易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 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：二〇二二年七月二十日

§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 2022 年 7 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达创业板 ETF
场内简称	创业板 ETF 易方达
基金主代码	159915
交易代码	159915
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2011 年 9 月 20 日
报告期末基金份额总额	6,227,087,446.00 份
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	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的

	指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。为更好地实现投资目标，本基金可投资存托凭证。本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品，如与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即创业板指数收益率。
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。
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

§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 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-1,381,222,518.88
2.本期利润	1,141,562,184.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.1580
4.期末基金资产净值	16,995,298,118.51
5.期末基金份额净值	2.7293

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。

3.2 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

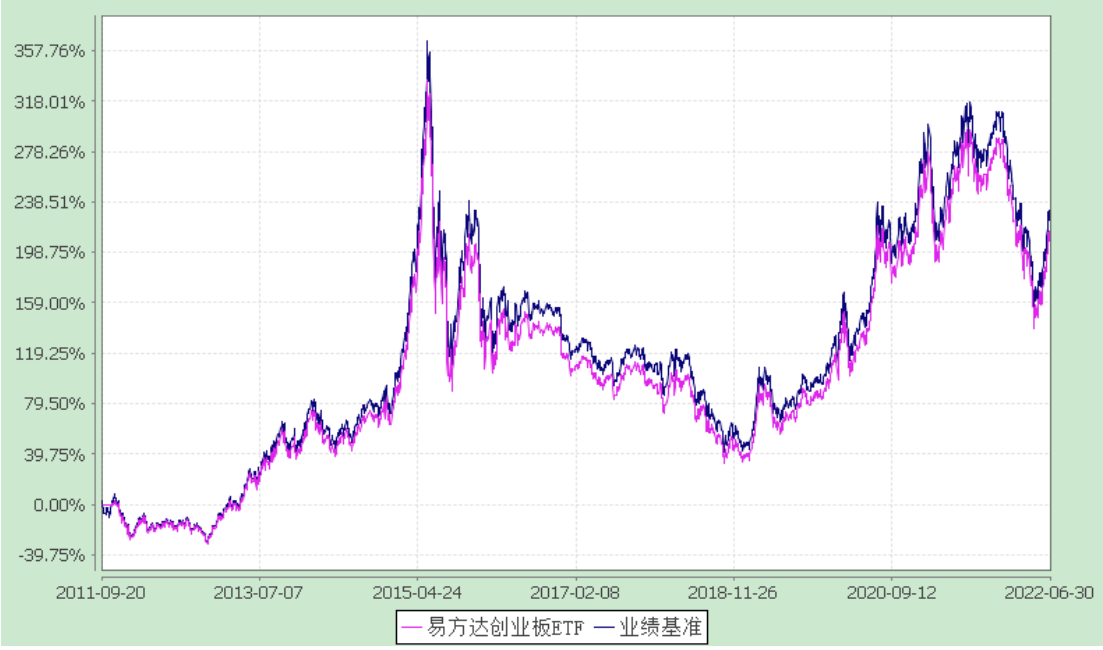
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.97%	2.10%	5.68%	2.11%	0.29%	-0.01%
过去六个月	-15.23%	2.05%	-15.41%	2.05%	0.18%	0.00%
过去一年	-18.99%	1.80%	-19.17%	1.80%	0.18%	0.00%
过去三年	87.53%	1.80%	85.95%	1.80%	1.58%	0.00%
过去五年	55.84%	1.75%	54.59%	1.75%	1.25%	0.00%
自基金合同生效起至今	212.67%	1.95%	228.84%	1.96%	-16.17%	-0.01%

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

易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金

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

（2011 年 9 月 20 日至 2022 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 212.67%，同期业绩比较基准收益率为 228.84%。

§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		
成曦	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、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券	2016-05-07	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、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

	投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证港股通中国 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证消费				金经理、易方达中小板指数证券投资基金（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、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通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、易方达原油证券投资基金（QDII）基金经理、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达上证 50 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、易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

	50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理				
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、易方达中证银行指数证券投资基金（LOF）的基金经理、易方达中证银	2017-07-18	-	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、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联接基金基金经理。

	行交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证长江保护主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理				

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遵规守信情况的说明

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 7 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，5 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

本基金跟踪的标的指数为创业板指，该指数由深圳证券交易所创业板中市值大、流动性好的 100 只股票组成，以综合反映创业板市场的整体表现。报告期内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组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2022 年二季度，受国内局部地区疫情反复的影响，企业生产经营活动受到了一定考验。随着国内疫情逐步得到控制，叠加“稳增长”政策发力，流动性投放增加，我国社会经济活动逐渐回归正轨。在多重因素持续变化的影响下，报告期内 A 股市场整体走势先抑后扬，波动率维持在较高水平。创业板指作为深市创业板的代表性宽基指数，市值分布偏大中盘，成长风格突出，主要权重行业为电力设备、医药生物、电子等新兴产业。指数经过多年迭代，沉淀了一批科技及高端制造龙头公司，使得指数业绩不仅保持较高增速，而且更具持续性。本报告期内，随着疫情逐步稳定，经济生产得以恢复，成长风格的风险偏好有所修复，新兴产业的股票价格走势出现明显反弹。报告期内，指数中的电力设备行业成份股表现较好，对指数收益贡献较大，而计算机、医药生物等行业的成份股表现落后，拖累了指数表现。2022 年二季度，创业板指数上涨 5.7%。

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，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，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，本基金份额净值为 2.7293 元，本报告期份额净值增长率为 5.97%，同期业绩比较基准收益率为 5.68%，年化跟踪误差 0.17%，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	16,973,122,812.23	99.80
	其中：股票	16,973,122,812.23	99.80
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	30,452,132.05	0.18
7	其他资产	3,801,709.31	0.02
8	合计	17,007,376,653.59	100.00

注：1.上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末融出证券市值为 2,721,803,423.00 元，占净值比例 16.02%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	491,706,324.63	2.89
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,816,224,856.15	75.41
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、软件和信息技术服务业	620,972,567.17	3.65
J	金融业	1,362,593,893.40	8.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	69,359,254.53	0.41
M	科学研究和技术服务业	743,294,117.12	4.37
N	水利、环境和公共设施管理业	47,687,207.52	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	563,670,280.09	3.32
R	文化、体育和娱乐业	257,610,251.62	1.52
S	综合	-	-
	合计	16,973,118,752.23	99.87

5.3 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

5.3.1 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	300750	宁德时代	5,947,242	3,175,827,228.00	18.69
2	300059	东方财富	49,980,418	1,269,502,617.20	7.47
3	300760	迈瑞医疗	2,137,327	669,410,816.40	3.94
4	300124	汇川技术	8,939,557	588,848,619.59	3.46
5	300014	亿纬锂能	6,004,823	585,470,242.50	3.44
6	300015	爱尔眼科	11,027,860	493,717,292.20	2.91
7	300498	温氏股份	23,095,647	491,706,324.63	2.89
8	300274	阳光电源	4,801,608	471,757,986.00	2.78
9	300122	智飞生物	3,627,574	402,696,989.74	2.37
10	300142	沃森生物	7,795,974	377,247,181.86	2.22

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投资股指期货。

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投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	157,457.96
2	应收证券清算款	2,104,604.46
3	应收股利	699,293.84
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	840,353.05
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	3,801,709.31

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	773,285,400.00	4.55	转融通流通受限
2	300059	东方财富	250,616,720.00	1.47	转融通流通受限
3	300498	温氏股份	112,894,483.00	0.66	转融通流通受限
4	300274	阳光电源	86,489,475.00	0.51	转融通流通受限
5	300124	汇川技术	72,437,239.00	0.43	转融通流通受限
6	300015	爱尔眼科	70,356,055.00	0.41	转融通流通受限
7	300014	亿纬锂能	51,060,750.00	0.30	转融通流通受限
8	300142	沃森生物	48,525,492.00	0.29	转融通流通受限
9	300122	智飞生物	36,477,886.00	0.21	转融通流通受限
10	300760	迈瑞医疗	15,252,840.00	0.09	转融通流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	6,629,369,344.00
报告期期间基金总申购份额	5,663,718,102.00
减：报告期期间基金总赎回份额	6,066,000,000.00
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	6,227,087,446.00

注：期初基金总份额包含场外份额 17,914,408 份；期末基金总份额包含场外份额 21,632,510 份；总申购份额包含场外总申购份额 3,718,102 份。

§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 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
中国工商银行股份有限公司－易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2022 年 04 月 01 日~2022 年 06 月 30 日	1,702,447,620.00	834,000,000.00	561,391,196.00	1,975,056,424.00	31.72%
产品特有风险							
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；如场外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，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；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。							

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. 中国证监会核准易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；

2. 中国证监会准予易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金变更注册的文件；

3. 《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

4. 《易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

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

二〇二二年七月二十日