

易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）
（原易方达生物科技指数分级证券投资基金转型）

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 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：二〇二一年一月二十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1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。

自2020年12月3日起原易方达生物科技指数分级证券投资基金转型为易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）。原易方达生物科技指数分级证券投资基金本报告期自2020年10月1日至2020年12月2日止，易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）本报告期自2020年12月3日至2020年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）

基金简称	易方达中证万得生物科技指数（LOF）
场内简称	生物LOF
基金主代码	161122
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月3日
报告期末基金份额总额	711,607,772.00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,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,主要投资策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略、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	中证万得生物科技指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金,长期而言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。	
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	易方达中证万得生物科技指数(LOF)A	易方达中证万得生物科技指数(LOF)C
下属分级基金的交易代码	161122	010572
报告期末下属分级基金的份额总额	709,944,285.16份	1,663,486.84份

注:本基金A类份额由原易方达生物科技指数分级证券投资基金转型而来,并增设C类份额类别,基金合同于2020年12月3日起生效,C类份额首次确认为2020年12月4日。

2.2 易方达生物科技指数分级证券投资基金

基金简称	易方达生物分级
基金主代码	161122
交易代码	161122
基金运作方式	契约型开放式、分级基金
基金合同生效日	2015年6月3日
报告期末基金份额总额	613,308,801.64份

投资目标	紧密追踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。		
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，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、金融衍生品的投资策略等。		
业绩比较基准	中证万得生物科技指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金为股票型基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。长期而言，其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金；A类份额具有预期风险、收益较低的特征；B类份额具有预期风险、收益较高的特征。		
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	易方达生物分级	易方达生物分级 A	易方达生物分级 B
下属分级基金的场内简称	生物分级	生物 A	生物 B
下属分级基金的交易代码	161122	150257	150258
报告期末下属分级基金的份额总额	613,308,801.64份	-份	-份
下属分级基金的风险收益特征	基础份额为股票型基金，其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	与基础份额相比，A类份额的预期收益和预期风险低于基础份额。	与基础份额相比，B类份额的预期收益和预期风险高于基础份额。

§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 (2020 年 12 月 3 日（基金合同生效日） -2020 年 12 月 31 日)		报告期 (2020 年 10 月 1 日 -2020 年 12 月 2 日)
	易方达中证万得生 物科技指数（LOF） A	易方达中证万得 生物科技指数 （LOF）C	
1.本期已实现收益	1,934,748.44	1,449.36	-4,471,267.08
2.本期利润	61,806,427.39	49,334.53	-60,620,032.34
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0925	0.0742	-0.0811
4.期末基金资产净值	699,316,916.78	1,638,303.21	547,047,479.97
5.期末基金份额净值	0.9850	0.9849	0.8920

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 2020 年 12 月 3 日起原易方达生物科技指数分级证券投资基金转型为易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）。

4.自 2020 年 12 月 3 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2020 年 12 月 4 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 易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）

（报告期：2020年12月3日-2020年12月31日）

3.2.1.1 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

易方达中证万得生物科技指数（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	-	-	-	-	-	-
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	10.43%	1.26%	10.37%	1.28%	0.06%	-0.02%

易方达中证万得生物科技指数（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	7.17%	1.14%	7.10%	1.17%	0.07%	-0.03%

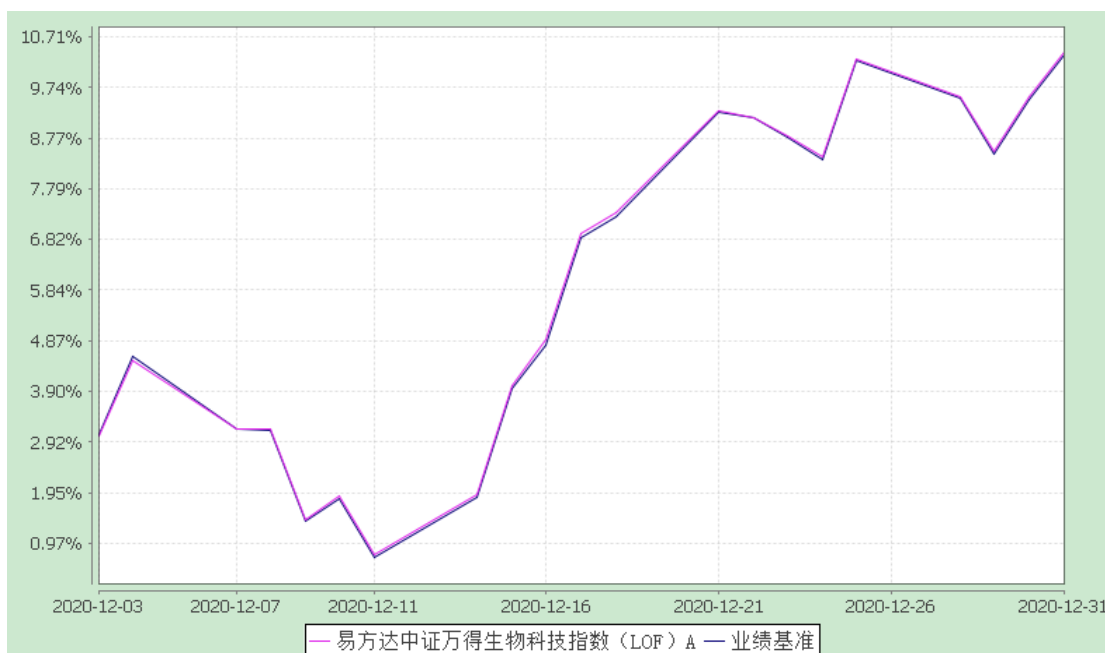
3.2.1.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）

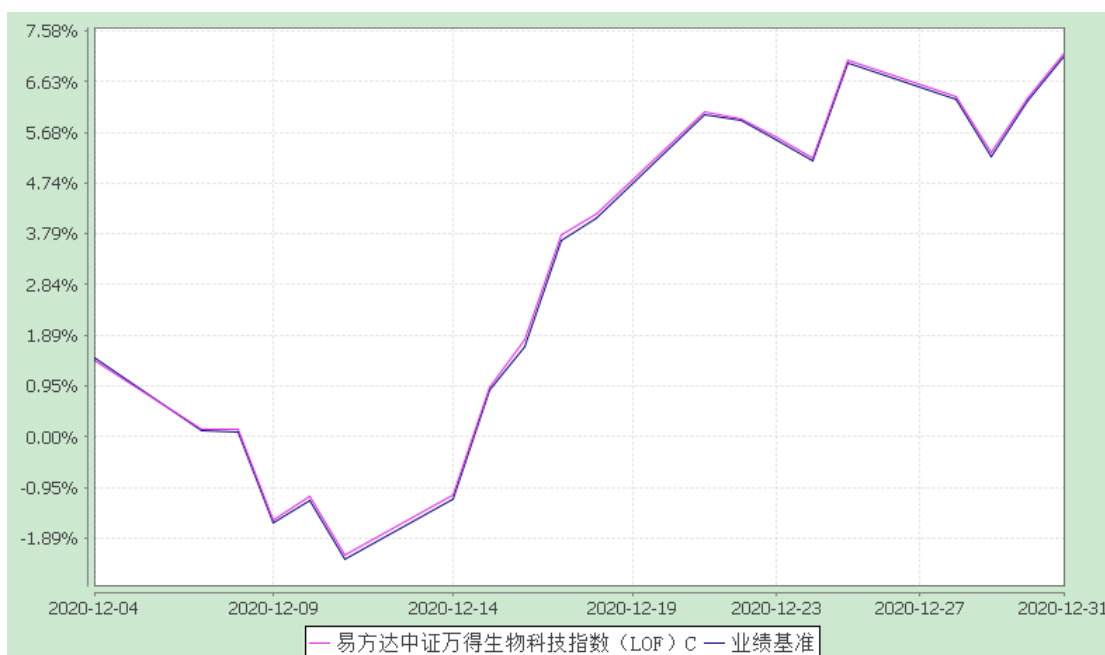
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020年12月3日至2020年12月31日)

易方达中证万得生物科技指数（LOF）A



易方达中证万得生物科技指数(LOF) C



注：1.本基金由原易方达生物科技指数分级证券投资基金于2020年12月3日转型而来，截至报告期末，本基金合同生效未满一年。

2.自2020年12月3日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2020年12月4日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.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（第十三部分二、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。

4.自基金转型至报告期末，A类基金份额净值增长率为10.43%，同期业绩比较基准收益率为10.37%。C类基金份额净值增长率为7.17%，同期业绩比较基准收益率为7.10%。

3.2.2 易方达生物科技指数分级证券投资基金

(报告期：2020年10月1日-2020年12月2日)

3.2.2.1 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	-5.52%	1.98%	-6.02%	1.99%	0.50%	-0.01%
过去六个月	-2.30%	2.33%	-4.57%	2.36%	2.27%	-0.03%
过去一年	61.59%	2.08%	58.24%	2.10%	3.35%	-0.02%
过去三年	88.95%	1.84%	83.57%	1.82%	5.38%	0.02%
过去五年	67.69%	1.69%	53.35%	1.65%	14.34%	0.04%
自基金合同生效起至今	32.59%	1.88%	26.30%	1.79%	6.29%	0.09%

注：过去三个月：2020年10月1日-2020年12月2日；

过去六个月：2020年7月1日-2020年12月2日；

过去一年：2020年1月1日-2020年12月2日；

过去三年：2018年1月1日-2020年12月2日；

过去五年：2016年1月1日-2020年12月2日。

3.2.2.2 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

易方达生物科技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

(2015年6月3日-2020年12月2日)



注：自基金合同生效至 2020 年 12 月 2 日，基金份额净值增长率为 32.59%，同期业绩比较基准收益率为 26.30%。

§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	原易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、易方达中证银行指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金	2017-07-18	2020-12-03	13 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部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理、易方

	<p>联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路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、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证 800 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、易方达中证 800 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、易方达标普 500 指数证券投资基金 (LOF) 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联接基金的基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、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、易方达中小板指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理</p>				<p>达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

张湛	本基金的基金经理、易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证科技50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理	2020-12-03	-	11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发展部数量化投资研究员、指数与量化投资部量化研究员、指数及增强投资部投资经理。
----	--	------------	---	-----	---

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、规范化的投资研究和决策流程、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32次，均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。

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

2020年4季度，国内新冠疫情依然得到有效防控，经济进一步企稳，经济数据持续向好。相比之下，海外疫情持续蔓延，新变异毒株的出现为防疫增添了不确定性，部分国家和地区再次实施“封锁”，经济活动的恢复再度受阻。与此同时，美国大选尘埃落定一定程度上缓解了前期市场面临的不确定性，来自新冠疫苗研发和生产的利好消息也进一步提振了市场对明年全球经济逐步重归常态的预期。在我国老龄化进程加速和居民健康意识逐渐提升的背景下，医疗保健行业发展空间巨大，尤其是生物科技所覆盖的创新药、疫苗、体外检测等科技创新属性较强的新兴领域，更是焕发蓬勃生机，具备长期的投资及配置价值。本报告期内，中证万得生物科技指数上涨3.87%。

报告期内，本基金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，在保障基金的正常运作的基础上，将基金的跟踪误差等指标控制在合同约定的范围内。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2020年12月31日，易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）A类基金份额净值为0.9850元，本报告期（2020年12月3日—2020年12月31日）份额净值增长率为10.43%，同期业绩比较基准收益率为10.37%；C类基金份额净值为0.9849元，本报告期（2020年12月4日—2020年12月31日）份额净值增长率为7.17%，同期业绩比较基准收益率为7.10%。年化跟踪误差0.497%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

2020年12月2日,原易方达生物科技指数分级证券投资基金份额净值为0.8920元,本报告期(2020年10月1日-2020年12月2日)份额净值增长率为-5.52%,同期业绩比较基准收益率为-6.02%,年化跟踪误差0.652%,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 易方达中证万得生物科技指数证券投资基金(LOF)

(报告期:2020年12月3日-2020年12月31日)

5.1.1 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	661,707,154.91	92.73
	其中:股票	661,707,154.91	92.73
2	固定收益投资	453,996.35	0.06
	其中:债券	453,996.35	0.06
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	42,543,164.23	5.96
7	其他资产	8,895,925.96	1.25
8	合计	713,600,241.45	100.00

注:本基金本报告期末融出证券市值为22,317,794.00元,占净值比例3.18%。

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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	460,492,182.59	65.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,778.54	0.01
J	金融业	1,714,383.21	0.24
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	115,640,060.15	16.50
N	水利、环境和公共设施管理业	62,972.16	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	83,696,202.82	11.94
R	文化、体育和娱乐业	19,253.84	0.00
S	综合	-	-
	合计	661,707,154.91	94.40

5.1.3 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	603259	药明康德	551,784	74,336,340.48	10.61
2	000661	长春高新	158,212	71,022,948.92	10.13
3	300122	智飞生物	437,854	64,762,985.14	9.24

4	300347	泰格医药	365,550	59,076,535.50	8.43
5	300601	康泰生物	237,977	41,526,986.50	5.92
6	300142	沃森生物	1,075,321	41,464,377.76	5.92
7	002007	华兰生物	762,688	32,215,941.12	4.60
8	603882	金域医学	192,161	24,619,667.32	3.51
9	600161	天坛生物	437,028	18,224,067.60	2.60
10	300676	华大基因	139,400	17,921,264.00	2.56

5.1.4 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	-	-
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)	453,996.35	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	453,996.35	0.06

5.1.5 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	113044	大秦转债	3,000	299,997.37	0.04
2	113614	健20转债	1,540	153,998.98	0.02

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 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投资股指期货。

5.1.10 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投资国债期货。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	182,296.20
2	应收证券清算款	5,132,165.13
3	应收股利	-
4	应收利息	14,581.39
5	应收申购款	3,566,883.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,895,925.96

5.1.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限 情况说明
1	300142	沃森生物	6,154,176.00	0.88	转融通流 通受限
2	603882	金域医学	3,625,796.00	0.52	转融通流 通受限
3	600161	天坛生物	1,430,310.00	0.20	转融通流 通受限
4	603259	药明康德	1,347,200.00	0.19	转融通流 通受限
5	002007	华兰生物	844,800.00	0.12	转融通流 通受限
6	300676	华大基因	449,960.00	0.06	转融通流 通受限

5.2 易方达生物科技指数分级证券投资基金

(报告期: 2020年10月1日-2020年12月2日)

5.2.1 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	516,488,032.11	93.54
	其中: 股票	516,488,032.11	93.54
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	34,885,840.78	6.32
7	其他资产	785,468.22	0.14

8	合计	552,159,341.11	100.00
---	----	----------------	--------

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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	370,432,069.81	67.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,477.76	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	22,501.16	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,889.37	0.02
J	金融业	1,548,459.06	0.28
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	91,539,448.45	16.73
N	水利、环境和公共设施管理业	71,827.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	52,728,351.42	9.64
R	文化、体育和娱乐业	22,008.08	0.00
S	综合	-	-
	合计	516,488,032.11	94.41

5.2.3 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	603259	药明康德	559,284	60,430,636.20	11.05
2	000661	长春高新	138,512	52,329,833.60	9.57
3	300122	智飞生物	406,354	52,045,820.32	9.51
4	300142	沃森生物	949,921	40,742,111.69	7.45
5	300347	泰格医药	333,198	39,657,225.96	7.25
6	300601	康泰生物	213,577	31,269,808.57	5.72
7	002007	华兰生物	694,988	30,475,223.80	5.57
8	600161	天坛生物	398,328	15,686,156.64	2.87
9	300676	华大基因	101,700	13,292,190.00	2.43
10	603882	金域医学	145,461	13,071,125.46	2.39

5.2.4 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。

5.2.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.6 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。

5.2.7 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。

5.2.8 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。

5.2.9 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投资股指期货。

5.2.10 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投资国债期货。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	182,296.20
2	应收证券清算款	567,342.94
3	应收股利	-
4	应收利息	35,429.60
5	应收申购款	399.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	785,468.22

5.2.11.4 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处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 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

6.1 易方达中证万得生物科技指数证券投资基金(LOF)

单位：份

项目	易方达中证万得生物科技指数(LOF) A	易方达中证万得生物科技指数(LOF) C
基金合同生效日的基金份额总额	613,308,801.64	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	208,311,772.08	1,808,943.11
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	111,676,288.56	145,456.27
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	709,944,285.16	1,663,486.84

注：本基金 A 类基金份额由易方达生物科技指数分级证券投资基金转型而来，并增设 C 类份额类别，基金合同于 2020 年 12 月 3 日起生效，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

6.2 易方达生物科技指数分级证券投资基金

单位：份

项目	易方达生物分级	易方达生物分级A	易方达生物分级B
报告期期初基金份额总额	573,270,300.91	5,078,781.00	5,078,781.00
报告期基金总申购份额	346,231,424.40	-	-

减：报告期基金总赎回份额	316,350,484.67	-	-
报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	10,157,561.00	-5,078,781.00	-5,078,781.00
报告期期末基金份额总额	613,308,801.64	-	-

注：拆分变动份额包括三类份额之间的配对转换份额及折算调整份额。自2020年12月3日起，“易方达生物科技指数分级证券投资基金”更名为“易方达中证万得生物科技指数（LOF）”。本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）

7.1.1 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。

7.1.2 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。

7.2 易方达生物科技指数分级证券投资基金

7.2.1 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。

7.2.2 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 易方达生物科技指数分级证券投资基金

8.1.1 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	2020年10月19日~2020年11月26日	-	199,340,684.38	199,340,684.38	-	-

产品特有风险

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。

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。

8.1.2 影响投资者决策的其他重要信息

2020年8月26日至2020年10月28日，易方达生物科技指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会表决通过了《关于易方达生物

科技指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，同意易方达生物科技指数分级基金转型为易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF），并相应调整基金合同中基金运作方式、折算机制、配对转换机制、份额分类方式、基金上市、申购赎回、投资范围、投资策略、风险收益特征、基金费率、基金资产估值、收益分配政策等条款，基金名称相应变更为“易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）”。

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。依据基金份额持有人大会决议，2020年12月3日起，原《易方达生物科技指数分级证券投资基金基金合同》失效，《易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

§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生物科技指数分级证券投资基金变更注册的文件；
- 2、《易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《易方达中证万得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

二〇二一年一月二十一日