

易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

金

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十一日

§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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 19 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 2023 年 1 月 18 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	易方达中证 1000ETF 联接
基金主代码	016630
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 1 月 18 日
报告期末基金份额总额	628,109,530.34 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达中证 1000ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证 1000ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、股票投资策

	略、存托凭证投资策略、债券和货币市场工具投资策略、股指期货和股票期权投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资业务策略等。	
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于易方达中证 1000ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 1000 指数的表现密切相关。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 1000ETF 联接 A	易方达中证 1000ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	016630	016631
报告期末下属分级基金的份额总额	477,145,866.98 份	150,963,663.36 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159633
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 28 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 8 月 4 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	国泰君安证券股份有限公司
---------	--------------

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，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的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。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。

§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 (2023 年 1 月 18 日 (基金合同生效日) -2023 年 3 月 31 日)	
	易方达中证 1000ETF 联接 A	易方达中证 1000ETF 联接 C
1.本期已实现收益	-362,055.73	379,427.36
2.本期利润	-3,212,253.26	-773,132.70

3.加权平均基金份额本期利润	-0.0097	-0.0024
4.期末基金资产净值	468,290,643.26	148,074,161.94
5.期末基金份额净值	0.9814	0.9809

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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2023年1月18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

易方达中证 1000ETF 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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.86%	0.64%	4.02%	0.81%	-5.88%	-0.17%

易方达中证 1000ETF 联接 C:

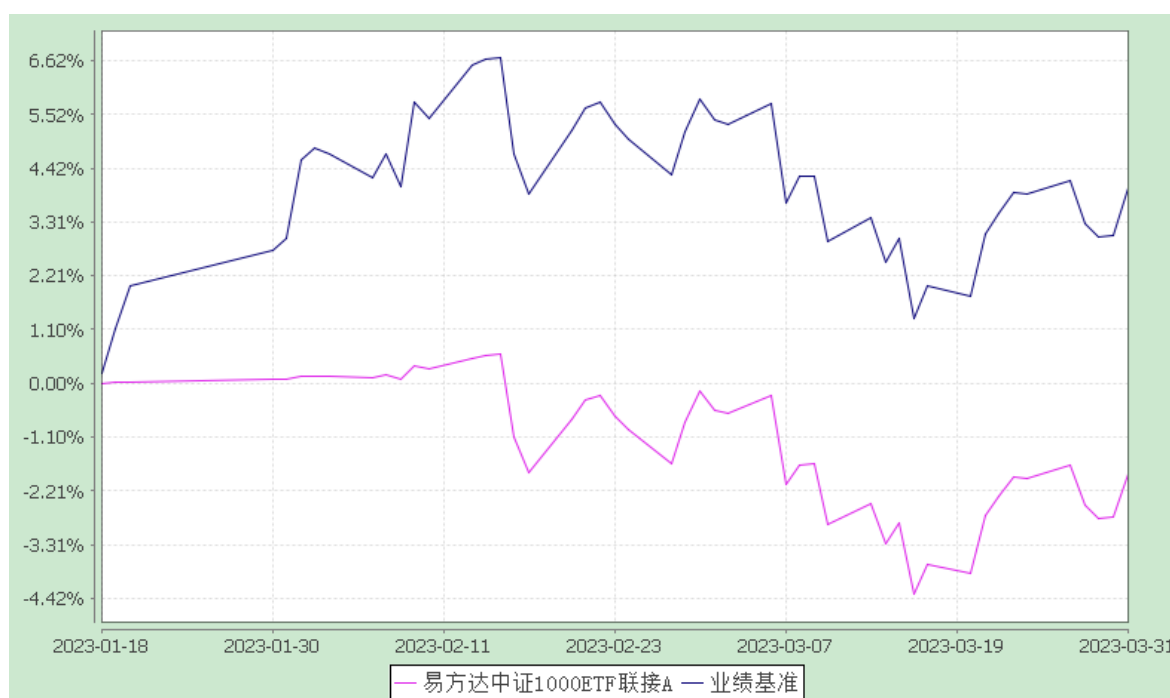
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个	-	-	-	-	-	-

月						
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.91%	0.64%	4.02%	0.81%	-5.93%	-0.17%

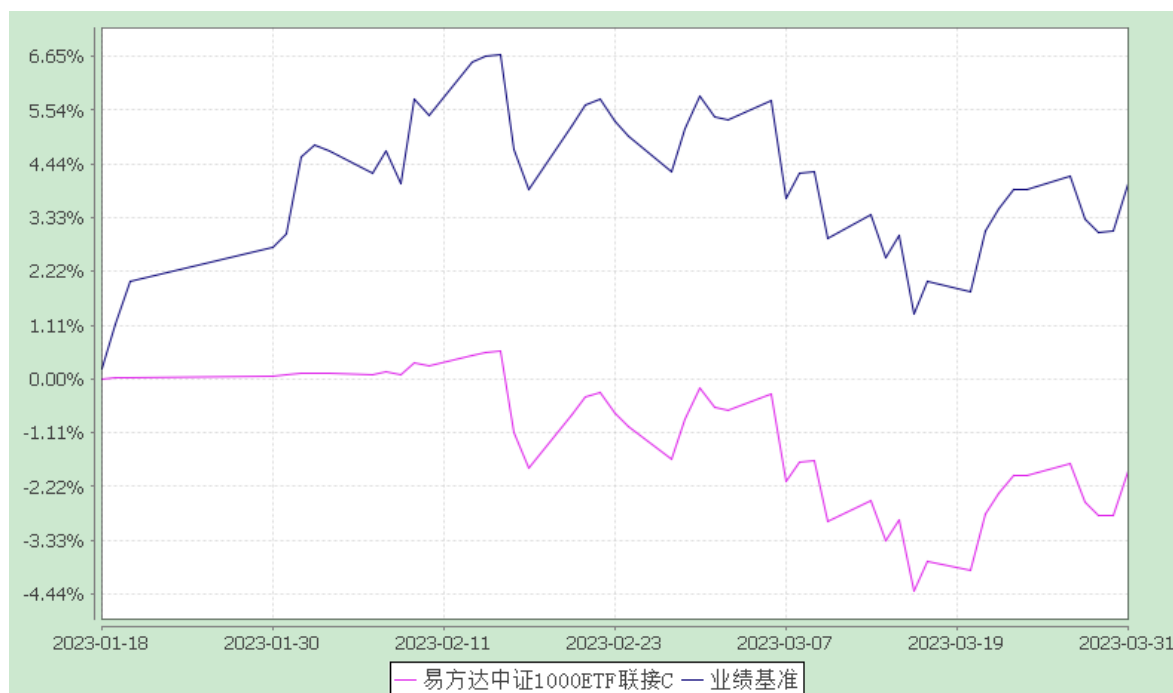
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中证 1000 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
 (2023 年 1 月 18 日至 2023 年 3 月 31 日)

易方达中证 1000ETF 联接 A:



易方达中证 1000ETF 联接 C:



注：1.本基金合同于 2023 年 1 月 18 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。本报告期本基金处于建仓期内。

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-1.86%，同期业绩比较基准收益率为 4.02%；C 类基金份额净值增长率为-1.91%，同期业绩比较基准收益率为 4.02%。

§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，易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方	2023-01-18	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。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

	达创业板 ETF、易方达中小企业 100 指数 (LOF)、易方达中证万得并购重组指数 (LOF)、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达香港恒生综合小型股指数 (QDII-LOF)、易方达上证中盘 ETF、易方达中证 800ETF、易方达中证 800ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达中证银行指数 (LOF)、易方达中证银行 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF、易方达中证 1000ETF、易方达中证港股通消费主题 ETF 联接发起式的基金经理，易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理助理				部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员，易方达深证成指 ETF 联接、易方达深证成指 ETF、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII)、易方达中证浙江新动能 ETF(QDII)的基金经理。
庞亚平	本基金的基金经理，易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达沪深 300ETF 发起式联接、易方达沪深 300ETF 发起式、易方达中证 500ETF 联接发起式、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证 1000ETF 的基金经理，指数研究部总经理	2023-02-15	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管，华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量投资部总监。

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行业协会相关规定。

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、决策流程和交易流程，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 8 次，其中 6 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，2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为易方达中证 1000ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资于易方达中证 1000ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达中证 1000ETF 跟踪中证 1000 指数，该指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后，规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。

2023 年一季度初，随着制约市场和经济的疫情因素大幅缓解，各项消费活动的回暖提振了市场对经济修复的信心，A 股市场修复行情延续。2 月份以来，国内经济数据的复苏斜率有所放缓，海外部分银行风险事件对 A 股市场投资者风险偏好带来一定冲击，A 股市场波动加大，各行业板块表现分化的特征较为突出。3 月中，受海外金

融风险边际缓和影响，市场担忧情绪有所降温。此外，央行超市场预期的降准，释放了“稳经济”积极信号，缓解了市场对流动性和政策取向的担忧，A 股市场整体走势震荡向上。2023 年一季度，沪深 300 指数上涨 4.63%，中证 500 指数上涨 8.11%，中证 1000 指数上涨 9.46%。

中证 1000 指数具有以下四大特点：一是小盘风格。中证 1000 指数的成份股分布以小盘股为主。截至 2023 年一季度末，中证 1000 指数成份股平均市值在 120 亿元左右，是综合反映 A 股市场上小市值公司的股票价格表现的代表性指数，代表的是小盘股风格。二是行业分布较为均衡。中证 1000 指数成份股覆盖了 31 个申万一级行业，权重占比最高的五大行业分别是医药生物、电子、电力设备、计算机、基础化工，权重合计 46% 左右，权重占比最大的医药生物行业占比 12%，成份股行业权重分布较为均衡。三是成份股权重较为分散，权重集中度低。中证 1000 指数成份股权重最大的不超过 1%，前十大成份股权重合计不超过 4%，成份股集中度低于其他主流宽基指数。四是指数走势波动较大。2022 年二季度初至 2023 年一季度末，沪深 300 指数、中证 500 指数与中证 1000 指数的年化波动率分别为 18.1%、19.3%、22.6%，中证 1000 指数的波动性显著高于其他主流宽基指数。投资者在进行指数基金投资时应充分了解指数的特点，并选择与自身风险承受能力相匹配的产品。

本报告期内本基金仍处于建仓期，建仓期间内本基金采取相对灵活以及审慎的建仓策略，在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下进行基金的建仓工作。

4.5 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 0.9814 元，本报告期份额净值增长率为-1.86%，同期业绩比较基准收益率为 4.02%；C 类基金份额净值为 0.9809 元，本报告期份额净值增长率为-1.91%，同期业绩比较基准收益率为 4.02%。受建仓期影响，年化跟踪误差 6.06%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	13,648.00	0.00
	其中：股票	13,648.00	0.00
2	基金投资	562,625,274.95	90.96
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	43,174,232.11	6.98
8	其他资产	12,713,379.90	2.06
9	合计	618,526,534.96	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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	562,625,274.95	91.28

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

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	4,224.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,216.00	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	6,208.00	0.00
J	金融业	-	-
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	-	-
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	13,648.00	0.00

5.4 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

5.4.1 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	002261	拓维信息	400	6,208.00	0.00
2	301039	中集车辆	400	4,224.00	0.00

3	000090	天健集团	600	3,216.00	0.00
---	--------	------	-----	----------	------

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

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IM2309	IM2309	14	18,816,560.00	-256,303.85	在本报告期内,基金利用股指期货进行套期保值操作,以应对基金由于大额净申赎等需要及时调整组合市场暴露情况时,通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险对冲需求,利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

公允价值变动总额合计(元)	-256,303.85
股指期货投资本期收益(元)	-501,460.71
股指期货投资本期公允价值变动(元)	-256,303.85

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。本基金在出现大额净申赎等需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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

5.12.1 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，成都新易盛通信技术股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国锦城海关的处罚。江西特种电机股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会江西监管局的处罚。

本基金为目标 ETF 的联接基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体出现本期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。基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,157,190.04

2	应收证券清算款	13,944.44
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,574,766.47
6	其他应收款	7,967,478.95
7	其他	-
8	合计	12,713,379.90

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

项目	易方达中证1000ETF 联接A	易方达中证1000ETF 联接C
基金合同生效日基金份额总额	416,909,851.98	692,141,047.83
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	262,187,770.89	31,216,546.77
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	201,951,755.89	572,393,931.24
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	477,145,866.98	150,963,663.36

注：本基金合同生效日为2023年1月18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	2023年03月29日~2023年03月31日	0.00	215,361,501.38	0.00	215,361,501.38	34.29%
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中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的文件；
2. 《易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
3. 《易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

- 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
二〇二三年四月二十一日