

易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金

2022年第三季度报告

2022年09月30日

基金管理人:易米基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月21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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月20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2022年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易米国证消费100指数增强发起	
基金主代码	013926	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年11月11日	
报告期末基金份额总额	14,635,793.06份	
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对国证消费100指数进行有效跟踪的基础上，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过8%。	
投资策略	本基金主要投资策略为以国证消费100指数为标的指数，在有效复制标的指数、控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，结合定性和定量的选股方式对投资组合进行积极的管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的收益。	
业绩比较基准	国证消费100指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金属于指数增强型基金，跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	易米基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易米国证消费100指数增强发起A	易米国证消费100指数增强发起C

下属分级基金的交易代码	013926	013927
报告期末下属分级基金的份额总额	14,110,992.27份	524,800.79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(2022年07月01日 - 2022年09月30日)	
	易米国证消费100指数增强发起A	易米国证消费100指数增强发起C
1. 本期已实现收益	-3,592.82	-779.82
2. 本期利润	-2,179,323.98	-80,546.77
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1566	-0.1563
4. 期末基金资产净值	11,988,584.88	444,301.66
5. 期末基金份额净值	0.8496	0.8466

注：1. 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；
2. 本报告所列示的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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

易米国证消费100指数增强发起A净值表现

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	-15.54%	0.92%	-16.69%	0.98%	1.15%	-0.06%
过去六个月	-6.65%	1.11%	-9.06%	1.36%	2.41%	-0.25%
自基金合同生效起至今	-15.04%	0.93%	-27.59%	1.37%	12.55%	-0.44%

易米国证消费100指数增强发起C净值表现

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	-15.63%	0.92%	-16.69%	0.98%	1.06%	-0.06%
过去六个月	-6.83%	1.11%	-9.06%	1.36%	2.23%	-0.25%
自基金合同生效起至今	-15.34%	0.93%	-27.59%	1.37%	12.25%	-0.44%

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

易米国证消费100指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年11月11日-2022年09月30日)



易米国证消费100指数增强发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年11月11日-2022年09月30日)



§ 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	证券	说明
----	----	-----------	----	----

		期限		从业 年限	
		任职日期	离任 日期		
王磊	本基金基金经理	2021-11-11	-	14	王磊先生，南京大学硕士。曾任华泰证券股份有限公司投资银行部项目经理，国金证券股份有限公司行业研究员，太平洋资产管理有限责任公司高级研究员、权益投资副总裁，凯石基金管理有限公司研究副总监、基金经理，现任易米基金管理有限公司研究部总监、基金经理。
俞科进	本基金基金经理	2022-05-24	-	14	俞科进先生，南开大学硕士。曾任中国人保寿险股份有限公司员工，长江证券股份有限公司研究所金工分析师，中邮创业基金管理股份有限公司历任金融工程研究员、量化投资部副总经理、基金经理，上海集元资产管理有限公司合规风控负责人，现任易米基金管理有限公司多策略投资部总监、基金经理。

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3. 本基金无基金经理助理。

4. 本基金本报告期内没有基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定，无违法、违规行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《易米基金管理有限公司公平交易制度》和《易米基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。本基金管理人通过建立科学的公平交易体系，将公平交易理念贯彻投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评价等环节，确保各个投资组合享有公平的投资决策机会。本报告期内公司旗下基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

报告期内，本基金管理人整体公平交易制度执行情况良好，未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人旗下管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情形。

报告期内，本基金管理人未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内，全球市场受俄乌战争影响，通胀高企不下，发达国家特别是美国加息频率及力度持续超预期，一定程度上制约了国内货币政策空间。另外，受疫情持续影响，国内市场出现断供潮蔓延趋势，而纾困资金低于预期，投资者整体风险偏好较低。国证消费100指数成份股几大板块中，居民消费信心不足，日常消费难有起色；新能源车销量不断超预期，但渗透率到了瓶颈阶段，竞争趋于蓝海；光伏板块由于持续高温导致电力供应紧张，进一步制约硅料供应，细分行业领先者为了维持产业链优势地位，向上下游扩张拉低行业整体利润空间。另外，受俄乌战争影响，欧洲传统能源供给再受冲击，无奈暂时提升传统能源比例，导致海外市场光伏装机预期下调。板块长期景气不减，但短期回调影响边际增量资金配置；消费电子受整体经济环境影响，增长乏力，板块继续低迷。综上所述，国证消费100指数本季度下跌17.50%。

本基金以国证消费100指数为目标指数，综合运用各种指数增强方法从广度和深度两个方面同时提高组合收益风险比，力争获取超额回报。本报告期内，本基金根据市场环境变化逐步提高了股票资产占比，并在对市场风格研判的基础上，同步提升了增量持仓当中价值和成长风格占比。在微盘股表现相对占优的情况下，考虑到基金规模限制，基金管理人严格控制了市值风险敞口，主要通过板块内的细分板块之间的高配低配及轮动来获取相对板块的超额收益。

投资策略方面，本基金作为指数增强型基金，将在持续对目标指数进行有效跟踪的基础上，通过综合运用各种指数增强方法，力争在控制跟踪误差的同时为投资者提供高于业绩比较基准的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末易米国证消费100指数增强发起A基金份额净值为0.8496元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.54%，同期业绩比较基准收益率为-16.69%；截至报

告期末易米国证消费100指数增强发起C基金份额净值为0.8466元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.63%，同期业绩比较基准收益率为-16.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无应说明的预警信息。

§ 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	11,596,712.40	92.84
	其中：股票	11,596,712.40	92.84
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	507,343.84	4.06
	其中：债券	507,343.84	4.06
	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	312,593.92	2.50
8	其他资产	74,489.59	0.60
9	合计	12,491,139.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	478,093.00	3.85
B	采矿业	45,176.00	0.36
C	制造业	8,621,961.25	69.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	81,219.00	0.65
E	建筑业	21,088.00	0.17
F	批发和零售业	70,152.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	293,280.00	2.36
H	住宿和餐饮业	57,650.00	0.46
I	信息传输、软件和信息技术服务业	585,321.20	4.71

J	金融业	310,667.00	2.50
K	房地产业	223,274.00	1.80
L	租赁和商务服务业	97,152.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	443,170.00	3.56
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	203,126.95	1.63
R	文化、体育和娱乐业	65,382.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	11,596,712.40	93.27

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	000858	五粮液	3,400	575,382.00	4.63
2	601012	隆基绿能	11,420	547,132.20	4.40
3	000333	美的集团	10,500	517,755.00	4.16
4	600887	伊利股份	12,500	412,250.00	3.32
5	002594	比亚迪	1,500	378,015.00	3.04
6	000568	泸州老窖	1,400	322,924.00	2.60
7	600276	恒瑞医药	8,500	298,350.00	2.40
8	002475	立讯精密	10,000	294,000.00	2.36
9	002714	牧原股份	5,000	272,600.00	2.19
10	300760	迈瑞医疗	900	269,100.00	2.16

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	507,343.84	4.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	507,343.84	4.08
----	----	------------	------

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	019629	20国债03	5,000	507,343.84	4.08

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持有股指期货。

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持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 立讯精密（股票代码：002475）为本基金前十大持仓股票之一。2021年12月28日，深圳证券交易所因立讯精密披露的《关于调整2018年股票期权激励计划行权数量及注销部分股票期权的公告》中的数据不准确，导致立讯精密在办理相关期权注销及登记业务时出现错误的情形，出具了监管函。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未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	73,200.20
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—

5	应收申购款	1,289.39
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	74,489.59

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流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	易米国证消费100指数 增强发起A	易米国证消费100指数 增强发起C
报告期期初基金份额总额	13,653,689.71	484,734.85
报告期期间基金总申购份额	568,073.80	121,092.00
减：报告期期间基金总赎回份额	110,771.24	81,026.06
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	14,110,992.27	524,800.79

§ 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，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人 自有资金	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
基金管理人 高级管理人员	10,080,504.80	68.88%	10,080,504.80	68.88%	自合同生 效之日起

					不少于三年
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	—
合计	10,080,504.80	68.88%	10,080,504.80	68.88%	—

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2022.7.1-2022.9.30	5,080,304.80	—	—	5,080,304.80	34.71%
	2	2022.7.1-2022.9.30	5,000,200.00	—	—	5,000,200.00	34.16%
产品特有风险							
1. 净值大幅波动的风险 由于本基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该投资者大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。 2. 出现巨额赎回的风险 该投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。其他投资者的赎回申请也可能同时面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。 3. 基金规模过小的风险 根据基金合同的约定，基金合同生效满3年后继续存续的，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案。该投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5,000万元情形。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件；
2. 《易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《易米国证消费100指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；

6. 基金托管人业务资格批件、营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人及基金托管人的办公场所。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

易米基金管理有限公司
2022年10月21日