

易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）

2024 年第 3 季度报告

2024 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：二〇二四年十月二十五日

§ 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 2024 年 10 月 23 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）
场内简称	标普生物科技 LOF
基金主代码	161127
交易代码	161127
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 13 日
报告期末基金份额总额	224,624,565.30 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	本基金主要采取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	标普生物科技精选行业指数收益率(使用估值汇率折算) $\times 95\%$ +活期存款利率(税后) $\times 5\%$	
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	易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）A	易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）C
下属分级基金的交易代码	161127	012866
报告期末下属分级基金的份额总额	222,939,975.55 份	1,684,589.75 份

注：1.自2021年7月23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26日。

2.易方达标普生物科技指数(QDII-LOF)A含A类人民币份额(份额代码:161127)及A类美元现汇份额(份额代码:003720)，交易代码仅列示A类人民币份额代码；易方达标普生物科技指数(QDII-LOF)C含C类人民币份额(份额代

码:012866)及C类美元现汇份额(份额代码:012867),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 (2024年7月1日-2024年9月30日)	
	易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）A	易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）C
1.本期已实现收益	8,157,499.44	59,428.49
2.本期利润	13,362,433.04	107,737.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0585	0.0603
4.期末基金资产净值	315,231,797.14	2,355,945.08
5.期末基金份额净值	1.4140	1.3985

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。

3.2 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

易方达标普生物科技指数（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	4.21%	1.35%	4.68%	1.36%	-0.47%	-0.01%
过去六个	2.23%	1.52%	2.78%	1.55%	-0.55%	-0.03%

月						
过去一年	28.89%	1.73%	30.55%	1.75%	-1.66%	-0.02%
过去三年	-15.94%	2.08%	-13.29%	2.12%	-2.65%	-0.04%
过去五年	21.03%	2.15%	29.33%	2.18%	-8.30%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.40%	2.00%	64.85%	2.03%	-23.45%	-0.03%

易方达标普生物科技指数（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	4.11%	1.36%	4.68%	1.36%	-0.57%	0.00%
过去六个月	2.04%	1.52%	2.78%	1.55%	-0.74%	-0.03%
过去一年	28.43%	1.73%	30.55%	1.75%	-2.12%	-0.02%
过去三年	-16.92%	2.08%	-13.29%	2.12%	-3.63%	-0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-17.24%	2.06%	-13.52%	2.10%	-3.72%	-0.04%

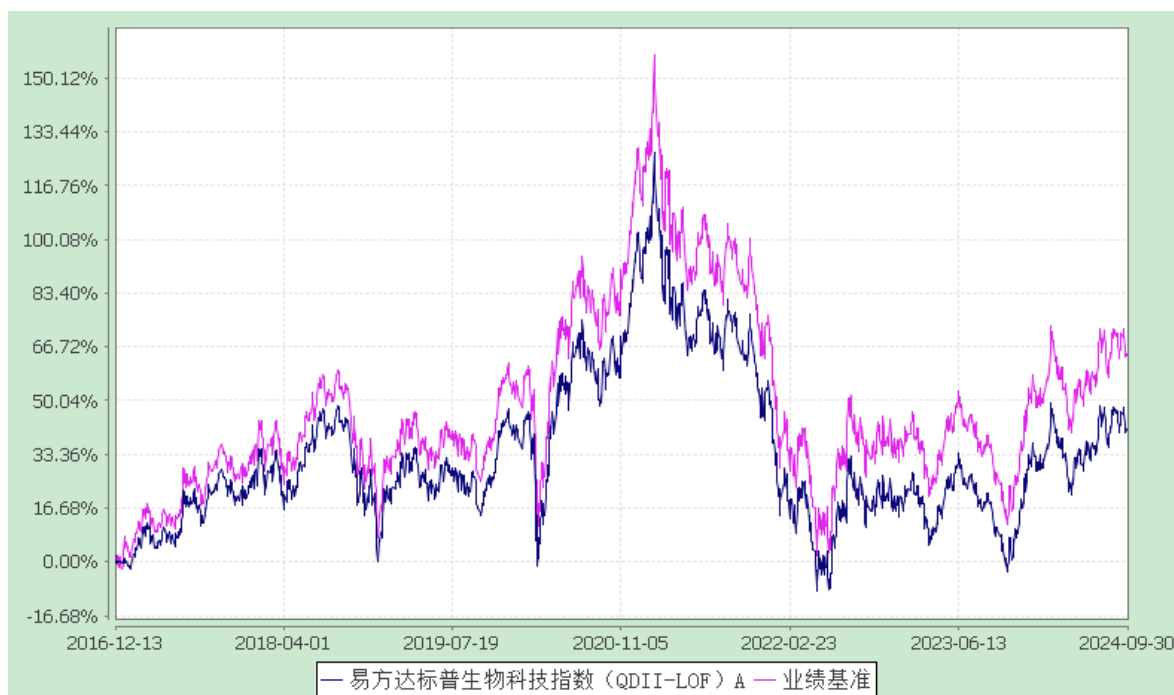
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达标普生物科技指数证券投资基金（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

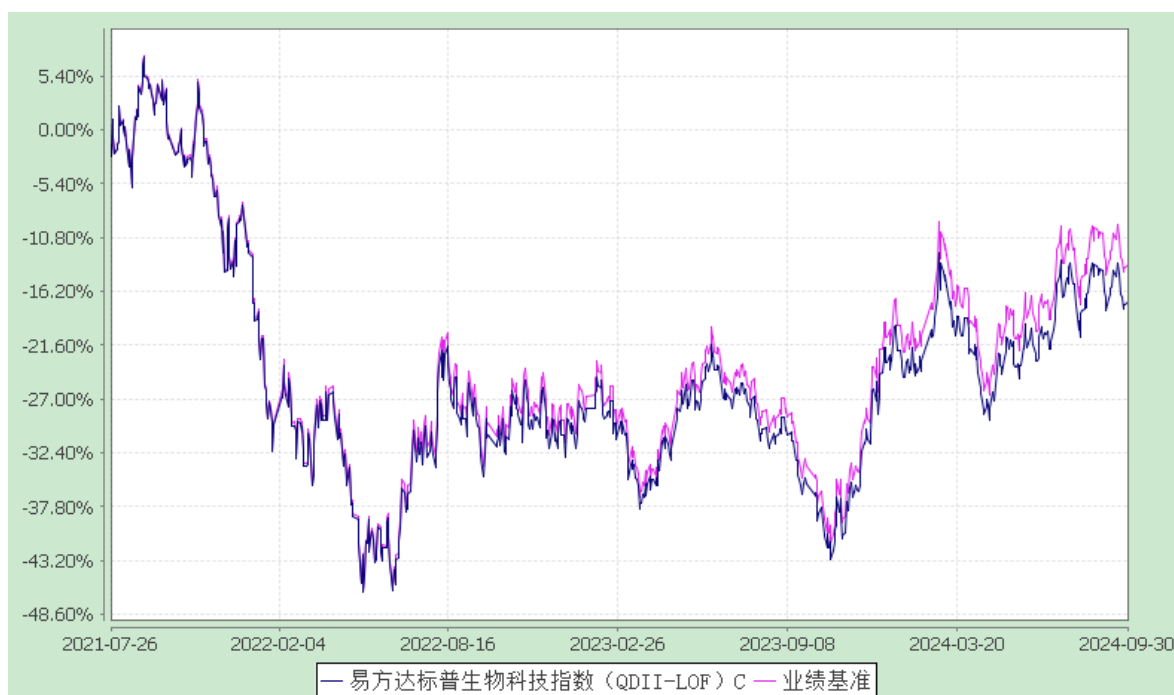
易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）A

（2016年12月13日至2024年9月30日）



易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）C

（2021年7月26日至2024年9月30日）



注：1.自2021年7月23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26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41.40%，同期业

绩比较基准收益率为64.85%；C类基金份额净值增长率为-17.24%，同期业绩比较基准收益率为-13.52%。

§ 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		
宋钊贤	本基金的基金经理，易方达MSCI中国A股国际通ETF联接发起式、易方达中证红利ETF联接发起式、易方达MSCI中国A股国际通ETF、易方达中证红利ETF、易方达中证国有企业改革指数（LOF）、易方达上证50指数（LOF）、易方达标普医疗保健指数（QDII-LOF）、易方达中证香港证券投资主题ETF、易方达中证石化产业ETF、易方达MSCI中国A50互联互通ETF、易方达中证现代农业主题ETF、易方达MSCI中国A50互联互通ETF联接、易方达中证装备产业ETF、易方达恒生港股通新经济ETF、易方达中证全指建筑材料ETF、易方达中证装备产业ETF联接发起式的基金经理，易方达中证龙头企业指数、易方达北证50成份指数、易方达中证家电龙头指数发起式、易方达MSCI美国50ETF（QDII）、易方达中证石化产业ETF联接发起式、易方达中证A50ETF的基金经理助理	2021-04-15	-	10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投资支持专员、研究员、投资经理助理、投资经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。
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（自2022年08月10日至2024年	2023-02-10	2024-07-13	15年	硕士研究生，具有基金从业资格

	07 月 12 日)、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、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 100ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达上证科创板成长 ETF、易方达中证家电龙头指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 100ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接的基金经理，指数研究部总经理、指数投资决策委员会委员					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，易方达基金管理有限公司易方达中证光伏产业指数发起式的基金经理。
--	---	--	--	--	--	--

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行业协会相关规定。

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合规守信情况说明

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 28 次，其中 26 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

本基金跟踪标普生物科技精选行业指数，该指数反映特定的全球行业分类标准子行业或子行业分组组成的股票的表现。标的指数样本空间为全球行业分类标准子行业中的生物技术、生命科学工具和服务。报告期内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。

2024 年三季度，美国经济增速放缓，但整体维持韧性：其中消费增长小幅超预期，但就业市场表现不及预期，通胀温和反弹但整体仍偏弱，制造业景气度也持续低迷。美联储在 2024 年 9 月的议息会议上宣布将联邦基金利率目标区间从 5.25% 至 5.50% 降至 4.75% 至 5.00%，下调 50 个基点，降幅超出市场预期，这也是美联储 2022 年 3 月启动本轮紧缩周期以来首次降息。美联储主席鲍威尔表示，美联储不会急于完成降息，将根据数据情况逐步决定货币政策。指数表现方面，美股生物科技领域多为成长型中小盘股票，对货币政策更为敏感，三季度美股市场整体波动较大，然而美联储货币政策转向明朗，标普生物科技精选行业指数在报告期内震荡走高，表现优于标普 500 指数。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.4140 元，本报告期份额净值

增长率为 4.21%，同期业绩比较基准收益率为 4.68%；C 类基金份额净值为 1.3985 元，本报告期份额净值增长率为 4.11%，同期业绩比较基准收益率为 4.68%。年化跟踪误差 0.27%，在合同规定的目标控制范围之内。

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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	300,927,192.89	94.28
	其中：普通股	300,927,192.89	94.28
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
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	18,243,144.72	5.72
8	其他资产	-	-
9	合计	319,170,337.61	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	300,927,192.89	94.75
合计	300,927,192.89	94.75

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	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	300,927,192.89	94.75
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	300,927,192.89	94.75

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	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（%）
----	----------	----------	------	------	----------	-------	------------	--------------

				市场				
1	United Therapeutics Corp	联合治疗公司	UTHR US	纳斯达克证券交易所	美国	3,204	8,045,570.14	2.53
2	Incyte Corp	因赛特公司	INCY US	纳斯达克证券交易所	美国	17,092	7,916,828.78	2.49
3	Exact Sciences Corp	-	EXAS US	纳斯达克证券交易所	美国	16,576	7,912,455.60	2.49
4	Alnylam Pharmaceuticals Inc	艾拉伦制药股份有限公司	ALNY US	纳斯达克证券交易所	美国	4,096	7,893,996.43	2.49
5	AbbVie Inc	艾伯维股份有限公司	ABBV US	纽约证券交	美国	5,594	7,741,096.64	2.44

				易所				
6	Gilead Sciences Inc	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	13,119	7,707,417.96	2.43
7	Natera Inc	-	NTRA US	纳斯达克证券交易所	美国	8,587	7,638,904.44	2.41
8	Sarepta Therapeutics Inc	-	SRPT US	纳斯达克证券交易所	美国	8,716	7,627,843.89	2.40
9	Biogen Inc	渤健公司	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	5,553	7,542,719.95	2.38
10	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	15,910	7,450,725.26	2.35

				交易所				
--	--	--	--	-----	--	--	--	--

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名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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 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。

5.10.2 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	-

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	易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）	易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）
	A	C
报告期期初基金份额总额	231,520,493.14	1,901,690.77
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	8,580,517.59	217,101.02
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	222,939,975.55	1,684,589.75

注：本基金A类份额变动含A类人民币份额及A类美元份额；本基金C类份额变动含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 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	2024年09月30日	40,495,28	57,086,20	51,265,72	46,315,768.	20.62

			7.00	1.00	0.00	00	%
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>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§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标普生物科技指数证券投资基金（LOF）注册的文件；
- 2.《易方达标普生物科技指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3.《易方达标普生物科技指数证券投资基金（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。

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

二〇二四年十月二十五日