易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金

2019 年第 2 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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。

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》等法律法规的规定和《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关约定，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议通过了《关于易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。本基金的最后运作日定为 2019 年 6 月 30 日，并于 2019 年 7 月 1 日进入清算程序。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 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日(基金最后运作日)止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达深证成指 ETF
场内简称	深成指 EF
基金主代码	159950
交易代码	159950
基金运作方式	交易型开放式（ETF）

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金合同生效日	2017 年 4 月 27 日
报告期末基金份额总额	4,501,380.00 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。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%内，年化跟踪误差控制在 2%内。
业绩比较基准	深证成份指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	(2019 年 4 月 1 日-2019 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	2,742,309.25
2.本期利润	-2,858,437.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0765
4.期末基金资产净值	4,310,392.11
5.期末基金份额净值	0.9576

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	-5.71%	1.75%	-7.35%	1.84%	1.64%	-0.09%

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

易方达深证成指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

（2017 年 4 月 27 日至 2019 年 6 月 30 日）

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-4.24%，同期业绩比较基准收益率为-10.06%。

§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		
成曦	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、易方达原油证券投资基金(QDII)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、易方达生物科技指数分级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	2017-04-27	-	11 年	硕士研究生，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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金(LOF)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、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、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的基金经理、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的基金经理				
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、易方达生物科技指数分级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联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、	2017-07-18	-	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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	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、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金(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				

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

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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深证成指。深证成指由深圳证券市场规模大、流动性好、最具代表性的 500 只股票组成，既包含了市值超千亿的大盘蓝筹，也包含中小板、创业板中的小盘成长股，兼具了价值股与成长股的特性，风格较均衡，深圳整体股票市场代表性强。报告期内，本基金主要采取完全复制法的投资策略，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而进行相应调整。

2019 年第二季度，受中美贸易摩擦影响，市场风险偏好明显下降，股票市场经历了一波调整，在此过程中，市场资金的博弈性上升，对短期波动更为敏感。随着 G20 会议 6 月底在日本大阪召开，中美贸易摩擦得到缓解，市场明显企稳回升。

报告期内，国内经济增速逐步走稳，货币和财政政策持续宽松，MSCI 扩大了 A 股纳入比例，外资持续流入，此外财政政策中降费减税的效果也开始逐渐体现，使得国内股市的中长期预期在发生转变。

市场普遍预期科创板将在 2019 年第三季度开市交易，该板块的推出将进一步提升市场对高新技术类公司的偏好，尤其是能够体现国内自主发展，自主可控的科技产业将更受资本关注。

在上述背景下，预计股票市场有可能将继续体现两类投资偏好：一种是行业

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

竞争格局清晰，市场占比高，业绩稳定增长的龙头公司；另一种是受政策和资本青睐，具备核心技术，行业空间扩张中的成长类公司。

2019 年第二季度，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》等法律法规的规定和《基金合同》的有关约定，基金管理人经与基金托管人协商一致，召集了本基金的基金份额持有人大会，审议终止本基金基金合同并终止上市有关事项，审议议案于 2019 年 6 月 28 日表决通过，自该日起本次基金份额持有人大会决议生效。本基金最后运作日为 2019 年 6 月 30 日，自 2019 年 7 月 1 日起，本基金进入基金财产清算程序。

4.4.2 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 0.9576 元，本报告期份额净值增长率为-5.71%，同期业绩比较基准收益率为-7.35%。

本报告期，本基金日跟踪偏离度的均值为 0.08%，年化跟踪误差 1.708%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.5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 2019 年 5 月 17 日、2019 年 6 月 25 日至本报告期末，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 2019 年 5 月 17 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。基金资产净值的下滑主要受市场环境影响，基金管理人已按照法律法规及《基金合同》的有关约定，召集了本基金基金份额持有人大会，审议通过了《关于易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，本基金于 2019 年 7 月 1 日进入清算程序。

§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	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	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	1,731,842.22	39.60
7	其他资产	2,642,014.32	60.40
8	合计	4,373,856.54	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

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

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,110.64
2	应收证券清算款	2,616,085.52
3	应收股利	-
4	应收利息	818.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,642,014.32

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

报告期期初基金份额总额	36,989,524.00

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

报告期基金总申购份额	46,737,314.00
减：报告期基金总赎回份额	79,225,458.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	4,501,380.00

注：期初基金总份额包含场外份额 15,988,144 份；总申购份额包含场外总申购份额 46,737,314 份；总赎回份额包含场外总赎回份额 62,725,458 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
个人	1	2019 年 06 月 26 日~2019 年 06 月 30 日	-	1,306,017.00	-	1,306,017.00	29.01%
中国银行股份有限公司－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	1	2019 年 04 月 01 日~2019 年 06 月 26 日	31,088,144.00	48,309,914.00	79,398,058.00	-	-
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							

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于2019年5月22日至2019年6月27日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2019年6月28日表决通过了《关于易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金终止基金合同并终止上市有关事项的议案》。根据基金份额持有人大会通过的议案，自2019年7月1日起，本基金进入清算期，基金管理人将组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并将清算结果及时予以公告。本基金终止上市日为2019年7月12日，在终止上市后，基金管理人将按照规定办理场内基金份额退出登记等业务。有关重要事项详情可见基金管理人分别在2019年6月29日、2019年7月9日在《证券日报》和基金管理人官网发布的《易方达基金管理有限公司关于易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》和《易方达基金管理有限公司关于易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金终止上市的公告》。

§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深证成指交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

2.易方达基金管理有限公司关于易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告；

3.《易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

4.《易方达深证成指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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn