易方达中证科技 50 交易型开放式指数证券投资基金

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中证科技 50ETF
场内简称	科技 ETF
基金主代码	159807
交易代码	159807
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 16 日
报告期末基金份额总额	658,025,714.00 份
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（含存托凭证）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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

业绩比较基准	中证科技 50 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。
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	52,248,304.36
2.本期利润	143,194,593.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.2206
4.期末基金资产净值	1,066,915,308.67
5.期末基金份额净值	1.6214

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	业绩比较基准收益率	①-③	②-④

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

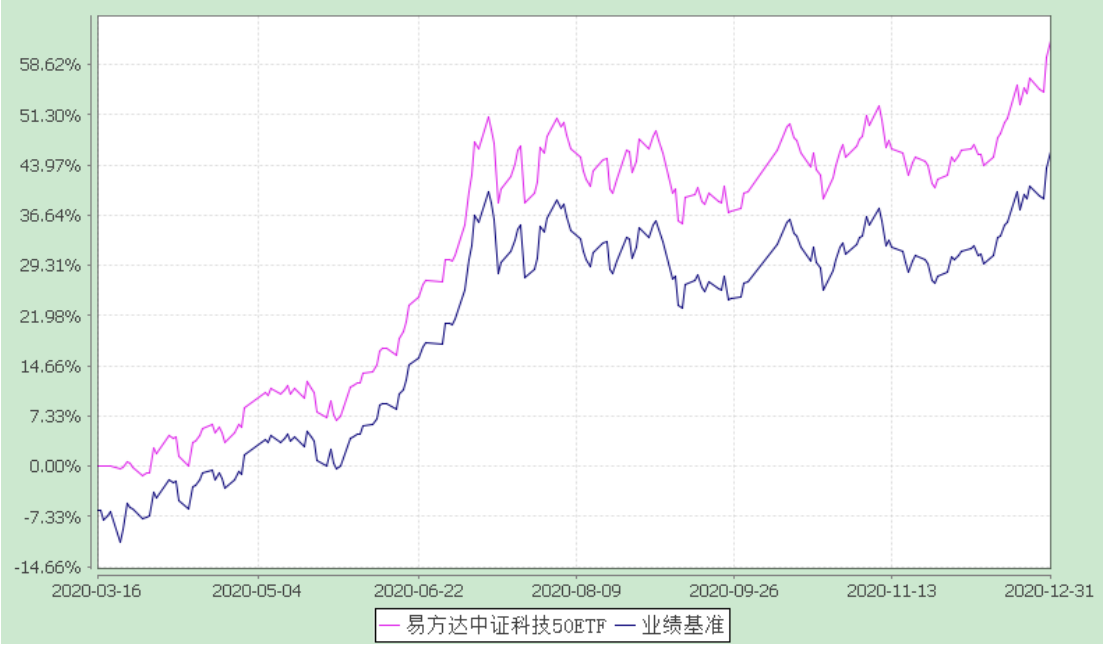
			③	标准差④		
过去三个月	15.81%	1.44%	15.02%	1.45%	0.79%	-0.01%
过去六个月	24.62%	1.71%	20.68%	1.73%	3.94%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	62.14%	1.59%	45.91%	1.76%	16.23%	-0.17%

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

易方达中证科技 50 交易型开放式指数证券投资基金

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

（2020 年 3 月 16 日至 2020 年 12 月 31 日）



注：1.本基金合同于 2020 年 3 月 16 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，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十四部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 62.14%，同期业绩比较基准收益率为 45.91%。

§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		
张湛	本基金的基金经理、易方达中证万得生物科技指数证券投资基金（LOF）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	2020-03-16	-	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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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。不久前召开的中央经济工作会议上再次强调要强化国家战略科技力量，增强产业链供应链自主可控能力。科技创新板块的政策推动得到延续并加强，科技创新将持续成为中国经济转型和增长的长期驱动力。报告期内，中证科技 50 指数上涨 15.02%。

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

截至报告期末，本基金份额净值为 1.6214 元，本报告期份额净值增长率为 15.81%，同期业绩比较基准收益率为 15.02%，年化跟踪误差 0.73%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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	1,054,250,749.86	97.18
	其中：股票	1,054,250,749.86	97.18
2	固定收益投资	703,994.90	0.06
	其中：债券	703,994.90	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	15,641,046.56	1.44
7	其他资产	14,283,150.22	1.32
8	合计	1,084,878,941.54	100.00

注：1.上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末融出证券市值为 95,891,361.00 元，占净值比例 8.99%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	904,063,918.27	84.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	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	149,700,909.64	14.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	310,145.78	0.03
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,054,231,503.86	98.81

5.3 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	600276	恒瑞医药	1,043,272	116,283,097.12	10.90
2	300750	宁德时代	325,000	114,110,750.00	10.70
3	601012	隆基股份	735,608	67,823,057.60	6.36
4	002475	立讯精密	1,173,624	65,863,778.88	6.17
5	300760	迈瑞医疗	135,198	57,594,348.00	5.40
6	002415	海康威视	1,045,088	50,697,218.88	4.75
7	000725	京东方 A	7,570,500	45,423,000.00	4.26
8	000661	长春高新	79,129	35,521,799.39	3.33
9	603501	韦尔股份	122,000	28,194,200.00	2.64
10	300014	亿纬锂能	318,174	25,931,181.00	2.43

5.4 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(%)

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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）	703,994.90	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	703,994.90	0.07

5.5 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	4,580	457,995.98	0.04
2	113616	韦尔转债	2,460	245,998.92	0.02

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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	29,328.53
2	应收证券清算款	14,222,576.47
3	应收股利	-
4	应收利息	31,245.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,283,150.22

5.11.4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。

5.11.5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	601012	隆基股份	12,447,000.00	1.17	转融通流通受限
2	002415	海康威视	9,221,751.00	0.86	转融通流通受限
3	300750	宁德时代	8,988,416.00	0.84	转融通流通受限
4	002475	立讯精密	7,834,352.00	0.73	转融通流通受限
5	000661	长春高新	4,489,100.00	0.42	转融通流通受限
6	603501	韦尔股份	2,588,320.00	0.24	转融通流

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

					通受限
7	300014	亿纬锂能	2,298,300.00	0.22	转融通流通受限
8	300760	迈瑞医疗	2,044,800.00	0.19	转融通流通受限
9	600276	恒瑞医药	1,114,600.00	0.10	转融通流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	709,025,714.00
报告期期间基金总申购份额	237,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	288,000,000.00
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	658,025,714.00

§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 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中证科技 50 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

2.《易方达中证科技 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3.《易方达中证科技 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

二〇二一年一月二十一日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn