厚蔚然（上海）资

					产管理有限公司投资经理、资本市场部总监,现任易米基金管理有限公司基金经理、量化投资部总监。
--	--	--	--	--	---

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.本基金本报告期内没有基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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、《易米中证科创创业50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。

报告期内,本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(1日内、3日内、5日内)的本季度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

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

2024年三季度，A股经历了大反转。前期市场持续下跌，红利、价值风格表现抗跌，9月末市场大涨，引爆点就是国新办的发布会以及提前举行的定调会议。降息降准、降低存量房贷利率、创设新的金融工具支持上市公司回购、鼓励长期资金入市、托底房地产市场、改善民营企业经营环境、支持消费、鼓励就业等等，大超预期，并且后续政策落地也非常快，一周内降准、降低存量房贷利率、一线城市地产政策纷纷落地，将A股情绪助推到极致，科创创业板指数整体表现突出。

本基金对标指数--中证科创创业50，作为大中盘成长风格的代表指数，三季度涨幅23.77%，主要涨幅都在9月最后一周。本基金表现略逊于指数，季度涨幅超22%，跑输约0.9%。主要原因就是指数短期大幅上涨，因为仓位受限拖累基金超额表现。而此前，自今年5月以来本基金持续跑赢指数，并且股票组合也持续稳定地跑赢指数，季度超额约0.5%。具体细分链条上，光伏择股超配、电池超配、芯片择股超配、人工智能低配贡献了超额，医疗设备低配拖累组合超额表现。组合配置上，科技制造、新能源、医药三大板块标配，细分投资链条适度偏离，主要是超配了芯片、光伏、电池，低配人工智能、医疗设备。

我们的投资目标是在年度周期内实现稳定的超额收益。指数增强策略分成两部分，组合构建以及仓位调整。组合构建，是在指数成份基础上，依据个股情绪模型开发出K策略和R策略，K策略针对成份股，根据信号进行交易，R策略针对非成份股，在有限仓位内获取超额收益。仓位调整，主要基于对市场的宏观判断以及市场情绪模型，仅在市场过热时调低仓位，平时高仓位运行。三季度，根据上述策略，组合持续稳定超额，即使是在大涨的9月，组合单月仍有0.2%以上的超额。

9月末大涨之后，短期情绪已经过热，不过中长期仍在正常区间。接下来A股情绪边际变化，主要影响因素有三个：一是国内政策的落地数量和频率，如果重磅政策持续不断发布，A股的上行趋势就还能持续，但边际影响会减弱，若政策不及预期或符合预期，A股大概率会震荡调整；二是10月季报披露期，如果大部分公司符合预期或超预期，又会给上行行情再加一把燃料；三是美国大选和美联储降息节奏，大选结果和降息的幅度都会对市场情绪造成干扰。对未来，我们认为短期或有调整，但中长期可期。

四季度，我们仍坚持谨慎乐观的操作思路，组合构建上，在缩小指数偏离的基础上，放大模型阈值，增加交易操作，力争获得相对稳定的指数超额。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末易米中证科创创业50指数增强发起A基金份额净值为0.9084元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为22.72%，同期业绩比较基准收益率为22.57%；截至报告期末易米中证科创创业50指数增强发起C基金份额净值为0.9021元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为22.58%，同期业绩比较基准收益率为22.57%。

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	40,704,048.38	94.82
	其中：股票	40,704,048.38	94.82
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	2,221,941.27	5.18
8	其他资产	3,549.52	0.01
9	合计	42,929,539.17	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	36,222,717.31	84.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	3,389,996.07	7.95

	务业		
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,091,335.00	2.56
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	40,704,048.38	95.49

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	300750	宁德时代	16,020	4,035,277.80	9.47
2	300760	迈瑞医疗	10,500	3,076,500.00	7.22
3	300274	阳光电源	25,340	2,523,357.20	5.92
4	300308	中际旭创	15,640	2,422,010.40	5.68
5	300124	汇川技术	33,200	2,073,340.00	4.86
6	688981	中芯国际	34,484	2,068,695.16	4.85
7	688041	海光信息	16,100	1,662,808.00	3.90
8	300502	新易盛	12,200	1,585,634.00	3.72
9	688012	中微公司	7,570	1,241,480.00	2.91
10	688111	金山办公	4,028	1,073,059.20	2.52

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,549.52
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,549.52

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

	易米中证科创创业50 指数增强发起A	易米中证科创创业50 指数增强发起C
报告期期初基金份额总额	48,618,807.14	4,648,960.48
报告期期间基金总申购份额	111,997.61	163,636.25
减：报告期期间基金总赎回份额	6,427,463.87	160,484.22
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	42,303,340.88	4,652,112.51

§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**

单位：份

	易米中证科创创业50 指数增强发起A	易米中证科创创业50 指数增强发起C
报告期期初管理人持有的本基金份额	7,500,406.25	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	7,500,406.25	-
报告期期末持有的本基金份额占基金 总份额比例（%）	17.73	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

§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	7,500,406.25	15.97%	7,500,406.25	15.97%	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人高级管理人员	395,436.92	0.84%	395,436.92	0.84%	自合同生效之日起不少于三年
基金经理等人员	197,733.46	0.42%	197,733.46	0.42%	自合同生效之日起不少于三年
基金管理人股东	2,264,323.24	4.82%	2,264,323.24	4.82%	自合同生效之日起不少于三年
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,357,899.87	22.06%	10,357,899.87	22.06%	-

§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

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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中证科创创业50指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件；
2. 《易米中证科创创业50指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；

- 3.《易米中证科创创业50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
2024年10月25日