易方达中债1-3年国开行债券指数证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十九日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年4月29日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中债1-3年国开行债券指数
基金主代码	007169
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年4月29日
报告期末基金份额总额	4,292,880,007.79份
投资目标	本基金通过指数化投资,争取获得与标的指数相似的总回报,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法,投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。本基金根据债券的剩余期限将标的指数成份券划分层级,按照分层抽样的原理,确定各层级成份券及其权重。分层完成后,本基金在各层级成份券内利用动态最优化等方法筛选出与各层级总体风险收益特征(例如久期、凸性等)相近的且流动性较好(主要考虑交行规模、日均成交金额、期间成交天数等指标)的个券组合,或部分投资于非成份券,以更好的实现对标的指数的跟踪。
业绩比较基准	中债-1-3年国开行债券指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	易方达中债1-3年国开行债券指数A / 易方达中债1-3年国开行债券指数C
下属分级基金的交易代码	007169 / 007170
报告期末下属分级基金的份额总额	4,292,186,260.36份 / 693,747.43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(2019年4月29日(基金合同生效日)-2019年6月30日)	
	易方达中债1-3年国开行债券指数A	易方达中债1-3年国开行债券指数C
1.本期已实现收益	31,735,374.28	22,199.63
2.本期利润	34,780,303.62	22,278.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0055	0.0047
4.期末基金资产净值	4,308,685,730.61	696,136.18
5.期末基金份额净值	1.0038	1.0034

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.本基金合同于2019年4月29日生效,合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

易方达中债1-3年国开行债券指数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	0.58%	0.01%	0.83%	0.03%	-0.25%	-0.02%

易方达中债1-3年国开行债券指数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	0.54%	0.01%	0.83%	0.03%	-0.29%	-0.02%

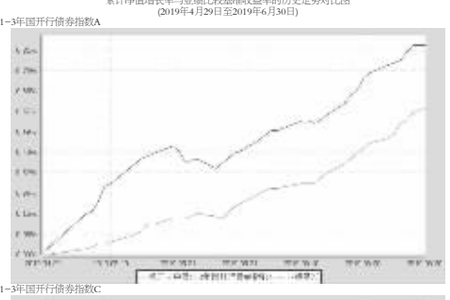
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中债1-3年国开行债券指数证券投资基金

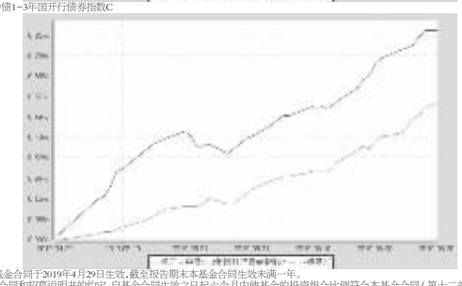
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019年4月29日至2019年6月30日)

易方达中债1-3年国开行债券指数A



易方达中债1-3年国开行债券指数C



注:1.本基金合同于2019年4月29日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定,自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同(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。本报告期末基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值增长率为0.58%,C类基金份额净值增长率为0.54%,同期业绩比较基准收益率为0.83%。

§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		
王晓晖	本基金的基金经理,易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)的基金经理,易方达中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理,易方达中债3-5年期国债指数证券投资基金的基金经理,易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理,易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,易方达投资级信用债债券型证券投资基金的基金经理,易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理,易方达恒益定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,易方达宏观短债债券型证券投资基金的基金经理,易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理,固定收益投资部副总经理,易方达资产管理(香港)有限公司基金经理,就证券投资向证券投资委员会委员	2019-04-29	-	16年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员,债券交易主管,固定收益总部总经理助理,固定收益基金投资部副总经理,易方达货币市场基金基金经理,易方达保证金收益货币市场基金基金经理,易方达保本一号混合型证券投资基金基金经理。

注:1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日,“离任日期”为公告确定的解聘日期。

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、规范化的投资研究和决策流程、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28次,其中27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,1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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度宏观经济数据逐步走低,体现为工业增加值数据在4-5月有所走弱,4月工业增加值同比增长5.4%,低于市场预期,部分是由于春节错位和劳动节假期备货的影响;5月工业增加值同比增长5.0%,继续低于预期,结构上,主要是制造业持续疲弱,投资方面,2019年1-5月份全国固定资产投资同比增长5.6%,增速比1-3月份回落0.7个百分点,投资在4-5月连续两个月下滑,下滑速度有所加快。通胀方面,整体符合预期,但是结构上分化比较明显,食品环比上升,非食品环比仍处于低位。金融数据方面,4月新增社会融资数据低于市场预期,5月有所恢复,但力度不强,结构上,表内实体贷款中居民中长期贷款持续表现较好,企业中长期贷款则相对偏弱,5月下旬,银行间业市场出现了较为严重的信用风险事件并引发局部流动性紧张,央行等监管机构及时进行风险疏导并保持资金宽松,风险及时得到控制;但从长远来看,银行间原有的融资方式已经发生根本改变,风险重新定价、流动性呈现分层对中小金融机构以及非银机构的投资行为都将继续产生影响。

债券市场在二季度先跌后涨,延续震荡走势。4月,国内经济基本面好于预期,央行打破市场降准预期,叠加缴税期流动性边际收紧,债市收益率大幅上行,进入5月,中美贸易谈判预期反复带动避险情绪,银行间业市场出现的信用风险事件引发市场对流动性及信用风险的担忧,债券收益率呈先下后上态势,6月,资金面整体宽松,基本面数据偏弱显示经济面临下行压力,债券市场收益率整体下行。

报告期内本基金以抽样复制的方式跟踪指数为主,操作上,由于本基金在4月底成立,考虑到开户期和建仓期的影响,基金在本报告期的平均久期略低于指数,本基金目前处于建仓期,在逐步建仓的过程中,组合的久期和仓位会都呈低于基准,导致在报告期出现跟踪误差。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.0038元,本报告期份额净值增长率为0.58%;C类基金份额净值为1.0034元,本报告期份额净值增长率为0.54%;同期业绩比较基准收益率为0.83%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	4,978,410,000.00	93.19
	其中:债券	4,978,410,000.00	93.19
	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	95,000,000.00	1.78
	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	147,027,452.82	2.75
7	其他资产	121,909,074.94	2.28
8	合计	5,342,346,527.76	100.00

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,978,410,000.00	115.52
	其中:政策性金融债	4,978,410,000.00	115.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,978,410,000.00	115.52

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	170209	17国开09	8,100,000	821,340,000.00	19.06
2	150220	15国开20	7,900,000	794,898,000.00	18.45
3	140203	14国开03	5,600,000	582,736,000.00	13.52
4	160206	16国开06	3,600,000	359,352,000.00	8.34
5	110226	11国开26	2,600,000	266,032,000.00	6.17

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本基金本报告期没有投资股票,因此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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,502.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	121,903,572.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,909,074.94

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	易方达中债1-3年国开行债券指数A	易方达中债1-3年国开行债券指数C
基金合同生效日基金份额总额	6,612,345,229.07	5,694,380.26
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	20,198.63	73.19
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,320,179,167.34	5,000,706.02
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	4,292,186,260.36	693,747.43

注:本基金合同生效日为2019年04月29日。

§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又易明细

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	2019年04月29日-2019年06月30日	1,500,336,500.00	-	220,000,000.00	1,280,336,500.00	29.82%
	2	2019年06月24日-2019年06月30日	999,999,000.00	-	-	999,999,000.00	23.29%
	3	2019年06月10日-2019年06月23日	1,299,999,000.00	-	1,299,999,000.00	-	-
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。						

§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债1-3年国开行债券指数证券投资基金注册的文件;

2.《易方达中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金合同》;

3.《易方达中债1-3年国开行债券指数证券投资基金托管协议》;

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、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
二〇一九年七月十九日

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

2019 第二季度 报告

2019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:二〇一九年七月十九日

§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2019年7月17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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金产品概况

基金简称	易方达上证中盘ETF联接	
基金主代码	110021	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010年3月31日	
报告期末基金份额总额	181,761,085.86份	
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。	
投资策略	本基金为上证中盘ETF的联接基金。上证中盘ETF是采用完全复制法实现对上证中盘指数紧密跟踪的金融动指数基金,本基金主要通过投资于上证中盘ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。在投资运作过程中,本基金将在综合考虑公规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用实物申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行上证中盘ETF的买卖,将指数的生金融产品推出以后,基金管理人在履行适当程序后,本基金可以适度运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。	
业绩比较基准	上证中盘指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5%	
风险收益特征	本基金为上证中盘ETF的联接基金,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金,本基金主要通过投资于上证中盘ETF追踪业绩比较基准,具有与业绩比较基准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	
下属分级基金的基金简称	易方达上证中盘ETF联接A	易方达上证中盘ETF联接C
下属分级基金的交易代码	110021	004743
报告期末下属分级基金的份额总额	178,906,723.49份	2,854,362.37份

注:自2017年6月2日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6月5日。

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510130
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2010年3月29日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2010年6月23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,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法进行投资,即按照上证中盘指数的成份股组成及权重构建股票投资组合,但是当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生,基金管理人无法按照指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	上证中盘指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,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。

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	易方达上证中盘ETF联接A	易方达上证中盘ETF联接C
1.本期已实现收益	1,321,917.41	16,441.79
2.本期利润	-6,119,298.50	-118,475.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0344	-0.0391
4.期末基金资产净值	239,035,250.27	3,917,660.53
5.期末基金份额净值	1.3361	1.3725

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

易方达上证中盘ETF联接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	-2.71%	1.48%	-4.02%	1.50%	1.31%	-0.02%

易方达上证中盘ETF联接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	-2.77%	1.48%	-4.02%	1.50%	1.25%	-0.02%

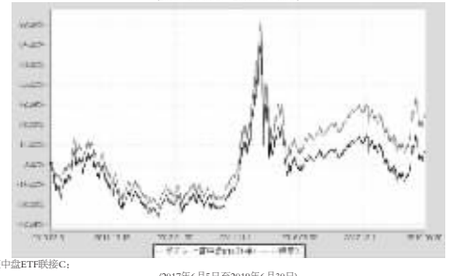
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达上证中盘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

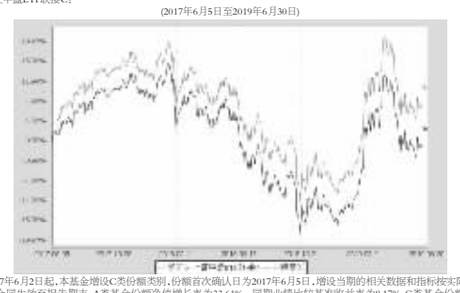
易方达上证中盘ETF联接A:

(2010年3月31日至2019年6月30日)



易方达上证中盘ETF联接C:

(2017年6月5日至2019年6月30日)



注:1.自2017年6月2日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6月5日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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33.61%,同期业绩比较基准收益率为8.17%,C类基金份额净值增长率为10.74%,同期业绩比较基准收益率为2.28%。

§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		
刘树荣	本基金的基金经理,易方达中小板指数分级证券投资基金的基金经理,易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理,易方达消费恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理,易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理,易方达医疗保健指数证券投资基金的基金经理,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,易方达沪深300量化多因子指数证券投资基金的基金经理,易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理,易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理,易方达标普消费品指数证券投资基金(LOF)的基金经理,易方达上证50指数证券投资基金(LOF)的基金经理	2018-08-11	-	12年	硕士研究生,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。

注:1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告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、规范化的投资研究和决策流程、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28次,其中27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,1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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1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上证中盘指数,上证中盘指数由上证180指数成份股中剔除50只上证50指数成份股后剩余的130家成份股构成,以综合反映沪市中盘公司的整体状况。

国内宏观经济上,一季度国内GDP增长6.4%,二季度在中美贸易摩擦再生扰动的情况下,经济下行压力再次凸显,6月制造业PMI持平前值至49.4%,连续两个月处于近3年次低水平,也是连续2个月低于荣枯线,生产、新订单、新出口订单、从业人员指数等主要分项指数也均延续下滑,指数走势上,上证中盘指数一季度大幅上涨28.2%,二季度在内忧外患的市场情绪下跟随大盘下跌4.3%。

本基金另方达上证中盘ETF的联接基金,主要投资于上证中盘ETF,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、赎回以及成分股调整事项,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。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金A类基金份额净值为1.3361元,本报告期份额净值增长率为-2.71%;C类基金份额净值为1.3725元,本报告期份额净值增长率为-2.77%;同期业绩比较基准收益率为-4.02%。年化跟踪误差0.72%,在合同规定的目标控制范围之内。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	229,975,199.18	94.31
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	13,660,864.75	5.60
8	其他资产	211,285.78	0.09
9	合计	243,847,349.71	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	占基金资产净值比例(%)
1	易方达上证中盘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	229,975,199.18	94.66

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.4 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.5 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。

5.6 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。

5.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 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。

5.11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。

5.12投资组合报告附注

5.12.12019年1月25日,中国银行保险监督管理委员会江苏监管局针对江苏银行股份有限公司未按业务实质准确计量风险资产;理财产品之间未能实现相分离;理财投资非标资产未严格比照信贷资管理,对授信资金未按约定用途使用监督不力的违法违规事实,对江苏银行股份有限公司处以人民币90万元行政罚款。

本基金为目标ETF的联接基金,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。除江苏银行外,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。

5.12.2基金本报告期末未持有股票。

5.12.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,685.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,608.47
5	应收申购款	201,991.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	211,285.78

5.12.4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。

5.12.5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	易方达上证中盘ETF联接A	易方达上证中盘ETF联接C
本报告期期初基金份额总额	179,688,572.70	2,422,561.19
本报告期基金总申购份额	19,074,953.50	5,323,168.19
减,本报告期基金总赎回份额	19,856,802.71	4,891,367.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	178,906,723.49	2,854,362.37

§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又易明细

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 备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会核准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募集的文件;

2.《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基金合同》;

3.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《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托管协议》;

5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

8.2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。

8.3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
二〇一九年七月十九日

易方达汇诚养老目标日期2033三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

2019 第二季度 报告

2019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:二〇一九年七月十九日

§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2019年7月17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2019年4月30日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达汇诚养老2033三年持有混合发起式(FOF)
基金主代码	006859
交易代码	006859
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年4月30日
报告期末基金份额总额	10,020,610.37份
投资目标	在投资管理过程中遵循各个阶段既定的投资比例,动态调整大类资产配置,控制基金下行风险,力争追求基金长期稳健增值。
投资策略	本基金属于目标日期策略基金,基金管理人根据设计的下滑曲线确定权益类资产与非权益类资产的配置比例,随着所设定目标日期的临近,本基金以整体趋势上积极逐步降低权益类资产的配置比例,增加非权益类资产的配置比例。本基金的主要投资策略包括资产配置策略