

易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	易方达恒生科技ETF（QDII）
场内简称	港股科技、恒生科技30ETF
基金主代码	513010
交易代码	513010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年5月18日
报告期末基金份额总额	2,179,307,000.00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	本基金主要通过投资于标的指数成份股、备选成份股、跟踪同一标的指数的股指期货等金融衍生品实现对标的指数的紧密跟踪，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

	<p>3%以内。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。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为进行流动性管理、应付赎回、降低跟踪误差以及提高投资效率，本基金可投资于金融衍生品，如跟踪同一标的指数的股指期货、与标的指数成份股、备选成份股等相关的衍生工具等。</p>
业绩比较基准	恒生科技指数收益率（使用估值汇率折算）
风险收益特征	<p>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。此外，本基金主要投资于香港等境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及香港等境外市场的风险。</p>
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
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：The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited

	中文名称： 香港上海汇丰银行有限公司
--	--------------------

§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
	(2021年7月1日-2021年9月30日)
1.本期已实现收益	-27,989,209.17
2.本期利润	-370,571,375.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2130
4.期末基金资产净值	1,664,018,159.20
5.期末基金份额净值	0.7636

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

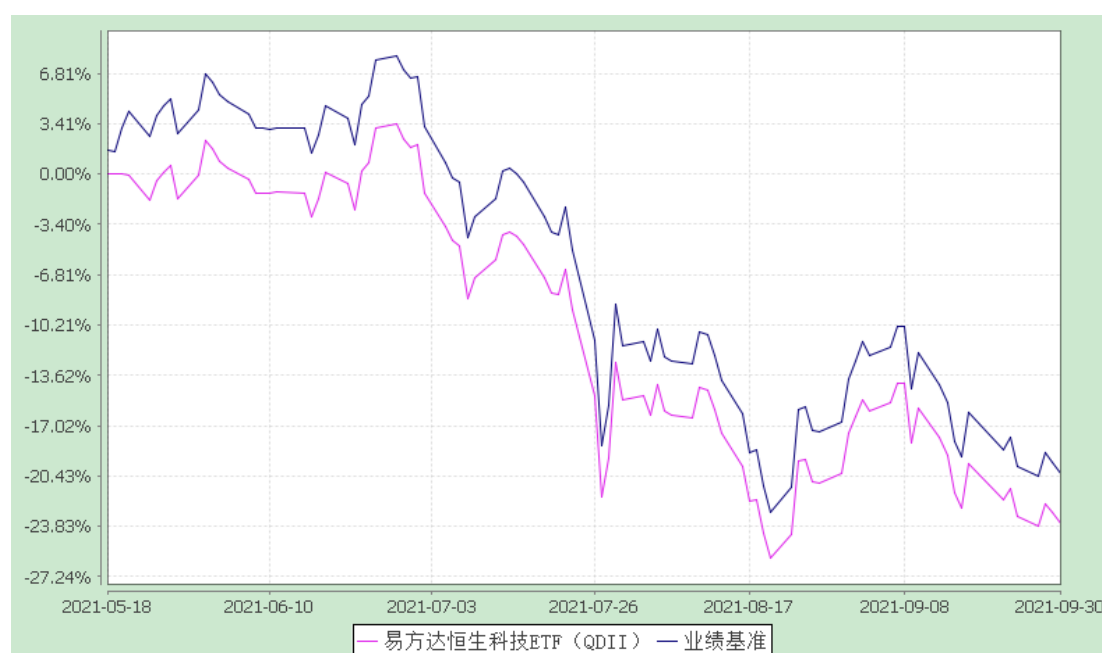
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.02%	2.67%	-25.10%	2.69%	0.08%	-0.02%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-

过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-23.64%	2.30%	-20.26%	2.34%	-3.38%	-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

易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
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

（2021年5月18日至2021年9月30日）



注：1.本基金的业绩比较基准已经转换为以人民币计价。

2.本基金合同于2021年5月18日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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（第十四部分二、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，在上市交易前已完成拟合标的指数。

4.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-23.64%，同期业绩比较基准收益率为-20.26%。

§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500指数证券投资基金（LOF）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、指数投资决策委员会委员	2021-05-18	-	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。
成曦	本基金的基金经理、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、易方达上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证科创创业 50 交易型开	2021-05-18	-	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。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、易方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、易方达中小板指数证券投资基金（LOF）基

	<p>放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</p>			<p>金经理、易方达银行指数分级证券投资基金基金经理、易方达生物科技指数分级证券投资基金基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金基金经理、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基金经理、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金（LOF）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基金经理、易方达原油证券投资基金（QDII）基金经理、易方达上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达</p>
--	--	--	--	---

					上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金经理、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

本基金跟踪的标的指数为恒生科技指数，由30家与科技主题高度相关的香港上市公司组成，涵盖了互联网、电子产品和智能硬件等细分领域龙头科技公司。本基金主要采取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。

2021年三季度，港股市场大幅回调。究其原因，一方面，由于国内个别行业的强监管政策，互联网及相关产业短期业绩受到压制。短期政策的密集释放，给市场带来较大负面冲击。另一方面，海外大宗商品和能源价格波动剧烈，引起通胀担忧。上游价格不仅影响海外经济复苏进度，而且影响全球流动性政策的稳定性。因此，基本面和流动性的双重波动压低了风险偏好，引发市场大幅调整。综合来看，监管政策最严峻和最密集的时候或已过去，但市场信心修复仍需时间。

恒生科技指数是香港市场科技主题的代表性指数，不仅集中了互联网、电子产品和智能硬件等细分领域龙头科技公司，更是中国经济转型与产业升级的典型代表。

报告期内，本基金严守基金合同，认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项，保障基金正常运作。

截至报告期末，本基金份额净值为0.7636元，本报告期份额净值增长率为-25.02%，同期业绩比较基准收益率为-25.10%，年化跟踪误差0.86%，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	1,535,971,559.72	91.71
	其中：普通股	1,535,971,559.72	91.71
	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	117,888,405.97	7.04
8	其他资产	20,863,307.16	1.25
9	合计	1,674,723,272.85	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 908,179,910.11 元，占净值比例 54.58%。

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（%）
中国香港	1,535,971,559.72	92.30
合计	1,535,971,559.72	92.30

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	523,234,098.91	31.44
必需消费品	-	-
保健	61,248,090.71	3.68
金融	19,819,093.04	1.19
信息技术	557,718,131.93	33.52
电信服务	373,952,145.13	22.47
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	1,535,971,559.72	92.30

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	Meituan Dianping	美团点评	3690 HK	香港证券交易所	中国香港	640,262	131,530,684.78	7.90
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	中国香港	331,300	127,343,067.77	7.65

		有限公司		交易所				
3	JD.com Inc	京东集团 股份有限公司	961 8 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	520,200	122,726,932.3 6	7.38
4	Kuaishou Technology	快手 科技	102 4 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	1,721,50 0	118,601,127.73	7.13
5	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇 光学 科技 (集团) 有限 公司	238 2 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	680,234	116,055,190.74	6.97
6	Alibaba Group Holding Limited	阿里 巴巴 集 团 控 股 有 限 公 司	998 8 HK	香港 证券 交易 所	中国 香港	963,100	114,089,916.23	6.86

		司						
7	Xiaomi Corporation	小米集团	1810 HK	香港证券交易所	中国香港	6,374,600	113,377,558.29	6.81
8	Semiconductor Manufacturing International Corporation	中芯国际集成电路制造有限公司	981 HK	香港证券交易所	中国香港	4,675,000	85,874,948.77	5.16
9	JD Health International Inc	京东健康股份有限公司	6618 HK	香港证券交易所	中国香港	1,165,000	72,885,668.99	4.38
10	Haier Smart Home Co., Ltd.	海尔智家股份有限公司	6690 HK	香港证券交易所	中国香港	2,514,200	57,493,460.96	3.46

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	HSTECH Futures Oct21	-	-
2	股指期货	HSTECH Futures 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-5,165,222.37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，阿里巴巴集团控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。美团在本报告期内曾被国家市场监督管理总局调查。腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

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	20,811,737.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,219.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	40,350.40
8	其他	-
9	合计	20,863,307.16

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

报告期期初基金份额总额	1,369,307,000.00
报告期期间基金总申购份额	816,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	6,000,000.00
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	2,179,307,000.00

§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	2021年07月01日~2021年07月04日,2021年08月26日~2021年09月14日	303,008,601.00	1,169,235,300.00	1,185,096,100.00	287,147,801.00	13.18%
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；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续五十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金将面临基金财产清算并终止的风险；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恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的文件；
- 2、《易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；
- 3、《易方达恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 4、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

二〇二一年十月二十七日