

# 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)

## 2023 年第 3 季度报告

2023 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：二〇二三年十月二十五日

## §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 10 月 23 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	易方达日兴资管日经 225ETF (QDII)
场内简称	225ETF、日经 225ETF 易方达
基金主代码	513000
交易代码	513000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 日
报告期末基金份额总额	293,911,379.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 3% 以内，主要投资策略包括标的 ETF 投资策略、股票投资策

	略、债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略等。
业绩比较基准	日经 225 指数收益率(使用估值汇率折算)
风险收益特征	本基金主要通过投资于标的 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪, 因此, 本基金的业绩表现与日经 225 指数的表现密切相关, 预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。此外, 本基金主要投资于日本等境外市场, 除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外, 还面临汇率风险以及日本等境外市场的风险。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工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 Northern Trust Company
	中文名称: 美国北美信托银行

### §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
	(2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	4,133,332.77
2.本期利润	-23,671,392.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0878
4.期末基金资产净值	348,833,580.30
5.期末基金份额净值	1.1869

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

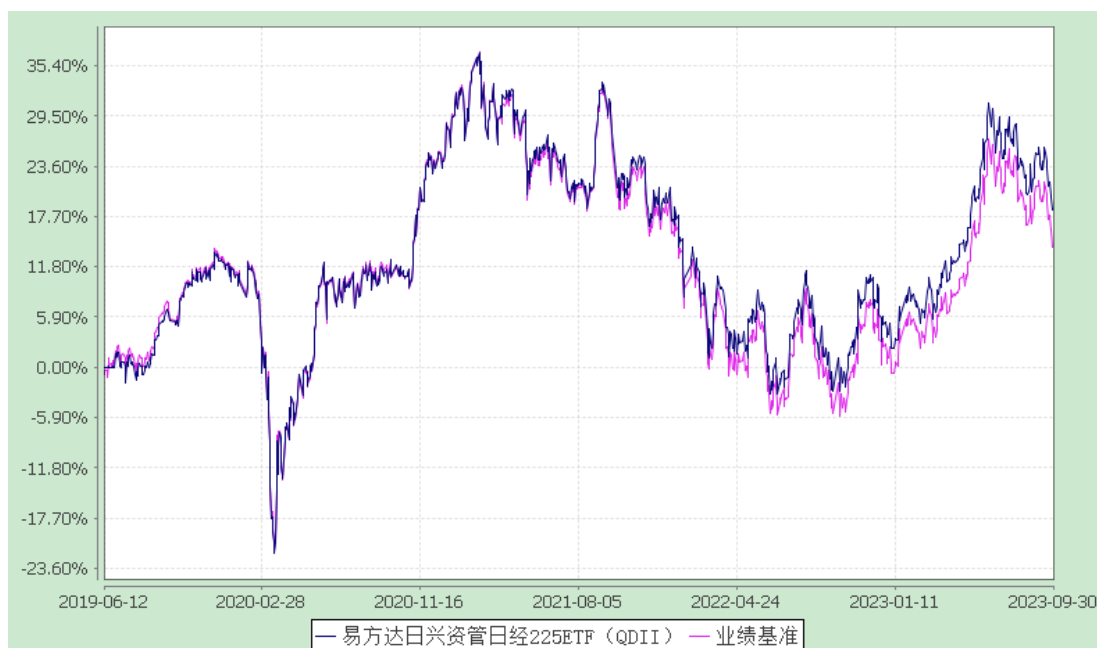
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.73%	0.94%	-7.26%	0.98%	0.53%	-0.04%
过去六个月	6.83%	1.00%	6.37%	1.03%	0.46%	-0.03%
过去一年	22.02%	1.11%	20.64%	1.14%	1.38%	-0.03%
过去三年	7.28%	1.18%	3.22%	1.20%	4.06%	-0.02%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	18.69%	1.24%	14.06%	1.26%	4.63%	-0.02%

#### 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

易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)

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 6 月 12 日至 2023 年 9 月 30 日)



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 18.69%，同期业绩比较基准收益率为 14.06%。

## §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 ETF 联接（自 2017 年 03 月 25 日至 2023 年 08 月 18 日）、易方达黄金 ETF（自 2017 年 03 月 25 日至 2023 年 08 月 18 日）、易方达标普 500 指数（QDII-LOF）（自 2017 年 03 月 25 日至 2023 年 09 月 22 日）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）（自 2017 年 03 月 25 日至 2023 年 09 月 22 日）、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）、易方达纳斯达克 100 指数	2019-06-12	2023-09-23	18 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>(QDII-LOF) (自 2017 年 06 月 27 日至 2023 年 09 月 22 日)、易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF (自 2018 年 05 月 17 日至 2023 年 08 月 18 日)、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接发起式 (自 2019 年 03 月 13 日至 2023 年 08 月 18 日)、易方达中证香港证券投资主题 ETF (自 2020 年 03 月 13 日至 2023 年 09 月 22 日)、易方达中证龙头企业指数、易方达恒生港股通新经济 ETF (自 2022 年 03 月 03 日至 2023 年 09 月 22 日)、易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理, 指数投资决策委员会委员, 易方达资产管理 (香港) 有限公司首席投资官 (国际指数)、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消费品指数增强 (QDII)、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)、易方达原油 (QDII-LOF-FOF)、易方达恒生科技 ETF (QDII) 的基金经理, 易方达资产管理 (香港) 有限公司基金经理、国际指数部部门总监。</p>
余海	本基金的基金经理, 易方达沪	2019-06-1	-	18 年	硕士研究

燕	<p>深 300 医药 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF、易方达沪深 300 非银联接、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达沪深 300ETF 发起式、易方达中证 500ETF、易方达中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF)、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企联接 (QDII)、易方达恒生国企 (QDII-ETF)、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接 (QDII)、易方达中证 500ETF 联接发起式、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接发起式、易方达中证军工指数 (LOF)、易方达中证全指证券公司指数 (LOF)、易方达中证军工 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理，指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员</p>	2		<p>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 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF 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 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合规守信情况说明

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 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。

### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本基金跟踪日经 225 指数，该指数由日本经济新闻社编制，是反映日本股市表现的代表性指数之一。日经 225 指数选取东京交易所主板成交量最活跃、流通市值最高的 225 只股票，根据调整后价格赋予指数权重，并每年度定期调整。报告期内本基金主要通过投资日兴资管日经 225ETF（Listed Index Fund 225）来实现对基准指数的跟踪，力求基金净值增长率与业绩比较基准增长率相当。

2023 年三季度，全球金融条件方面，美联储在 2023 年 7 月的议息会议上加



息 25 个基点至 5.25%-5.50% 的利率区间，并在 2023 年 9 月的议息会议上暂停加息，幅度符合市场预期。在日本 2023 年 7 月的货币政策会议上，日本央行意外放宽了收益率曲线控制政策，在不改变长期利率上限为 0.5% 的同时，允许长期利率升至 1%。指数表现方面，伴随日本央行逐渐收紧的货币政策，通胀水平的上涨一定程度上抑制了日本国内的消费增长，叠加日本制造业正处于收缩阶段，对市场风险偏好有所压制。本报告期内，日经 225 指数震荡回调。

本报告期内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，坚持既定的投资策略，紧密跟踪业绩比较基准，力求跟踪误差最小化。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.1869 元，本报告期份额净值增长率为 -6.73%，同期业绩比较基准收益率为 -7.26%，年化跟踪误差 2.01%，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(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	322,727,489.39	91.18
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	29,271,888.92	8.27
8	其他资产	1,930,348.32	0.55
9	合计	353,929,726.63	100.00

## 5.2 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。

## 5.3 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。

## 5.4 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

### 5.4.1 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。

## 5.5 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。

## 5.6 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名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	NIKKEI 225 (OSE) Dec23	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则，根据《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-1,322,008.13 元，已包含在结算备付金中。

### 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	Listed Index Fund 225	ETF	开放式	Nikko Asset Management Co Ltd	322,727,489.39	92.52

### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

#### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	1,338,107.90
2	应收证券清算款	592,240.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,930,348.32

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 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	234,911,379.00
报告期期间基金总申购份额	68,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	9,000,000.00
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	293,911,379.00

### §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 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
机构	1	2023年07月06日~2023年09月	36,839,600.00	149,797,600.0	104,213,600.00	82,423,600.00	28.04%

		17 日,2023 年 09 月 19 日~2023 年 09 月 30 日		0			
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;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,基金管理人经与基金托管人协商一致后有权直接终止本基金合同,基金将面临基金财产清算并终止的风险;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.中国证监会注册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) 募集的文件;
- 2.《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) 基金合同》;
- 3.《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) 托管协议》;
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 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  
二〇二三年十月二十五日