易方达中小板指数分级证券投资基金

2019年第二季度报告

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:二〇一九年七月十九日

§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。

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日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中小板指数分级
基金主代码	161118
交易代码	161118
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月20日
报告期末基金份额总额	976,439,535.88份
投资目标	本基金采取指数化投资方式,以实现对业绩比较基准的紧密跟踪,追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法进行投资,因按照中小板价格指数的成份股组成及权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整,以实现对业绩比较基准的紧密跟踪,追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中小板价格指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券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、以及标的指数所代表的股票市场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	中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	易方达中小板指数分级	易方达中小板指数分级A	易方达中小板指数分级B
下属分级基金的场内简称	易基中小	中小A	中小B
下属分级基金的交易代码	161118	150106	150107
报告期末下属分级基金的份额总额	179,421,362.88份	398,509,086.00份	398,509,087.00份
下属分级基金的风险收益特征	高预期风险、相对较高预期收益。	低预期风险、相对预期收益稳定。	高预期风险、相对高预期收益。

§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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	355,634.76
2.本期利润	-84,752,323.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0882
4.期末基金资产净值	804,144,311.08
5.期末基金份额净值	0.8235

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。

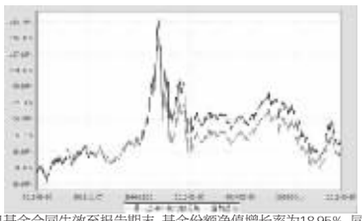
3.2 基金净值表现

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	-9.94%	1.74%	-10.42%	1.74%	0.48%	0.00%

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

易方达中小板指数分级证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年9月20日至2019年6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18.95%,同期业绩比较基准收益率为31.76%。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
成曦	本基金的基金经理、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、易方达沪深300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、易方达沪深300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发起式联接基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2016-05-07	-	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。
刘树荣	本基金的基金经理、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、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、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、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达证券指数分级证券投资基金的基金经理、易方达证券指数分级证券投资基金的基金经理、易方达证券