

易方达科创板两年定期开放混合型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	易方达科创板两年定开混合
场内简称	易基科创、易方达科创板
基金主代码	506002
交易代码	506002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 28 日
报告期末基金份额总额	2,966,219,368.57 份
投资目标	本基金主要投资科创板上市企业，在控制风险的基础上，争取基金财产的长期增值。
投资策略	本基金基于对宏观经济走势及市场估值与流动性的分析，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。本基金主要投资科创板上市企业，本基金将遵循长期投资理念，挖掘优秀企业

	自身创造的价值和企业未来持续增长的投资机会，实现基金资产的长期增值。本基金既可以在二级市场买卖股票，也可以参与新股投资及战略配售等。本基金将通过对企业经营和核心竞争力、企业研发和创新能力、发展前景、公司治理、管理团队等因素的综合考虑，寻找具备突出竞争壁垒、良好商业模式、具备长期投资价值的公司。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。在债券投资方面，本基金将主要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	中国战略新兴产业成份指数收益率×65%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债总指数收益率×25%
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低于股票基金，高于债券基金和货币市场基金。本基金主要投资于科创板上市的股票，除了需要承担与证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临投资科创板股票的特殊风险，本基金投资科创板的风险详见招募说明书。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，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，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。
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 (2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	31,380,003.58
2.本期利润	844,180,479.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.2846
4.期末基金资产净值	3,608,467,192.26
5.期末基金份额净值	1.2165

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

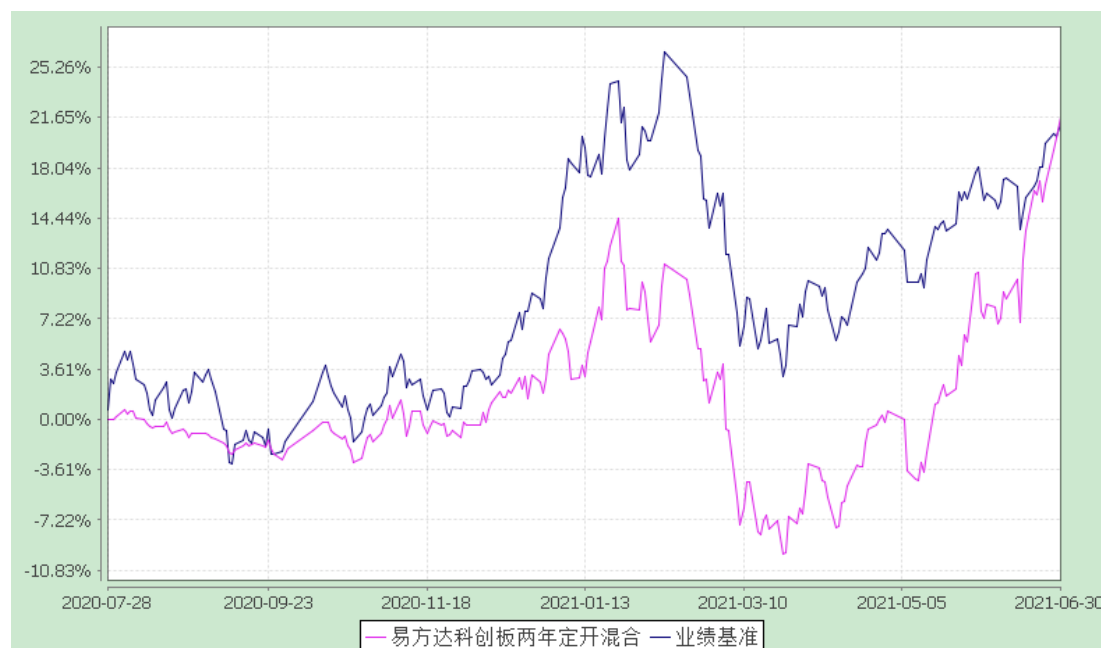
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	30.54%	1.54%	12.83%	1.04%	17.71%	0.50%
过去六个月	16.26%	1.68%	8.64%	1.40%	7.62%	0.28%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起	21.65%	1.29%	21.14%	1.22%	0.51%	0.07%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

易方达科创板两年定期开放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
(2020 年 7 月 28 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：1.本基金合同于 2020 年 7 月 28 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，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（第十三部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 21.65%，同期业绩比较基准收益率为 21.14%。

§ 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	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
郑希	本基金的基金经理、易方达信息行业精选股票型证券投资基金的基金经理、易方达信息产业混合型证券投资基金的基金经理、权益投资管理部副总经理、研究部副总经理	2020-07-28	-	15 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行业研究员、基金经理助理、投资经理、投资一部副总经理、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合规守信情况的说明

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 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年二季度沪深 300 指数上涨 3.48%，中小盘指数上升 9.23%，中证 TMT 指数上涨 11.67%，创业板指数上涨 26.05%，科创 50 指数上涨 27.23%。

二季度随着新冠疫苗的广泛使用，全球经济处于恢复阶段，大宗商品价格处于高位，通胀预期继续提升，但考虑到经济的长期成长性，全球流动性未进一步紧缩，市场整体风险有所下降，科创板为代表的成长资产具有较好的投资环境。

分析原因：

（1）国内宏观层面：宏观经济继续加速恢复，利率水平相对稳定，流动性环境相对宽松；

（2）海外宏观方面：流动性相对稳定，二季度长期利率上行压力不明显；

科创相关重点行业分析：

（1）半导体行业：设计领域以模拟、射频半导体为起点，逐步向数字芯片领域扩张；设备材料领域自主研发的产品逐步进入放量周期；

（2）军工等高端制造业：军工行业高端器件需求持续高增长，驱动产业内公司业绩持续高增长；

（3）光伏、新能源汽车行业：随着“碳中和”政策逐步落地，电动车、光伏行业景气程度持续超出预期，国内企业全球竞争力进一步提升，是最具韧性的成长性行业；

（4）医疗服务行业：疫情后线下医疗服务持续增长，具有长期业绩稳定性。

本基金在 2021 二季度保持中性仓位,提升了景气程度高的半导体、光伏、电动车等配置比例。

本基金二季度整体表现较好，我们将进一步优化组合，根据对行业景气程度的预判，提高组合行业集中度。展望 2021 年三季度，科技产业中半导体、新能源以及军工行业基本面相对清晰，但估值水平偏高，未来将合理调整组合的平均估值水平。

基于以上判断，2021 年三季度，本基金将整体立足中长期盈利成长性和稳定性的原则，维持以竞争优势明显、估值合理的信息产业投资标的为核心的持仓

结构,保持组合的流动性和稳定性,并在中小市值股票中寻找能穿越周期的个股。

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 1.2165 元,本报告期份额净值增长率为 30.54%,同期业绩比较基准收益率为 12.83%。

§ 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	3,229,080,913.43	89.34
	其中:股票	3,229,080,913.43	89.34
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	374,775,145.83	10.37
7	其他资产	10,559,926.59	0.29
8	合计	3,614,415,985.85	100.00

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 185,039,240.12 元,占净值比例 5.13%。

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	2,393,473,859.98	66.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,151,678.21	0.14
E	建筑业	11,014.44	0.00
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	627,944,854.53	17.40
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,425,545.05	0.48
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	3,044,041,673.31	84.36

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	95,392,813.10	2.64
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	385,086.62	0.01
信息技术	65,790,693.42	1.82
电信服务	23,470,646.98	0.65
公用事业	-	-
房地产	-	-

合计	185,039,240.12	5.13
----	----------------	------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	688390	固德威	563,735	188,287,490.00	5.22
2	688029	南微医学	535,211	166,819,916.59	4.62
3	688116	天奈科技	1,395,177	164,630,886.00	4.56
4	688408	中信博	790,000	158,632,000.00	4.40
5	688200	华峰测控	342,511	157,345,296.13	4.36
6	688208	道通科技	1,693,238	144,509,573.62	4.00
7	688122	西部超导	2,205,461	143,068,255.07	3.96
8	688083	中望软件	244,446	135,007,525.80	3.74
9	688608	恒玄科技	421,333	133,524,641.03	3.70
10	688111	金山办公	318,940	125,917,512.00	3.49

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 2021 年 3 月 31 日，镇江市应急管理局针对江苏天奈科技股份有限公司成品库二层有 2 吨硝酸铝未存放在危化品专用仓库的违法违规行，根据《危险化学品安全管理条例》第八十条第四项，给予责令改正，并处 5.75 万元人民币罚款的行政处罚。

本基金投资天奈科技的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除天奈科技外，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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	444,311.50
2	应收证券清算款	9,989,064.51
3	应收股利	87,978.00
4	应收利息	38,572.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,559,926.59

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	688200	华峰测控	45,078,046.75	1.25	询价转让 流通受限

2	688208	道通科技	35,490,400.00	0.98	大宗交易 流通受限
---	--------	------	---------------	------	--------------

注：根据《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，大股东减持或者特定股东减持，采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%；前款交易的受让方在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,966,219,368.57
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	2,966,219,368.57

§ 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达科创板两年定期开放混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达科创板两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达科创板两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件、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

二〇二一年七月二十日