

# 易方达中证浙江新动能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 14 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。

基金托管人中国工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。

易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）已连续超过 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，触发《易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定的终止情形，为维护基金份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定和《基金合同》的相关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，决定依法对本基金财产进行清算并终止《基金合同》，该事项无须召开基金份额持有人大会进行表决。本基金最后运作日为 2021 年 9 月 14 日，自 2021 年 9 月 15 日起进入清算程序。基金财产清算结果将在报中国证监会备案后公告，并将遵照法律法规、《基金合同》等规定及时进行分配，敬请投资者留意。

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 14 日（基金最后运作日）止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 基金产品概况

基金简称	易方达中证浙江新动能 ETF 联接（QDII）
基金主代码	007813

交易代码	007813
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 24 日
报告期末基金份额总额	1,032,659.15 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达中证浙江新动能 ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证浙江新动能 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将年化跟踪误差控制在 4% 以内，主要投资策略包括资产配置策略、目标 ETF 投资策略、股票及存托凭证投资策略、债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资融券业务策略等。
业绩比较基准	中证浙江新动能指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于易方达中证浙江新动能 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浙江新动能指数的表现密切相关。此外，本基金可投资境外市场，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 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	易方达中证浙江新动能 ETF 联接（QDII）A	易方达中证浙江新动能 ETF 联接（QDII）C
下属分级基金的交易代码	007813	007814
报告期末下属分级基金的份额总额	717,601.52 份	315,057.63 份

### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159803
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 27 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 5 月 26 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，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含境内发行的存托凭证、美国存托凭证等）组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动进行相应调整，力争将年化跟踪误差控制在 3% 以内，主要投资策略包括股票及存托凭证投资策略、债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资融券业务策略等。
业绩比较基准	中证浙江新动能指数收益率

风险收益特征	本基金为股票型基金，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。本基金为指数型基金，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。此外，本基金可投资境外市场，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境外市场的风险。
--------	---

### §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 14 日)	
	易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) A	易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) C
1.本期已实现收益	562,593.51	270,164.93
2.本期利润	-312,403.51	-155,790.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1048	-0.1024
4.期末基金资产净值	812,468.20	355,726.55
5.期末基金份额净值	1.1322	1.1291

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.本报告的实际编制期间为2021年7月1日至2021年9月14日(基金最后运作日)。

#### 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

##### 易方达中证浙江新动能 ETF 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	-5.67%	1.30%	-5.93%	1.33%	0.26%	-0.03%
过去六个月	2.65%	1.10%	3.21%	1.15%	-0.56%	-0.05%
过去一年	8.52%	1.20%	10.72%	1.26%	-2.20%	-0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	13.22%	1.08%	37.58%	1.28%	-24.36%	-0.20%

### 易方达中证浙江新动能 ETF 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	-5.70%	1.29%	-5.93%	1.33%	0.23%	-0.04%
过去六个月	2.55%	1.10%	3.21%	1.15%	-0.66%	-0.05%
过去一年	8.31%	1.20%	10.72%	1.26%	-2.41%	-0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	12.91%	1.08%	37.58%	1.28%	-24.67%	-0.20%

注：过去三个月：2021年7月1日-2021年9月14日；

过去六个月：2021年4月1日-2021年9月14日；

过去一年：2020年10月1日-2021年9月14日；

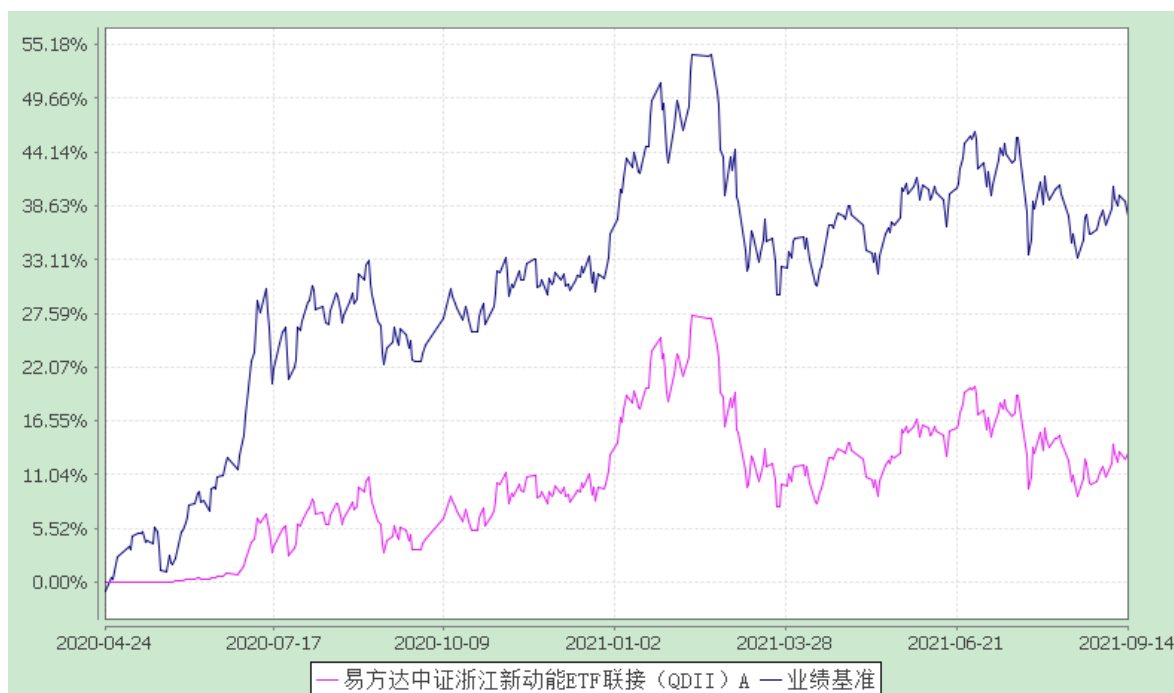
自基金合同生效起至今：2020年4月24日-2021年9月14日。

### 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

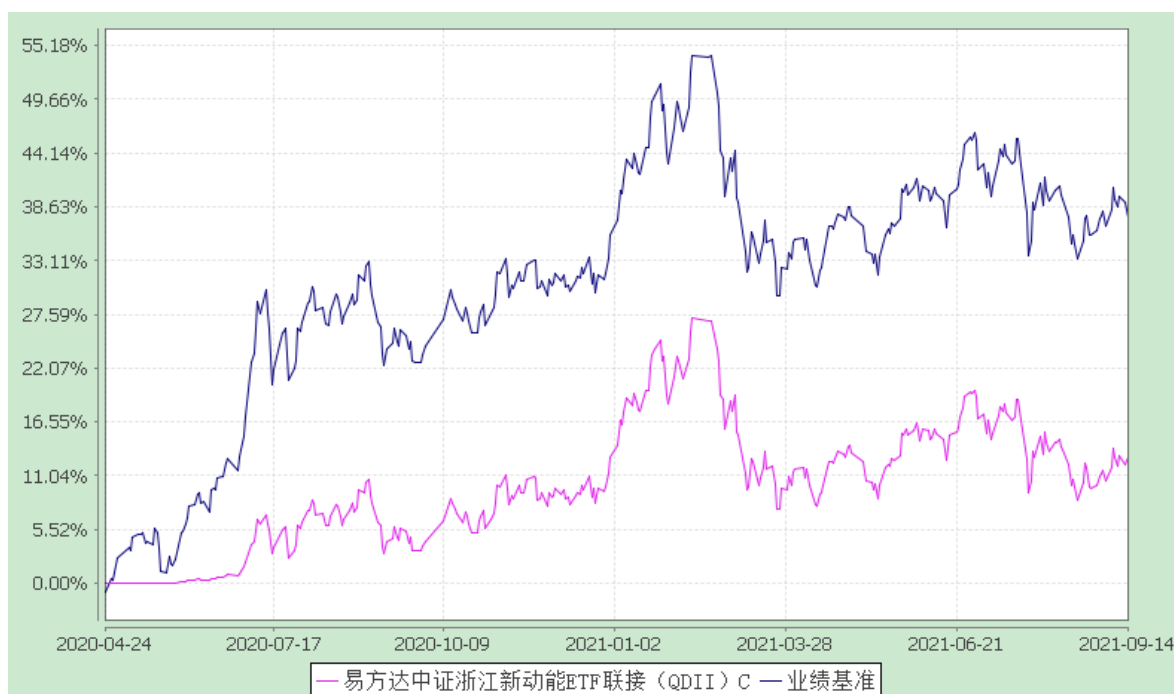
易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 4 月 24 日至 2021 年 9 月 14 日)

### 易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) A



### 易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII) C



注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

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13.22%，C类基金份额净值增长率为12.91%，同期业绩比较基准收益率为37.58%。

3.本报告截止日期为2021年9月14日(基金最后运作日)。

## §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		
杨俊	本基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自2019年11月06日至2021年08月20日）、易方达中证国企一带一路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（自2020年01月21日至2021年08月20日）、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自2020年04月27日至2021年08月20日）、基本面指数增强部总经理助理	2020-04-24	2021-08-21	12年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理、解决方案部总经理助理、指数增强投资部总经理助理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理、易方达国企改革



					指数分级证券投资基金基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理。
刘树荣	本基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中小企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达中证万得并购重组指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、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的基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 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、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金	2020-04-28	-	14 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、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证

	<p>经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证银行指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达中证银行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</p>			<p>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、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)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《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

本基金跟踪的标的指数为中证浙江新动能指数。中证浙江新动能指数选取全球主要交易所上市的浙江省企业作为样本股，采用自由流通市值加权，以全面反映浙江省上市企业的表现。本基金是易方达中证浙江新动能 ETF 的联接基金，主要投资于易方达中证浙江新动能 ETF。

中证浙江新动能指数成份股上市地集中在沪深交易所、香港及美国交易所，其中沪深交易所上市权重占比较大，指数走势与国内经济发展形势与股票市场走势密切相关。2021 年三季度，市场风格再度发生变化，周期板块获得投资者的追捧表现较好。按申万一级行业分类，采掘、公用事业、有色金属、钢铁、化工等行业涨幅居前，而二季度涨幅较大的电子、医药生物行业则表现落后。中证浙江新动能指数行业权重占比较大的电子、医药生物、食品饮料、银行在三季度表现较为落后。此外，境外投资者对中概股的风险偏好降低，进一步拖累中证浙江新动能指数三季度走势震荡下跌。

本报告期，本基金发布了进入清算期及终止基金合同的公告，本基金自 2021

年 9 月 15 日起进入清算期。

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.1322 元，本报告期份额净值增长率为-5.67%，同期业绩比较基准收益率为-5.93%；C 类基金份额净值为 1.1291 元，本报告期份额净值增长率为-5.70%，同期业绩比较基准收益率为-5.93%。年化跟踪误差 4.20%，超过合同规定的控制范围，因本基金规模较小，且受投资者申赎对基金仓位的影响较大所致。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自本报告期初至 2021 年 9 月 14 日，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

自本报告期初至 2021 年 9 月 14 日，本基金均存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人于 2021 年 9 月 15 日发布本基金进入清算期及终止基金合同的公告，本基金最后运作日为 2021 年 9 月 14 日，自 2021 年 9 月 15 日起进入清算程序，请投资者关注相关公告。

## §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	654,643.19	27.79
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	376,921.17	16.00
8	其他资产	1,323,759.35	56.20
9	合计	2,355,323.71	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	易方达中证浙江新动能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	654,643.19	56.04

## 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**

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**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	易方达中证浙江新动能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	654,643.19	56.04

**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, 宁波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宁波监管局、中国人民银行宁波市中心支行、国家外汇管理局宁波市分局的处罚。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督管理总局的处罚。

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	546.67
2	应收证券清算款	1,322,443.55
3	应收股利	-
4	应收利息	769.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,323,759.35

## 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	易方达中证浙江新动能ETF联接(QDII) A	易方达中证浙江新动能ETF联接(QDII) C
报告期期初基金份额总额	4,014,300.95	2,109,781.40
报告期期间基金总申购份额	137,150.14	185,423.71
减：报告期期间基金总赎回份额	3,433,849.57	1,980,147.48
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	717,601.52	315,057.63

注：本基金自2021年09月15日起进入清算期，本报告期的相关数据按实际存续期

计算。

## §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
个人	1	2021年08月27日~2021年09月09日	501,777.50	-	501,777.50	-	-
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；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；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>							

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的文件；
2. 《易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
3. 《易方达中证浙江新动能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。

## **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

二〇二一年十月二十七日