

# 易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）

## 2021 年第 3 季度报告

2021 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：二〇二一年十月二十七日

## §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 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)
场内简称	标普 500LOF
基金主代码	161125
交易代码	161125
基金运作方式	契约型、上市开放式 (LOF)
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 日
报告期末基金份额总额	327,142,063.49 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法进行投资，即参考标的指数的成份股组成及权重构建股票投资组合，并根据标的指数的成份股组成及权重变动对股票投资组合进行相应调整，力争将年化跟踪误差控制在

	4% 以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35% 以内，主要投资策略包括资产配置策略、权益类品种投资策略、固定收益品种和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略等。	
业绩比较基准	标普 500 指数收益率（使用估值汇率折算）×95%+活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金属股票指数基金，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。本基金主要采用组合复制策略和适当的替代性策略实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要投资美国证券市场，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
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	
境外投资顾问	英文名称：无	
	中文名称：无	
境外资产托管人	英文名称：State Street Bank and Trust Company	
	中文名称：道富银行	
下属分级基金的基金简称	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) A	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) C
下属分级基金的交易代码	161125	012860
报告期末下属分级基金的份额总额	326,221,255.34 份	920,808.15 份

注：本基金A类人民币份额及A类美元份额由原易方达标普500指数 (QDII-LOF) 变更而来，并于2021年7月19日起增设C类人民币份额及C类美元份额，份额首次确认日为2021年7月20日。易方达标普500指数 (QDII-LOF) A 含A类人民币份额(份额代码：161125)及A类美元现汇份额(份额代码：003718)，交易代码仅列示A类人民币份额代码；易方达标普500指数 (QDII-LOF) C含C类

人民币份额（份额代码：012860）及C类美元现汇份额（份额代码：012861），交易代码仅列示C类人民币份额代码。

### §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7月1日-2021年9月30日)	
	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) A	易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) C
1.本期已实现收益	3,352,965.98	2,740.30
2.本期利润	2,761,484.46	-45,889.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0087	-0.2308
4.期末基金资产净值	566,686,237.44	1,600,932.49
5.期末基金份额净值	1.7371	1.7386

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.自2021年7月19日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2021年7月20日，增设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

###### 易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) 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	0.67%	0.68%	0.61%	0.66%	0.06%	0.02%
过去六个月	6.72%	0.71%	6.67%	0.70%	0.05%	0.01%
过去一年	20.97%	0.86%	20.85%	0.86%	0.12%	0.00%
过去三年	37.91%	1.46%	37.67%	1.42%	0.24%	0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	73.71%	1.22%	80.25%	1.19%	-6.54%	0.03%

### 易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) 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	1.58%	0.66%	1.33%	0.64%	0.25%	0.02%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF)

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

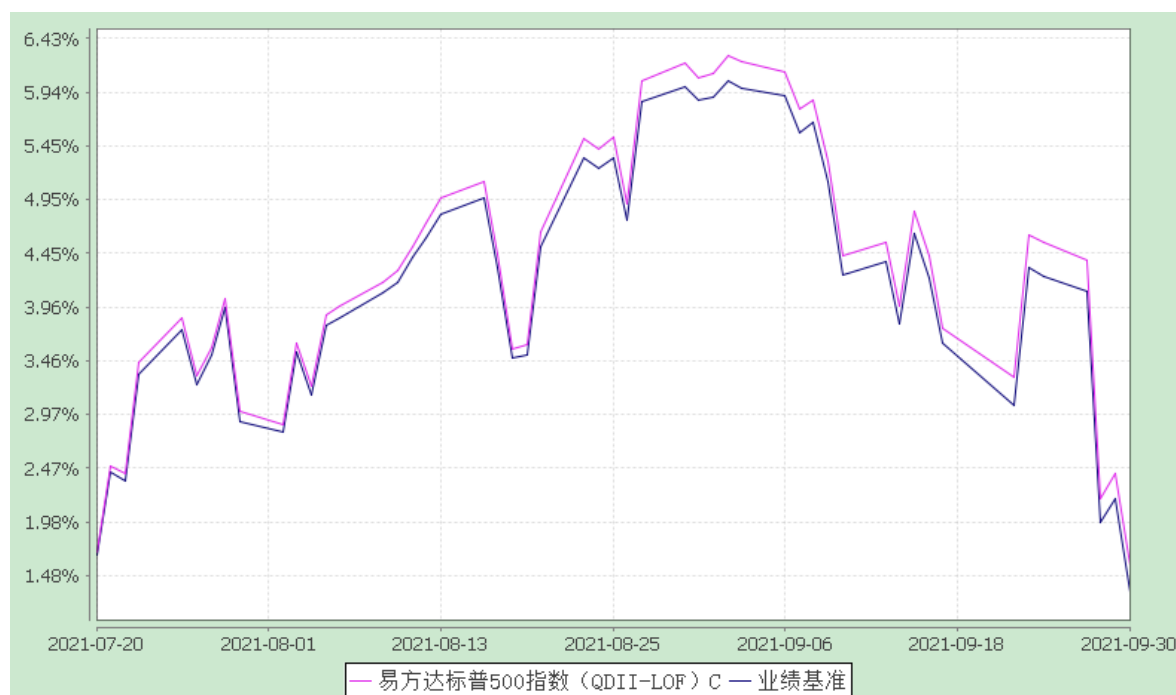
易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) A

(2016 年 12 月 2 日至 2021 年 9 月 30 日)



易方达标普 500 指数 (QDII-LOF) C

(2021 年 7 月 20 日至 2021 年 9 月 30 日)



注: 1.自2021年7月19日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2021年7月20日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

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73.71%,同期业

绩比较基准收益率为80.25%；C类基金份额净值增长率为1.58%，同期业绩比较基准收益率为1.33%。

## §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		
FAN BING (范 冰)	本基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达原油证券投资基金 (QDII) 的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网 50 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 MSCI 中国 A 股国际通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、易方达日兴资管日经 225 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理、易方达中证香港证券投资主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 的基金经理、指数投资决策委员会委员	2017-03-25	-	16 年	新加坡籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任皇家加拿大银行托管部核算专员，美国道富集团中台交易支持专员，巴克莱资产管理公司悉尼金融数据部高级金融数据分析员、悉尼金融数据部主管、新加坡金融数据部主管，贝莱德集团金融数据运营部部门经理、风险控制与咨询部客户经理、亚太股票指数基金部基金经理，易方达基金管理有

					限公司易方 达标普全球 高端消费品 指数增强型 证券投资基 金基金经 理、易方达 标普医疗保 健指数证券 投资基金 (LOF) 基 金经理、易 方达标普生 物科技指数 证券投资基 金 (LOF) 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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

#### 4.4 公平交易专项说明

##### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、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相应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，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规



范交易委托方式,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。

#### 4.4.2 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 5 次,其中 3 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。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

回顾 2021 年三季度,美国新冠疫情新感染病例出现明显抬升,美国延续经济重启的进程,但 GDP 增长预期有所放缓。在企业盈利预期的推动下,美股继续走高。在 9 月的 FOMC 议息会议上,美联储维持利率水平不变,但是传递了较为强烈的减量可能很快开始的信号,同时大幅上调了对于今年通胀的预测,并下调了对于经济增长的预测。由于鹰派的美联储信号,叠加不断攀升的油价和对于拜登税法改革不确定性的担忧,美股 9 月份以来出现明显回调,市场风格开始从周期转向防守。

作为追踪标普 500 指数的被动式海外指数基金,本基金采用完全复制法,力求追踪误差最小化。

截至报告期末,本基金 A 类基金份额净值为 1.7371 元,本报告期份额净值增长率为 0.67%,同期业绩比较基准收益率为 0.61%;C 类基金份额净值为 1.7386 元,本报告期份额净值增长率为 1.58%,同期业绩比较基准收益率为 1.33%,年化跟踪误差 0.38%,各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

## §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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	517,026,982.46	88.49

	其中：普通股	504,285,335.10	86.31
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	12,741,647.36	2.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	60,722,406.69	10.39
8	其他资产	6,529,445.54	1.12
9	合计	584,278,834.69	100.00

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	517,026,982.46	90.98
合计	517,026,982.46	90.98

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	14,184,776.23	2.50

材料	12,764,271.35	2.25
工业	41,298,672.60	7.27
非必需消费品	63,889,115.80	11.24
必需消费品	29,817,641.73	5.25
保健	68,452,315.20	12.05
金融	58,757,759.39	10.34
信息技术	143,483,223.06	25.25
电信服务	58,591,506.63	10.31
公用事业	12,583,854.74	2.21
房地产	13,203,845.73	2.32
合计	517,026,982.46	90.98

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

#### 5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

##### 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代 码	所在 证 券 市 场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值(人 民币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	Apple Inc	-	AAPL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	34,518	31,676,619.76	5.57
2	Microsoft Corp	-	MSFT US	纳斯达克 证券交易 所	美国	16,518	30,200,916.02	5.31

				所				
3	Alphabet Inc	-	GOOGL US	纳斯达克 证券交易 所	美国	661	11,460,977.61	2.02
			GOOG US	纳斯达克 证券交易 所	美国	619	10,699,787.31	1.88
4	Amazon.com Inc	-	AMZN US	纳斯达克 证券交易 所	美国	957	20,388,692.08	3.59
5	Facebook Inc	-	FB US	纳斯达克 证券交易 所	美国	5,239	11,531,457.63	2.03
6	Tesla Inc	-	TSLA US	纳斯达克 证券交	美国	1,783	8,967,238.32	1.58

				易所				
7	NVIDIA Corp	-	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	5,477	7,358,434.20	1.29
8	Berkshire Hathaway Inc	-	BRK/B US	纽约证券交易所	美国	4,074	7,211,489.56	1.27
9	JPMorgan Chase & Co	-	JPM US	纽约证券交易所	美国	6,568	6,972,556.79	1.23
10	Johnson & Johnson	-	JNJ US	纽约证券交易所	美国	5,786	6,060,210.69	1.07

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

#### 5.5 报告期末按债券信用等级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金融衍生品投资明细

序号	衍生品类 别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	股指期货	S&P500 EMINI FUT Dec21	-	-

注：按照期货每日无负债结算的结算规则,根据《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定,“其他衍生工具-期货投资”与“证券清算款-期货每日无负债结算暂收暂付款”,符合金融资产与金融负债相抵销的条件,故将“其他衍生工具-期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报,净额为零。期货投资的公允价值变动金额为-795,395.70元,已包含在结算备付金中。

## 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十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

## 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中, Facebook 在本报告期内曾被欧盟委员会、英国反垄断委员会调查。谷歌在报告编制日前一年内曾受到韩国公平贸易委员会、意大利反垄断机构、法国竞争管理局和法国国家信息与自由委员会的处罚。谷歌在本报告期内曾被欧盟委员会反垄断调查。摩根大通在报告编制日前一年内曾受到美国货币监理署的处罚。苹果公司在报告编制日前一年内曾受到美国得克萨斯州联邦的处罚。苹果公司在本报告期内曾被印度竞争委员会调查。特斯拉在本报告期内曾被美国国家公路交通安全管理局、德国环境部调查。亚马逊公司在报告编制日前一年内曾受到法国国家信息与自由委员会、美国联邦贸易委员会和卢森堡数据保护委员会的处罚。亚马逊公司在本报告期内曾被美国联邦贸易委员会调查。

本基金投资的前十名证券中,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,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。

5.10.2 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。

## 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	2,092,027.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	280,307.76
4	应收利息	3,744.57
5	应收申购款	4,153,365.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,529,445.54

## 5.10.4 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。

## 5.10.5 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	易方达标普500指数 (QDII-LOF) A	易方达标普500指数 (QDII-LOF) C
报告期期初基金份额总额	302,022,211.59	-
报告期期间基金总申购份额	66,332,654.72	961,206.87
减：报告期期间基金总赎回份额	42,133,610.97	40,398.72
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	326,221,255.34	920,808.15

注：本基金A类人民币份额及A类美元份额由原易方达标普500指数(QDII-LOF)人民币份额及美元份额变更而来，并于2021年07月19日起增设C类人民币份额及

C类美元份额，本报告期的相关数据按实际存续期计算。易方达标普500指数（QDII-LOF）A份额变动含A类人民币份额及A类美元份额；易方达标普500指数（QDII-LOF）C份额变动含C类人民币份额及C类美元份额。

## §7 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标普 500 指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
- 2.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《易方达标普 500 指数证券投资基金（LOF）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和营业执照。

### 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

二〇二一年十月二十七日