

# 易方达生物科技指数分级证券投资基金

## 2015 第四 季度 报 告

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：二〇一六年一月二十二日

§ 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2016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表示其未来表现。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。

本报告中文财务资料未经审计。

本报告自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况			
基金简称	易方达生物科技		
基金代码	110122		
二级市场代码	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5月21日		
报告期末基金份额总额	231,077,313.78份		
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，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，即完全复制标的指数的构成或权重及其权重构成和权重变化，并跟踪标的指数，以期获得与该指数投资目标相一致的投资收益。本基金在跟踪标的指数基金无法完全投资于标的指数的成份股时，基金管理人可投资于其他股票、债券、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，以达到跟踪标的指数的目的。		
业绩比较基准	中证万得生物科技指数收益率×90%+同期银行利率（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所代表的标的指数的收益特征相似。本基金属于较高风险、较高收益的证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。		

§ 3 主要财务指标和基金净值表现			
单位：人民币元			
报告期末			
(2015年10月1日至2015年12月31日)			
1.本期已实现收益	-9,224,767.97		
2.本期利润	73,150,760.06		
3.加权平均基金份额本期利润	0.32023		
4.期末基金资产净值	289,377,512.19		
5.期末基金份额净值	1.2523		

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据。

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.基金净值表现

3.1 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

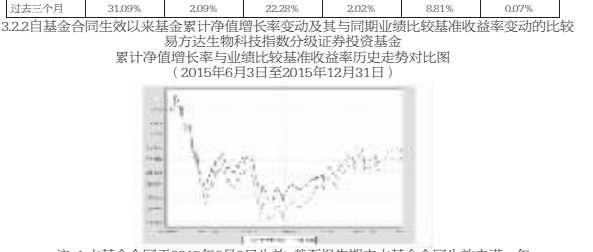
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	31.09%	2.09%	22.28%	2.02%	8.81%	0.07%

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日至2015年12月31日)



注：1.本基金合同于2015年6月3日生效，截至报告期末本基金合同生效未配置。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的最短建仓期为六个月，建仓期结束后各项资产配置比例符合基金合同（第五部分二、投资组合限制、投资策略和限制、投资策略限制）的有关规定。

3.自基金合同生效至报告期末，本基金净值增长率为-20.93%，同期业绩比较基准收益率为-17.64%。

§ 4 管理人报告			
姓名	职务	任本基金的基金经理任期	证券从业年限
王亚伟	基金经理	2015-06-03	10年

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

注：1.此处的“任职日期”为基金合同生效之日，“离任日期”为公告确定的解聘日期。

2.证券投资基金的基金经理由基金业协会（证券业从业人员资格管理规定）的相关规定。

4.2 管理人对于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、取信于社会投资者为宗旨，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，本基金运作合法合规，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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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 公平交易专项说明

4.3.2.1 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。本基金管理人建立了严格的投研决策管理制度、投资决策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管理，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统对基金交易的公平交易实施，可以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。

产业振兴，有利于经济结构的加速转型。鉴于内外需结构的调整、优化以及国内经济的弹性和潜在的内生增长力，本基金对中国经济中长期前景持相对乐观的判断。生物科技指数主要集中于医药行业中的生物制药、试剂、基因诊断及血液制品等具有成长性的细分行业，指数成分股市值偏小、成长性高、弹性较大。生物科技指数基金资产净值与业绩比较基准资产净值跟踪偏离度，但鉴于当前中国经济转型期的大背景及新兴产业未来的发展前景，生物科技指数中长期期的投资价值依然明显。

作为被动投资的基金，生物科技指数分级基金将既定的指数化投资策略，以严格控制基金持仓对业绩基准的跟踪误差为投资目标，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。期望生物科技指数分级基金为投资者进一步分享中国经济的未来长期成长提供良好的投资机会，为各类不同风险偏好的投资者提供多样化的投资工具。

§ 5 投资组合报告			
序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	272,900,019.48	93.70
2	其中：股票	272,900,019.48	93.70
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他金融资产	-	-
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	17,794,479.34	6.11
11	其他资产	567,789.13	0.19
12	合计	291,312,287.95	100.00

§ 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			
序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔	-	-
B	制造业	266,101,889.32	89.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	150,509	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	16,864,133.16	5.83
N	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
O	教育、体育和娱乐业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		272,900,019.48	94.33

§ 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）
1	002282	世纪佳缘	528,688
2	600697	顺鑫农业	762,051
3	000300	达安基因	442,438
4	600645	中源协和	259,316
5	000398	双环药业	384,126
6	300142	沃森生物	942,589
7	000007	华兰生物	278,760
8	000661	长春高新	100,763
9	000222	科华生物	393,270
10	300122	奇安信	306,907

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

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、处罚的情况。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	312,536.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,826.80
5	应收申购款	241,425.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	557,789.13

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 报告期末持有的准备在流通受限情况的说明

5.11.6 报告期末持有的公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

序号	股票代码	股票名称	流通受限期间的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600645	中源协和	16,864,133.16	5.83	重大资产重组

5.6 开放式基金份额变动

项目	易方达生物科技	易方达生物科技A	易方达生物科技B
报告期末基金份额总额	203,262,420.19	22,501,511.00	22,501,511.00
报告期基金份额总额	33,680,169.68	-	-
减：报告期基金份额总额	50,568,289.07	-	-
基金基金份额净变动	-16,888,119.39	-	-
报告期末基金份额总额	10,567,778.00	-	-
报告期末基金份额总额	136,642,077.78	17,217,618.00	17,217,618.00

注：拆分变动额包括三类份额之间的配对转换股份。

§ 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的情况

7.2 报告期内基金管理人持有本基金基金份额

7.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.4 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.5 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.17 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.19 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.20 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.21 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.22 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.23 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.24 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.25 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.26 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.27 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.28 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.29 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.30 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.31 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.32 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.33 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.34 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.35 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.36 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.37 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.38 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.39 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.40 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.41 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.42 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.43 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.44 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.45 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.46 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.47 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.48 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.49 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.50 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.51 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.52 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.53 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.54 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.55 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.56 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.57 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.58 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.59 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.60 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.61 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.62 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.63 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.64 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.65 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.66 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.67 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.68 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.69 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.70 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.71 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.72 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.73 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.74 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.75 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.76 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.77 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.78 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.79 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.80 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.81 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.82 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.83 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.84 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.85 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.86 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.88 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.89 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.90 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.91 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.92 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.93 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.94 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.95 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.96 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.97 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.98 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.99 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.00 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.01 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.02 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.03 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.04 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.05 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.06 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.07 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.08 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.09 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.10 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.11 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.13 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.14 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.15 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.16 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.17 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.19 基金管理人运用