

易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 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：二〇二一年七月二十日

§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 2021 年 7 月 16 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中证浙江新动能 ETF（QDII）
场内简称	浙江 ETF
基金主代码	159803
交易代码	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
报告期末基金份额总额	10,851,158.00 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	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含美国存托凭证等）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。
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

§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 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	784,280.38
2.本期利润	1,446,712.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.1228

4.期末基金资产净值	15,133,991.62
5.期末基金份额净值	1.3947

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	9.79%	0.96%	10.24%	1.00%	-0.45%	-0.04%
过去六个月	7.05%	1.37%	8.11%	1.41%	-1.06%	-0.04%
过去一年	28.64%	1.32%	31.04%	1.38%	-2.40%	-0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	39.47%	1.24%	50.54%	1.34%	-11.07%	-0.10%

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
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 27 日至 2021 年 6 月 30 日）



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（第十四部分二、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，基金份额净值增长率为 39.47%，同期业绩比较基准收益率为 50.54%。

§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、易方达中证浙江新动能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、基本面指数增强部总经理助理	2020-04-27	-	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、易方达中 证银行交易型开放式指数证 券投资基金的基金经理、易方 达中证银行指数证券投资基金（LOF）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	2020-04-2 9	-	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

	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 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 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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、易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）的基金经理（自 2018 年 08 月 11 日至 2021 年 04 月 14 日）、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）（原易方达中小板指数证券投资基金（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			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。
--	--	--	--	--

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、规范化的投资研究和决策流程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，均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。

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。报告期内，本基金主要采用组合复制策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

中证浙江新动能指数由浙江省上市企业组成，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 年二季度，经济运行稳中加固、稳中向好，货币政策保持稳定。国内股票市场在经历了春节后的大幅调整后，二季度总体走势呈现企稳回升态势。按 wind 一级行业分类，中证浙江新动能指数行业权重最大的信息技术行业在二季度表现较好，带动指数在二季度大幅反弹。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.3947 元，本报告期份额净值增长率为 9.79%，同期业绩比较基准收益率为 10.24%，年化跟踪误差 0.94%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

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，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。

本报告期，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。鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境影响，本基金将继续运作。

§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	14,520,746.39	87.34
	其中：普通股	11,850,024.51	71.28
	存托凭证	2,670,721.88	16.06
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,610.19	0.06
	其中：债券	10,610.19	0.06

	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	652,366.38	3.92
8	其他资产	1,441,845.66	8.67
9	合计	16,625,568.62	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

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
中国	9,448,381.27	62.43
美国	2,670,721.88	17.65
中国香港	2,401,643.24	15.87
合计	14,520,746.39	95.95

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	1,756,894.70	11.61
工业	1,084,687.51	7.17
非必需消费品	3,420,874.44	22.60
必需消费品	576,509.59	3.81
保健	1,647,007.28	10.88
金融	1,132,102.00	7.48
信息技术	3,274,988.65	21.64
电信服务	1,443,052.22	9.54
公用事业	58,353.00	0.39

房地产	126,277.00	0.83
合计	14,520,746.39	95.95

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 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

5.4.1 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

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	1,018	1,491,391.86	9.85
2	Hangzhou Hikvision Digital Technology Co Ltd	海康威视	002415 CH	深圳证券交易所	中国	18,300	1,180,350.00	7.80
3	NetEase Inc	网易公司	NTES US	纳斯达克证券交易所	美国	1,584	1,179,330.02	7.79
4	Sunny Optical Technology (Group)	舜宇光学科技	2382 HK	香港证	中国香港	3,095	631,975.58	4.18

	Company Limited	(集团)有限公司		券交易所				
5	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	香港证券交易所	中国香港	3,638	593,615.69	3.92
6	Bank of Ningbo Co Ltd	宁波银行	002142 CH	深圳证券交易所	中国	14,100	549,477.00	3.63
7	Geely Automobile Holdings Limited	吉利汽车控股有限公司	175 HK	香港证券交易所	中国香港	23,255	473,108.00	3.13
8	Nongfu Spring Co Ltd	农夫山泉股份有限公司	9633 HK	香港证券交易所	中国香港	13,681	443,394.59	2.93
9	Hangzhou Tigermed Consulting Co Ltd	泰格医药	300347 CH	深圳证券交易所	中国	2,000	386,600.00	2.55
10	Topchoice Medical Corp	通策医疗	600763 CH	上海证券交易所	中国	900	369,900.00	2.44

				易 所				
--	--	--	--	--------	--	--	--	--

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
未评级	10,611.26	0.07

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪、惠誉提供的债券信用评级信息，债券投资以全价列示。

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	127036	三花转债	8,100	10,610.19	0.07

注：1.债券代码为 ISIN 码或当地市场代码。

2.数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

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。

5.9 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

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 2020 年 10 月 16 日，宁波银保监局对宁波银行作出“罚款人民币 30 万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚。违法违规事由：授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位。

2021 年 6 月 10 日，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司的如下违法违规行为作出罚款人民币 25 万元的行政处罚决定：代理销售保险不规范。

2020 年 12 月 14 日，阿里巴巴集团控股有限公司因未报告过去的并购交易行为被中华人民共和国国家市场监督管理总局处以 50 万元人民币罚款。

2021 年 4 月 10 日，阿里巴巴集团控股有限公司因实施“二选一”等涉嫌垄断行为被中华人民共和国国家市场监督管理总局责令阿里巴巴集团停止违法行为，并处罚 182.28 亿元。

本基金为指数型基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除宁波银行、阿里巴巴外，本基金投资的其他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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	1,604.02
2	应收证券清算款	1,356,184.36
3	应收股利	8,363.17
4	应收利息	77.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	1,441,845.66

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	11,851,158.00
报告期期间基金总申购份额	2,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	3,000,000.00
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	10,851,158.00

§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
中国工商银行股份有限公司一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	1	2021年04月01日~2021年06月30日	4,957,030.00	120,000.00	267,000.00	4,810,030.00	44.33%
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。							

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

二〇二一年七月二十日