

易方达信息产业混合型证券投资基金

2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年十月二十四日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 22 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达信息产业混合
基金主代码	001513
交易代码	001513
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	720,717,812.49 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在股票投资方面，本基金综合考虑行业景气度及可持续性、行业竞争格局、技术水平及其发展趋势、国家政策等因素，进行股票资产

	在各细分子行业之间的配置。在个股选择方面，本基金对信息产业上市公司的投资价值进行综合评价，精选具备较强竞争优势的上市公司。在债券投资方面，本基金将通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率 $\times 70\%$ + 一年期人民币定期存款利率（税后） $\times 30\%$
风险收益特征	本基金为混合基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 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
	(2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	53,334,904.28
2.本期利润	136,622,588.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.2551
4.期末基金资产净值	1,068,273,581.81
5.期末基金份额净值	1.482

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	23.19%	1.76%	8.23%	1.25%	14.96%	0.51%

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

易方达信息产业混合型证券投资基金
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
(2016 年 9 月 27 日至 2019 年 9 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 48.20%，同期业绩比较基准收益率为-10.64%。

§ 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		
郑希	本基金的基金经理、投资一部副总经理、研究部副总经理、投资经理、投资经理助理	2016-09-27	-	13 年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司研究部行业研究员、基金经理助理兼行业研究员、基金投资部基金经理助理、科瑞证券投资基金基金经理、易方达科瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值精选混合型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 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,通过投资交易系统内的公平交易模块,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 26 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。

4.4 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 年三季度 A 股市场整体呈现整体分化行情，沪深 300 指数下跌 0.29%，上证综指下跌 2.47%，中小板指数上涨 5.62%，中证 TMT 指数上涨 11.44%，创业板指数上涨 7.68%，创业板综指上涨 5.20%。三季度整体信用环境改善，但是由于中美贸易摩擦加剧以及对于经济预期趋于谨慎，周期性较强的行业表现一般；相反，以 TMT 为代表的新兴产业由于行业景气度明显提升，报告期内涨幅较为明显。

分析原因：

(1) 国内宏观经济层面：考虑到贸易战的影响逐步体现以及通胀压力的逐步出现，整体国内宏观环境不确定性在增大；

(2) 海外宏观经济层面：美国作为全球最大经济体，2019 年三季度经济数据开始回落，虽然有美联储货币政策的对冲预期，但是整体全球风险资产价格的波动性大幅提升；

(3) A 股资本市场流动性层面：2019 年三季度国内流动性相对宽松，海外资金的持续流入配置中国资产成为 A 股市场核心增量资金来源之一；与海外资金相关的“漂亮 50”指数以及行业景气度超预期的小市值成长股明显跑赢多数指数；

(4) TMT 产业层面：2019 年三季度信息产业内部出现明显分化，消费电子以及通信行业行业景气度明显超出预期，股价有较大幅度上涨，而与内需相关的软件行业表现相对稳定。

本基金在 2019 年三季度保持较高仓位，以信息产业的成长性投资品种为核心仓位，保持景气度不断提升的消费电子、通信等核心品种配置占比，并逐步增加

景气度正处于底部反转的钴、半导体行业的配置比例。

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 1.482 元，本报告期份额净值增长率为 23.19%，同期业绩比较基准收益率为 8.23%。

§ 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	855,985,561.78	77.94
	其中：股票	855,985,561.78	77.94
2	固定收益投资	22,628,523.10	2.06
	其中：债券	22,628,523.10	2.06
	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	187,419,183.12	17.06
7	其他资产	32,279,604.97	2.94
8	合计	1,098,312,872.97	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

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	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	678,534,532.16	63.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,139,240.40	0.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,366,489.75	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	161,662,273.27	15.13
J	金融业	4,795,876.20	0.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,701,150.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	3,786,000.00	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	855,985,561.78	80.13

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

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	002241	歌尔股份	3,121,918	54,883,318.44	5.14
2	600183	生益科技	1,928,200	48,089,308.00	4.50
3	300661	圣邦股份	263,900	45,266,767.00	4.24
4	603799	华友钴业	1,435,710	38,634,956.10	3.62
5	300502	新易盛	1,080,700	37,370,606.00	3.50
6	603986	兆易创新	233,200	33,902,616.00	3.17
7	002475	立讯精密	1,247,574	33,385,080.24	3.13
8	300496	中科创达	876,417	31,989,220.50	2.99
9	002938	鹏鼎控股	763,969	30,650,436.28	2.87
10	300253	卫宁健康	1,699,280	26,984,566.40	2.53

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	19,992,000.00	1.87
	其中：政策性金融债	19,992,000.00	1.87
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）	2,636,523.10	0.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,628,523.10	2.12

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	190302	19 进出 02	200,000	19,992,000.00	1.87
2	128047	光电转债	5,730	761,860.80	0.07
3	128035	大族转债	4,774	509,815.46	0.05
4	113517	曙光转债	4,000	454,680.00	0.04
5	128045	机电转债	2,909	333,022.32	0.03

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 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 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	275,287.58
2	应收证券清算款	5,339,258.21
3	应收股利	-
4	应收利息	306,371.60
5	应收申购款	26,358,687.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,279,604.97

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	128047	光电转债	761,860.80	0.07
2	128035	大族转债	509,815.46	0.05
3	113517	曙光转债	454,680.00	0.04
4	128045	机电转债	333,022.32	0.03
5	123003	蓝思转债	237,833.12	0.02
6	113021	中信转债	96,587.40	0.01

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	437,588,530.53
报告期基金总申购份额	564,077,951.49
减：报告期基金总赎回份额	280,948,669.53
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	720,717,812.49

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	99,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	99,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	13.87

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
机构	1	2019年07月01日~2019年07月	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	13.87%

		24 日					
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。</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信息产业混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达信息产业混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达信息产业混合型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

二〇一九年十月二十四日