

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
2019 年年度报告
2019 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

送出日期：二〇二〇年三月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2020 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 10 月 21 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4	管理人报告	12
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
§ 5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§ 6	审计报告	19
6.1	审计意见	19
6.2	形成审计意见的基础	19
6.3	其他信息	19
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任	20
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任	20
§ 7	年度财务报表	21
7.1	资产负债表	21
7.2	利润表	23
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4	报表附注	25
§ 8	投资组合报告	50
8.1	期末基金资产组合情况	50
8.2	期末投资目标基金明细	51
8.3	报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.4	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52

8.5	报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.6	期末按债券品种分类的债券投资组合	62
8.7	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	62
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
8.9	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
8.10	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	63
8.11	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.13	投资组合报告附注	63
§ 9	基金份额持有人信息	65
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	65
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	66
§ 10	开放式基金份额变动	66
§ 11	重大事件揭示	67
11.1	基金份额持有人大会决议	67
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4	基金投资策略的改变	67
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8	其他重大事件	71
§ 12	备查文件目录	71
12.1	备查文件目录	71
12.2	存放地点	72
12.3	查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	易方达中证 800ETF 联接发起式	
基金主代码	007856	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 10 月 21 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	
报告期末基金份额总额	93,754,565.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 800ETF 联接发起式 A	易方达中证 800ETF 联接发起式 C
下属分级基金的交易代码	007856	007857
报告期末下属分级基金的份额总额	70,194,576.49 份	23,559,988.66 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	515810
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 8 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 10 月 25 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

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	本基金为易方达中证 800ETF（以下简称“目标 ETF”）的联接基金，主要

	通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或二级市场方式进行目标 ETF 的投资。为了更好地实现投资目标，本基金可以投资股指期货、期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具，本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品进行交易。
业绩比较基准	中证 800 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 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于易方达中证 800 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证 800 指数的表现密切相关。

2.2.1 目标基金产品说明

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，基金管理人将采取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。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交易。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 800 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096

	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区）	北京市西城区金融大街25号
办公地址		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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	易方达中证800ETF联接发起式A	易方达中证800ETF联接发起式C
本期已实现收益	864,721.87	386,026.12

本期利润	3,922,095.04	1,680,889.23
加权平均基金份额本期利润	0.0394	0.0307
本期加权平均净值利润率	3.93%	3.06%
本期基金份额净值增长率	4.66%	4.63%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	
	易方达中证 800ETF 联接发起式 A	易方达中证 800ETF 联接发起式 C
期末可供分配利润	724,349.90	237,442.01
期末可供分配基金份额利润	0.0103	0.0101
期末基金资产净值	73,462,909.31	24,651,094.16
期末基金份额净值	1.0466	1.0463
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	
	易方达中证 800ETF 联接发起式 A	易方达中证 800ETF 联接发起式 C
基金份额累计净值增长率	4.66%	4.63%

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.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4.本基金合同于 2019 年 10 月 21 日生效，合同生效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 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 800ETF 联接发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	4.66%	0.57%	5.65%	0.71%	-0.99%	-0.14%

易方达中证 800ETF 联接发起式 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差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	4.63%	0.57%	5.65%	0.71%	-1.02%	-0.14%

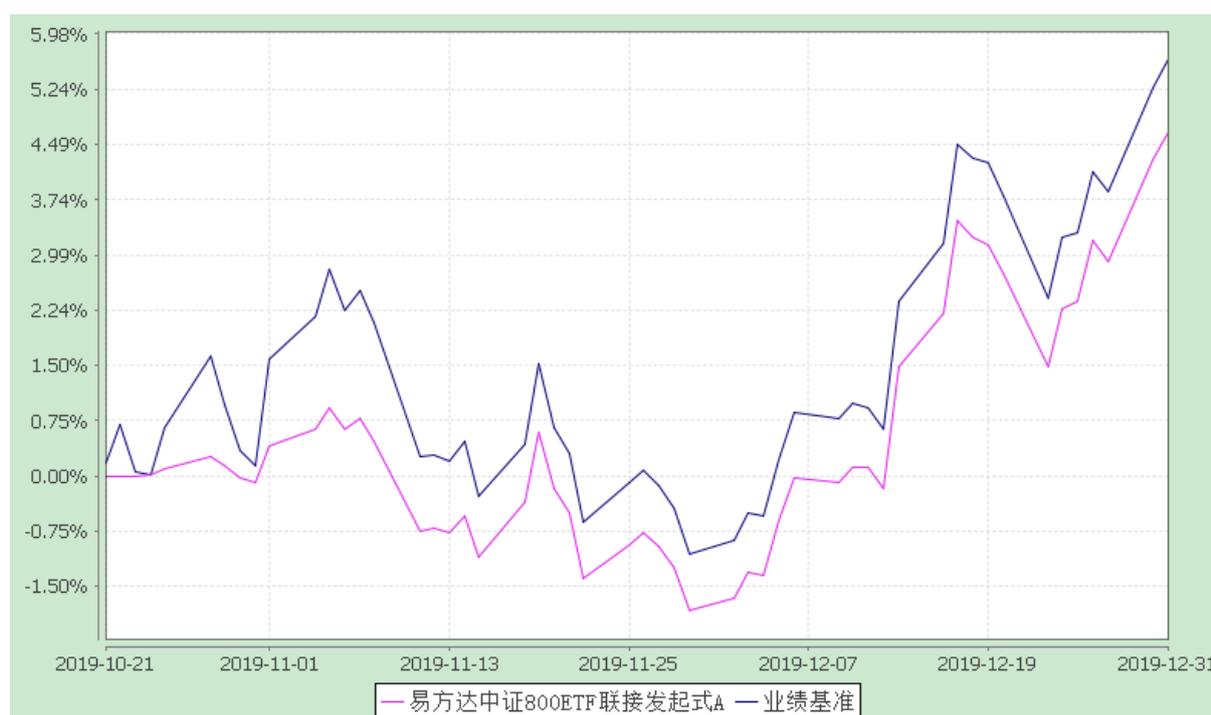
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

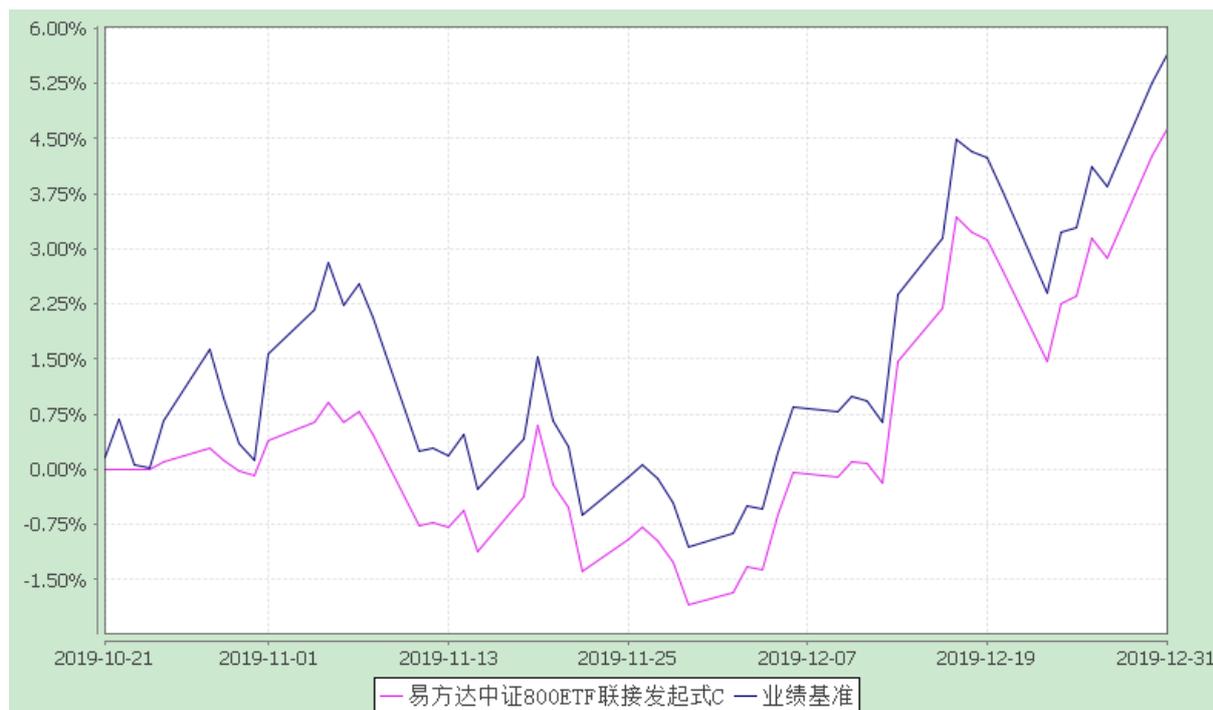
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 10 月 21 日至 2019 年 12 月 31 日)

易方达中证 800ETF 联接发起式 A



易方达中证 800ETF 联接发起式 C



注：1.本基金合同于2019年10月21日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

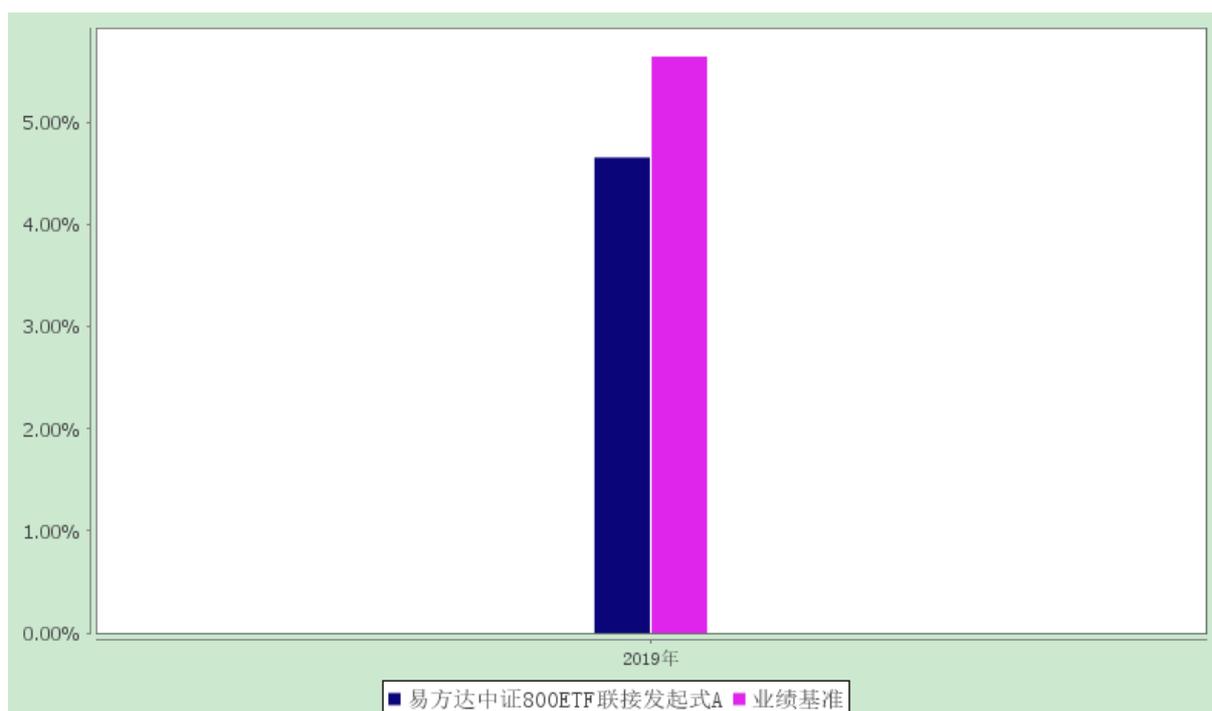
2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

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4.66%，C类基金份额净值增长率为4.63%，同期业绩比较基准收益率为5.65%。

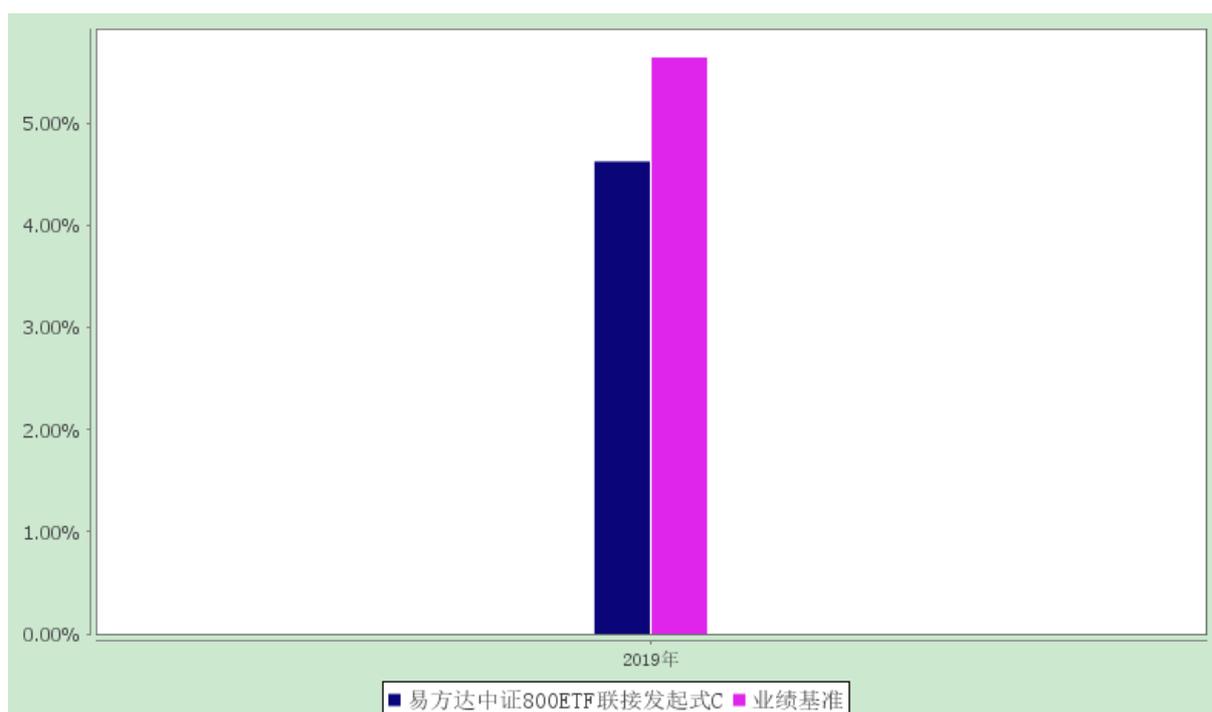
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达中证 800ETF 联接发起式 A



易方达中证 800ETF 联接发起式 C



注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 21 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2019 年 10 月 21 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于 2001 年 4 月 17 日，总部设在广州，在北京、上海、广州、成都、大连等地设有分公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终专注于资产管理业务，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
林伟斌	本基金的基金经理、易方达中证红利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的基金经理、指数投资部副总经理	2019-10-21	-	11 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任中国金融期货交易所股份有限公司研发部研究员，易方达基金管理有限公司指数与量化投资部指数量化研究员、基金经理助理兼任指数量化研究员、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金经理、易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金基金经理、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 500 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、易方达纳斯达克 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。
刘树荣	<p>本基金的基金经理、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、易方达中小板指数证券投资基金 (LOF) (原易方达中小板指数分级证券投资基金) 的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理、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、易方达生物科技指数分级证券投资基金的基金经理、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的基金经理 (自 2017 年 07 月 18 日至 2019 年 08 月 15 日)、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金的基金经理 (自 2017 年 07 月 18 日至 2019 年 08 月 15 日)、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、易方达深证 100 交易型开放式指数基金的基金经理、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、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (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、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (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</p>	2019-10-21	-	12 年	<p>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。</p>

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/基金经理助理，“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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人

员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 116 次，其中 114 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，2 次为不同基金经理管理的组合间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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，中证 800 指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，兼具成长性与价值性，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现。

中证 800 指数完全覆盖 28 个申万一级行业，成份股由各行业的龙头企业组成，指数走势的表现主要受国内外经济形式与市场情绪影响。2019 年 1 月初，央行下调金融机构存款准备金率，同时 1 月份社融数据大超预期，在政策宽松和“宽信用”预期下，市场大幅上涨，中证 800 指数一季度大幅上涨 29.7%。二季度，在 2019 年一季度经济表现好于预期、资产价格大幅上涨的背景下，政策收紧的预期开始不断出现，市场开始震荡调整，中证 800 指数下跌 3.6%。三季度，国常会提出改革完善贷款市场报价利率形成机制（LPR），市场普遍将央行的 LPR 改革这一举措解读为实质性的降息，季末中美贸易摩擦也释放出了缓和的信号，叠加央行宣布将进行“全面+定向”降准，在多重利好助推下，股市开始回升。四季度，国内经济下行压力加大，CPI 同比大幅上升，货币政策灵活性受掣肘，与此同时，海外经济数据疲软，引起了全球经济衰退的担忧，国内股票市场普遍下跌。进入 12 月，国内经济出现企稳信号，与此同时，海外数据开始回暖，市场产生了对全球经济弱复苏的预期。此外，中美第一阶段经贸协议达成一致更是带动了市场情绪，直接推动了股票市场的上涨。2019 年度中证 800 指数上涨 33.7%。

本基金为易方达中证 800ETF 的联接基金，主要投资于易方达中证 800ETF。基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0466 元，本报告期份额净值增长率为 4.66%；C 类基金份额净值为 1.0463 元，本报告期份额净值增长率为 4.63%；同期业绩比较基准收益率为 5.65%，本报告期本基金处于建仓期，受建仓期影响，年化跟踪误差 4.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年是中国全面建成小康社会和十三五规划的收官之年，同时也要实现十三五规划中 GDP 翻倍的目标。在此关键时刻，年初爆发的新型冠状病毒疫情波及全国之余，还影响到美英德日等全球多国，世卫组织也把本次疫情列为国际公共卫生紧急事件（PHEIC），疫情将打断经济企稳节奏，消费、就业冲击大，财政压力再凸显，短期 GDP 受拖累，疫情影响下，预计政策将更宽松、逆周期调节将进一步加码。

展望 2020 年资本市场，国内股票市场波动将加大。一方面，影响资本市场走势的中美贸易摩擦短期内难以解除；此外，本次新型冠状病毒疫情对国内经济的影响不容忽视，短期经济将面临更大的下行压力，股票市场受此压制较大。另一方面，在全球货币宽松周期开启、国家对资本市场重视程度不断提升、以及中国金融改革开放持续扩大的背景下，中国股票市场受到的重视将持续提升，资本市场政策不断鼓励加码，建立多层次资本市场体系、提升上市公司质量、推进高水平对外开放、加大法治供给、推动中长期资金入市等举措都对股票市场中长期发展起着十分积极的作用。目前 A 股整体估值水平仍处于较低水平，积极看好 A 股的中长期投资价值。作为被动投资的基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，致力于为投资者提供分享中国经济增长的优质指数产品。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续完善制度、强化对制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》以及科创板发行交易、转融通交易等方面的最新法规、监管要求以及公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，加强各项政策法规和制度措施的落实执行，适应公司产品与业务发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 培育合规文化体系、严守合规底线、防控重大合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，加大力度开展员工合规风控教育培训，进一步树立、强化“诚信、规范、专业、稳健”

的基金行业文化理念和“忠实注意、谨慎勤勉”的信义义务意识，促进公司合规文化建设；持续完善制度流程和系统工具，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为。

(3) 坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

(4) 有计划、有重点地对投研交易、销售、运营、人员规范、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询建议，严格进行合规审查。

(6) 深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《关于进一步规范金融营销宣传行为的通知》等法律法规和监管政策。结合《全国法院民商事审判工作会议纪要》关于金融消费者权益保护的精神，持续优化投资者适当性管理机制流程，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”的职责义务，切实保障投资者合法权益。

(7) 提高认识，主动作为，积极践行“风险为本”的反洗钱工作方法，贯彻落实《法人金融机构洗钱和恐怖融资风险管理指引（试行）》等最新法规和监管要求，进一步完善洗钱风险管理体系，全面开展洗钱风险评估，深入推进洗钱风险识别与防控能力建设，切实保障资源投入，夯实制度基础，做好队伍建设、系统支持、宣传培训、内部审计、信息报送等各项工作，稳步推动反洗钱工作提质增效。

(8) 全面推动落实《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其配套规则，持续健全信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(9) 不断完善合规管控框架和机制，促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

截至 2019 年末，公司已通过 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达中证 800ETF 联接发起式 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 800ETF 联接发起式 C:本报告期内未实施利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 审计报告

安永华明（2020）审字第 60468000_G56 号

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全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 10 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 10 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

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管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 马婧

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2020 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	6,267,709.48
结算备付金		746,542.35
存出保证金		31,522.48
交易性金融资产	7.4.7.2	92,318,129.12
其中：股票投资		3,098,180.48
基金投资		89,055,951.52
债券投资		163,997.12
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		794,657.49
应收利息	7.4.7.5	1,551.18

应收股利		-
应收申购款		26,302.27
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	123,915.30
资产总计		100,310,329.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		317.78
应付赎回款		2,116,233.15
应付管理人报酬		2,104.38
应付托管费		701.45
应付销售服务费		3,047.73
应付交易费用	7.4.7.7	33,027.78
应交税费		177.32
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	40,716.61
负债合计		2,196,326.20
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	93,754,565.15
未分配利润	7.4.7.10	4,359,438.32
所有者权益合计		98,114,003.47
负债和所有者权益总计		100,310,329.67

注：1.本基金合同生效日为 2019 年 10 月 21 日，2019 年度实际报告期间为 2019 年 10 月 21 日至 2019 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日 2019 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0466 元，C 类基金份额净值 1.0463 元；基金份额总额 93,754,565.15 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 70,194,576.49 份，C 类基金份额总额 23,559,988.66 份。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2019 年 10 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019 年 10 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		5,761,129.50
1.利息收入		79,729.77
其中：存款利息收入	7.4.7.11	79,703.73
债券利息收入		26.04
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,278,153.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	34,513.26
基金投资收益	7.4.7.13	1,228,308.65
债券投资收益	7.4.7.14	13,404.00
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	1,927.25

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,352,236.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	51,010.29
减：二、费用		158,145.23
1. 管理人报酬		17,422.92
2. 托管费		5,807.61
3. 销售服务费		10,315.02
4. 交易费用	7.4.7.19	79,353.13
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		19.00
7. 其他费用	7.4.7.20	45,227.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,602,984.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,602,984.27

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 21 日，2019 年度实际报告期间为 2019 年 10 月 21 日至 2019 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2019 年 10 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 10 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	226,118,671.86	-	226,118,671.86
二、本期经营活动产生	-	5,602,984.27	5,602,984.27

的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-132,364,106.71	-1,243,545.95	-133,607,652.66
其中：1.基金申购款	10,063,785.63	44,518.98	10,108,304.61
2.基金赎回款	-142,427,892.34	-1,288,064.93	-143,715,957.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	93,754,565.15	4,359,438.32	98,114,003.47

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 21 日，2019 年度实际报告期间为 2019 年 10 月 21 日至 2019 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1401 号《关于准予易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2019 年 10 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 226,118,671.86 份基金份额，其中认购资金利息折合 22,373.46 份基金份额。本基金为契约型开放式

基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2019 年 10 月 14 日至 2019 年 10 月 17 日，募集金额总额为人民币 226,118,671.86 元，其中：有效净认购金额为人民币 226,096,298.40 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 22,373.46 元，经安永华明(2019)验字第 60468000_G24 号验资报告予以审验。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2019 年 10 月 21 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债)，并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工

具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、基金投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额，划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 基金投资收益/(损失)于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

(7) 债券投资收益/(损失)：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/(损失)，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具投资收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同,其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(4) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会审议;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰,由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让,按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得

的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所

得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2019 年 12 月 31 日	
活期存款	6,267,709.48	
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计	6,267,709.48	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,039,367.42	3,098,180.48	58,813.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	163,997.12	163,997.12
	银行间市场	-	-
	合计	163,997.12	163,997.12
资产支持证券	-	-	-
基金	84,762,528.30	89,055,951.52	4,293,423.22

其他	-	-	-
合计	87,965,892.84	92,318,129.12	4,352,236.28

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,178.97
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	335.90
应收债券利息	22.11
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	14.20
合计	1,551.18

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
----	-------------------------

其他应收款	123,915.30
待摊费用	-
合计	123,915.30

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	33,027.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	33,027.78

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	716.61
应付证券出借违约金	-
预提费用	40,000.00
合计	40,716.61

7.4.7.9 实收基金

易方达中证 800ETF 联接发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	112,394,758.46	112,394,758.46
本期申购	6,885,486.19	6,885,486.19
本期赎回（以“-”号填列）	-49,085,668.16	-49,085,668.16
本期末	70,194,576.49	70,194,576.49

易方达中证 800ETF 联接发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	113,723,913.40	113,723,913.40
本期申购	3,178,299.44	3,178,299.44
本期赎回（以“-”号填列）	-93,342,224.18	-93,342,224.18
本期末	23,559,988.66	23,559,988.66

注：1.本基金合同于 2019 年 10 月 21 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 226,118,671.86 份基金份额，其中认购资金利息折合 22,373.46 份基金份额。

2.申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

易方达中证 800ETF 联接发起式 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	864,721.87	3,057,373.17	3,922,095.04
本期基金份额交易产生的变动数	-140,371.97	-513,390.25	-653,762.22
其中：基金申购款	7,947.32	4,977.99	12,925.31
基金赎回款	-148,319.29	-518,368.24	-666,687.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	724,349.90	2,543,982.92	3,268,332.82

易方达中证 800ETF 联接发起式 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	386,026.12	1,294,863.11	1,680,889.23
本期基金份额交易产生的变动数	-148,584.11	-441,199.62	-589,783.73

其中：基金申购款	7,346.27	24,247.40	31,593.67
基金赎回款	-155,930.38	-465,447.02	-621,377.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	237,442.01	853,663.49	1,091,105.50

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 10 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	77,752.34
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,892.30
其他	59.09
合计	79,703.73

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 10 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	35,463,262.02
减：卖出股票成本总额	35,428,748.76
买卖股票差价收入	34,513.26

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 10 月 21 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	64,487,448.30
减：卖出/赎回基金成本总额	63,259,139.65
基金投资收益	1,228,308.65

7.4.7.14 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	82,411.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	68,999.31
减：应收利息总额	8.19
买卖债券差价收入	13,404.00

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,927.25
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,927.25

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1.交易性金融资产	4,352,236.28
——股票投资	58,813.06
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	4,293,423.22
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变	-

动产生的预估增值税	
合计	4,352,236.28

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	51,007.80
其他	2.49
合计	51,010.29

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	71,640.63
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	7,712.50
其中：申购费	-
赎回费	-
其他	7,712.50
合计	79,353.13

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,227.55
其他	0.00
合计	45,227.55

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人
广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
盈峰控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海祺泰宝股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海祺丰宝股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海聚莱康股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海聚宁康股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
珠海聚弘康股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人股东
易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,422.92
其中：支付销售机构的客户维护费	7,455.18

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,807.61

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证 800ETF 联接发起式 A	易方达中证 800ETF 联接发起式 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	428.10	428.10
广发证券	-	3.07	3.07
合计	-	431.17	431.17

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	易方达中证800ETF联接发起式A	易方达中证800ETF联接发起式C

基金合同生效日（2019 年 10 月 21 日）持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.2461%	-

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 21 日。基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达中证 800ETF 联接发起式 A

无。

易方达中证 800ETF 联接发起式 C

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年10月21日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	6,267,709.48	77,752.34

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 89,270,200 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 22.21%。

本基金在报告期内因赎回目标 ETF 基金份额而持有基金托管人发行的股票建设银行。

7.4.11 利润分配情况

易方达中证 800ETF 联接发起式 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 800ETF 联接发起式 C

本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113029	明阳转债	2019-12-18	2020-01-07	新发流通受限	100.00	100.00	620	61,998.91	61,998.91	-
113030	东风转债	2019-12-26	2020-01-20	新发流通受限	100.00	100.00	100	9,999.82	9,999.82	-
128084	木森转债	2019-12-18	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	310	30,999.46	30,999.46	-
128085	鸿达转债	2019-12-18	2020-01-08	新发流通受限	100.00	100.00	390	38,999.32	38,999.32	-
128086	国轩转债	2019-12-19	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	220	21,999.61	21,999.61	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019-12-31	重大事项停牌	39.39	2020-01-02	40.43	200	6,572.02	7,878.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察与合规管理总部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本金属股票基金，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。本基金为指数型基金，采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于中证 800ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此本基金具有与标的指数相似的风险收益特征。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.17%。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末
--------	-----

	2019年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	164,019.23

未评级	0.00
合计	164,019.23

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2019 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,267,709.48	-	-	-	6,267,709.48
结算备付金	746,542.35	-	-	-	746,542.35
存出保证金	31,522.48	-	-	-	31,522.48
交易性金融资产	-	-	163,997.12	92,154,132.00	92,318,129.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	794,657.49	794,657.49
应收利息	-	-	-	1,551.18	1,551.18
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	26,302.27	26,302.27
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	123,915.30	123,915.30
资产总计	7,045,774.31	-	163,997.12	93,100,558.24	100,310,329.6

					7
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	317.78	317.78
应付赎回款	-	-	-	2,116,233.15	2,116,233.15
应付管理人报酬	-	-	-	2,104.38	2,104.38
应付托管费	-	-	-	701.45	701.45
应付销售服务费	-	-	-	3,047.73	3,047.73
应付交易费用	-	-	-	33,027.78	33,027.78
应交税费	-	-	-	177.32	177.32
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	40,716.61	40,716.61
负债总计	-	-	-	2,196,326.20	2,196,326.20
					0
利率敏感度缺口	7,045,774.31	-	163,997.12	90,904,232.04	98,114,003.47

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,098,180.48	3.16
交易性金融资产—基金投资	89,055,951.52	90.77
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	92,154,132.00	93.93

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2019 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	4,396,246.71
	2.业绩比较基准下降 5%	-4,396,246.71

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 92,310,251.12 元，属于第二层次的余额为 7,878.00 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,098,180.48	3.09
	其中：股票	3,098,180.48	3.09
2	基金投资	89,055,951.52	88.78
3	固定收益投资	163,997.12	0.16
	其中：债券	163,997.12	0.16
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,014,251.83	6.99

8	其他各项资产	977,948.72	0.97
9	合计	100,310,329.67	100.00

8.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	89,055,951.52	90.77

8.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.3.1 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	4,408.00	0.00
B	采矿业	140,377.00	0.14
C	制造业	1,034,634.48	1.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	112,621.00	0.11
E	建筑业	106,544.00	0.11
F	批发和零售业	55,978.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	137,768.00	0.14
H	住宿和餐饮业	4,932.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,133.00	0.11
J	金融业	1,190,912.00	1.21
K	房地产业	122,128.00	0.12
L	租赁和商务服务业	33,434.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	20,117.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,110.00	0.00
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	13,394.00	0.01
S	综合	12,690.00	0.01
	合计	3,098,180.48	3.16

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,100	264,926.00	0.27
2	600519	贵州茅台	100	118,300.00	0.12
3	600036	招商银行	2,900	108,982.00	0.11
4	601166	兴业银行	4,100	81,180.00	0.08
5	600276	恒瑞医药	900	78,768.00	0.08
6	600030	中信证券	2,200	55,660.00	0.06
7	600887	伊利股份	1,700	52,598.00	0.05
8	600900	长江电力	2,500	45,950.00	0.05
9	600016	民生银行	6,900	43,539.00	0.04
10	601328	交通银行	7,700	43,351.00	0.04
11	600000	浦发银行	3,300	40,821.00	0.04
12	601288	农业银行	10,700	39,483.00	0.04
13	600837	海通证券	2,300	35,558.00	0.04
14	601398	工商银行	6,000	35,280.00	0.04
15	601601	中国太保	900	34,056.00	0.03
16	601668	中国建筑	5,900	33,158.00	0.03
17	600585	海螺水泥	600	32,880.00	0.03
18	600048	保利地产	2,000	32,360.00	0.03
19	600031	三一重工	1,700	28,985.00	0.03
20	600309	万华化学	500	28,085.00	0.03
21	601888	中国国旅	300	26,685.00	0.03
22	601688	华泰证券	1,300	26,403.00	0.03
23	601211	国泰君安	1,300	24,037.00	0.02
24	601169	北京银行	4,200	23,856.00	0.02
25	600104	上汽集团	1,000	23,850.00	0.02
26	600009	上海机场	300	23,625.00	0.02
27	601988	中国银行	5,900	21,771.00	0.02
28	603288	海天味业	200	21,502.00	0.02
29	600690	海尔智家	1,100	21,450.00	0.02
30	601012	隆基股份	800	19,864.00	0.02
31	601818	光大银行	4,500	19,845.00	0.02

32	600028	中国石化	3,800	19,418.00	0.02
33	601766	中国中车	2,700	19,278.00	0.02
34	601229	上海银行	2,000	18,980.00	0.02
35	600919	江苏银行	2,600	18,824.00	0.02
36	603259	药明康德	200	18,424.00	0.02
37	601088	中国神华	1,000	18,250.00	0.02
38	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.02
39	601899	紫金矿业	3,900	17,901.00	0.02
40	601628	中国人寿	500	17,435.00	0.02
41	601857	中国石油	2,700	15,741.00	0.02
42	600570	恒生电子	200	15,546.00	0.02
43	600050	中国联通	2,600	15,314.00	0.02
44	601009	南京银行	1,700	14,909.00	0.02
45	600406	国电南瑞	700	14,826.00	0.02
46	601336	新华保险	300	14,745.00	0.02
47	600999	招商证券	800	14,632.00	0.01
48	600019	宝钢股份	2,500	14,350.00	0.01
49	601006	大秦铁路	1,700	13,957.00	0.01
50	600015	华夏银行	1,800	13,806.00	0.01
51	601939	建设银行	1,900	13,737.00	0.01
52	601390	中国中铁	2,300	13,662.00	0.01
53	601989	中国重工	2,600	13,624.00	0.01
54	601186	中国铁建	1,300	13,182.00	0.01
55	600741	华域汽车	500	12,995.00	0.01
56	600703	三安光电	700	12,852.00	0.01
57	601155	新城控股	300	11,616.00	0.01
58	600352	浙江龙盛	800	11,576.00	0.01
59	600340	华夏幸福	400	11,480.00	0.01
60	600588	用友网络	400	11,360.00	0.01
61	600436	片仔癀	100	10,987.00	0.01
62	601225	陕西煤业	1,200	10,788.00	0.01
63	600958	东方证券	1,000	10,760.00	0.01
64	601901	方正证券	1,200	10,404.00	0.01
65	600383	金地集团	700	10,150.00	0.01
66	600547	山东黄金	300	9,786.00	0.01
67	600346	恒力石化	600	9,648.00	0.01
68	600660	福耀玻璃	400	9,596.00	0.01
69	601669	中国电建	2,200	9,548.00	0.01
70	600271	航天信息	400	9,268.00	0.01
71	600745	闻泰科技	100	9,250.00	0.01
72	601377	兴业证券	1,300	9,204.00	0.01
73	600886	国投电力	1,000	9,180.00	0.01
74	601138	工业富联	500	9,135.00	0.01
75	601985	中国核电	1,800	9,000.00	0.01

76	600584	长电科技	400	8,792.00	0.01
77	601111	中国国航	900	8,721.00	0.01
78	603993	洛阳钼业	2,000	8,720.00	0.01
79	600029	南方航空	1,200	8,616.00	0.01
80	600010	包钢股份	6,400	8,448.00	0.01
81	600183	生益科技	400	8,368.00	0.01
82	601933	永辉超市	1,100	8,294.00	0.01
83	601877	正泰电器	300	8,040.00	0.01
84	600196	复星医药	300	7,980.00	0.01
85	600426	华鲁恒升	400	7,948.00	0.01
86	601108	财通证券	700	7,938.00	0.01
87	600438	通威股份	600	7,878.00	0.01
87	603799	华友钴业	200	7,878.00	0.01
89	601788	光大证券	600	7,860.00	0.01
90	600795	国电电力	3,300	7,722.00	0.01
91	601997	贵阳银行	800	7,648.00	0.01
92	600606	绿地控股	1,100	7,645.00	0.01
93	600111	北方稀土	700	7,588.00	0.01
94	600061	国投资本	500	7,570.00	0.01
95	600115	东方航空	1,300	7,553.00	0.01
96	600018	上港集团	1,300	7,501.00	0.01
97	600201	生物股份	400	7,488.00	0.01
98	601607	上海医药	400	7,348.00	0.01
99	600089	特变电工	1,100	7,315.00	0.01
100	601128	常熟银行	800	7,288.00	0.01
101	600705	中航资本	1,500	7,275.00	0.01
102	600011	华能国际	1,300	7,254.00	0.01
103	601099	太平洋	1,900	7,201.00	0.01
104	600536	中国软件	100	7,169.00	0.01
105	601555	东吴证券	700	6,993.00	0.01
106	600177	雅戈尔	1,000	6,970.00	0.01
107	603019	中科曙光	200	6,916.00	0.01
108	601600	中国铝业	1,900	6,726.00	0.01
109	600176	中国巨石	600	6,540.00	0.01
110	600109	国金证券	700	6,510.00	0.01
111	600487	亨通光电	400	6,504.00	0.01
111	600893	航发动力	300	6,504.00	0.01
113	601800	中国交建	700	6,412.00	0.01
114	600100	同方股份	700	6,139.00	0.01
115	600739	辽宁成大	400	6,092.00	0.01
116	600516	方大炭素	500	6,080.00	0.01
117	601233	桐昆股份	400	5,996.00	0.01
118	600522	中天科技	700	5,810.00	0.01
119	601919	中远海控	1,100	5,797.00	0.01

120	601872	招商轮船	700	5,782.00	0.01
121	600066	宇通客车	400	5,700.00	0.01
122	600637	东方明珠	600	5,616.00	0.01
123	601618	中国中冶	2,000	5,600.00	0.01
124	601998	中信银行	900	5,553.00	0.01
125	600221	海航控股	3,200	5,536.00	0.01
126	600926	杭州银行	600	5,496.00	0.01
127	600498	烽火通信	200	5,490.00	0.01
128	601727	上海电气	1,100	5,478.00	0.01
129	601838	成都银行	600	5,442.00	0.01
130	600068	葛洲坝	800	5,344.00	0.01
131	600801	华新水泥	200	5,286.00	0.01
132	601198	东兴证券	400	5,256.00	0.01
133	600004	白云机场	300	5,235.00	0.01
134	600583	海油工程	700	5,166.00	0.01
135	600673	东阳光	500	5,120.00	0.01
136	600362	江西铜业	300	5,079.00	0.01
137	600867	通化东宝	400	5,060.00	0.01
138	600674	川投能源	500	4,925.00	0.01
139	603899	晨光文具	100	4,874.00	0.00
140	600038	中直股份	100	4,771.00	0.00
141	600023	浙能电力	1,200	4,752.00	0.00
142	603517	绝味食品	100	4,645.00	0.00
143	601881	中国银河	400	4,644.00	0.00
144	600535	天士力	300	4,626.00	0.00
145	600170	上海建工	1,300	4,602.00	0.00
146	600528	中铁工业	400	4,600.00	0.00
147	600208	新湖中宝	1,200	4,536.00	0.00
148	601117	中国化学	700	4,508.00	0.00
149	600219	南山铝业	2,000	4,480.00	0.00
150	601878	浙商证券	400	4,452.00	0.00
151	601021	春秋航空	100	4,389.00	0.00
152	600909	华安证券	600	4,380.00	0.00
153	600150	中国船舶	200	4,352.00	0.00
154	600118	中国卫星	200	4,274.00	0.00
155	600489	中金黄金	500	4,240.00	0.00
156	600704	物产中大	800	4,200.00	0.00
157	600879	航天电子	700	4,186.00	0.00
158	601018	宁波港	1,100	4,180.00	0.00
159	600369	西南证券	800	4,152.00	0.00
160	600410	华胜天成	400	4,124.00	0.00
161	600446	金证股份	200	4,116.00	0.00
162	600642	申能股份	700	4,067.00	0.00
163	600079	人福医药	300	4,053.00	0.00

163	600663	陆家嘴	300	4,053.00	0.00
165	600482	中国动力	200	4,000.00	0.00
166	600256	广汇能源	1,200	3,972.00	0.00
166	601168	西部矿业	600	3,972.00	0.00
168	600655	豫园股份	500	3,920.00	0.00
169	600325	华发股份	500	3,915.00	0.00
170	600549	厦门钨业	300	3,912.00	0.00
171	601231	环旭电子	200	3,846.00	0.00
172	601808	中海油服	200	3,840.00	0.00
173	600728	佳都科技	400	3,752.00	0.00
174	601992	金隅集团	1,000	3,730.00	0.00
175	600572	康恩贝	600	3,690.00	0.00
176	600466	蓝光发展	500	3,685.00	0.00
177	600875	东方电气	400	3,676.00	0.00
178	600027	华电国际	1,000	3,670.00	0.00
179	600143	金发科技	500	3,640.00	0.00
180	600820	隧道股份	600	3,624.00	0.00
181	600153	建发股份	400	3,596.00	0.00
182	600699	均胜电子	200	3,580.00	0.00
183	600332	白云山	100	3,561.00	0.00
184	601633	长城汽车	400	3,540.00	0.00
185	601238	广汽集团	300	3,507.00	0.00
186	600497	驰宏锌锗	800	3,504.00	0.00
187	600521	华海药业	200	3,452.00	0.00
188	600885	宏发股份	100	3,445.00	0.00
189	600718	东软集团	300	3,405.00	0.00
190	600567	山鹰纸业	900	3,393.00	0.00
191	600273	嘉化能源	300	3,375.00	0.00
192	600845	宝信软件	100	3,290.00	0.00
193	600297	广汇汽车	1,000	3,260.00	0.00
194	600266	城建发展	400	3,240.00	0.00
195	600021	上海电力	400	3,220.00	0.00
196	600839	四川长虹	1,100	3,201.00	0.00
197	600881	亚泰集团	1,000	3,190.00	0.00
198	600967	内蒙一机	300	3,189.00	0.00
199	600376	首开股份	400	3,188.00	0.00
200	600188	兖州煤业	300	3,168.00	0.00
201	600760	中航沈飞	100	3,160.00	0.00
202	601005	重庆钢铁	1,700	3,145.00	0.00
203	601216	君正集团	1,000	3,130.00	0.00
204	600816	安信信托	700	3,108.00	0.00
205	600380	健康元	300	3,105.00	0.00
206	600415	小商品城	800	3,096.00	0.00
207	600315	上海家化	100	3,094.00	0.00

207	600460	士兰微	200	3,094.00	0.00
209	600398	海澜之家	400	3,072.00	0.00
210	600298	安琪酵母	100	3,067.00	0.00
211	600895	张江高科	200	3,062.00	0.00
212	601333	广深铁路	1,000	3,060.00	0.00
213	600977	中国电影	200	3,044.00	0.00
214	601066	中信建投	100	3,040.00	0.00
215	600811	东方集团	900	3,024.00	0.00
216	601898	中煤能源	600	3,012.00	0.00
217	603885	吉祥航空	200	3,000.00	0.00
218	600755	厦门国贸	400	2,936.00	0.00
219	600064	南京高科	300	2,925.00	0.00
219	600094	大名城	500	2,925.00	0.00
221	600160	巨化股份	400	2,912.00	0.00
222	601699	潞安环能	400	2,904.00	0.00
223	603156	养元饮品	100	2,903.00	0.00
224	600643	爱建集团	300	2,880.00	0.00
225	600754	锦江酒店	100	2,871.00	0.00
226	601866	中远海发	1,100	2,849.00	0.00
227	600085	同仁堂	100	2,818.00	0.00
228	600155	华创阳安	200	2,806.00	0.00
229	600161	天坛生物	100	2,794.00	0.00
230	600959	江苏有线	700	2,786.00	0.00
231	600808	马钢股份	900	2,763.00	0.00
232	600282	南钢股份	800	2,760.00	0.00
233	600511	国药股份	100	2,729.00	0.00
234	600373	中文传媒	200	2,722.00	0.00
235	600392	盛和资源	300	2,721.00	0.00
235	601577	长沙银行	300	2,721.00	0.00
237	600022	山东钢铁	1,900	2,717.00	0.00
237	600166	福田汽车	1,300	2,717.00	0.00
239	600260	凯乐科技	200	2,714.00	0.00
240	600037	歌华有线	300	2,703.00	0.00
241	600884	杉杉股份	200	2,702.00	0.00
242	600216	浙江医药	200	2,670.00	0.00
243	600167	联美控股	200	2,632.00	0.00
244	600640	号百控股	100	2,581.00	0.00
245	600782	新钢股份	500	2,565.00	0.00
246	600026	中远海能	400	2,552.00	0.00
247	600597	光明乳业	200	2,538.00	0.00
247	600737	中粮糖业	300	2,538.00	0.00
249	600409	三友化工	400	2,528.00	0.00
250	600138	中青旅	200	2,520.00	0.00
250	600777	新潮能源	1,200	2,520.00	0.00

252	600435	北方导航	300	2,496.00	0.00
253	600863	内蒙华电	900	2,475.00	0.00
254	601118	海南橡胶	500	2,460.00	0.00
255	600848	上海临港	100	2,455.00	0.00
256	600804	鹏博士	400	2,448.00	0.00
257	600566	济川药业	100	2,418.00	0.00
258	600580	卧龙电驱	200	2,404.00	0.00
259	601958	金钼股份	300	2,403.00	0.00
260	601098	中南传媒	200	2,388.00	0.00
261	600039	四川路桥	700	2,352.00	0.00
262	601360	三六零	100	2,351.00	0.00
263	601000	唐山港	900	2,340.00	0.00
264	600733	北汽蓝谷	400	2,336.00	0.00
265	601106	中国一重	800	2,328.00	0.00
266	600008	首创股份	700	2,303.00	0.00
267	601228	广州港	600	2,298.00	0.00
268	601966	玲珑轮胎	100	2,293.00	0.00
269	600649	城投控股	400	2,288.00	0.00
270	601718	际华集团	700	2,282.00	0.00
271	601319	中国人保	300	2,277.00	0.00
272	600823	世茂股份	500	2,250.00	0.00
273	600515	海航基础	500	2,230.00	0.00
274	600908	无锡银行	400	2,220.00	0.00
274	603077	和邦生物	1,500	2,220.00	0.00
276	600348	阳泉煤业	400	2,212.00	0.00
277	601179	中国西电	600	2,184.00	0.00
278	600060	海信视像	200	2,170.00	0.00
279	601598	中国外运	500	2,130.00	0.00
280	600500	中化国际	400	2,120.00	0.00
281	600025	华能水电	500	2,110.00	0.00
282	600970	中材国际	300	2,091.00	0.00
283	600776	东方通信	100	2,083.00	0.00
284	603858	步长制药	100	2,062.00	0.00
285	600258	首旅酒店	100	2,061.00	0.00
286	600507	方大特钢	200	2,012.00	0.00
287	600418	江淮汽车	400	2,008.00	0.00
288	600158	中体产业	200	2,006.00	0.00
289	603000	人民网	100	1,979.00	0.00
290	600869	智慧能源	400	1,960.00	0.00
291	600388	龙净环保	200	1,950.00	0.00
292	600598	北大荒	200	1,948.00	0.00
293	601717	郑煤机	300	1,941.00	0.00
294	600989	宝丰能源	200	1,902.00	0.00
295	600901	江苏租赁	300	1,896.00	0.00

296	600664	哈药股份	500	1,895.00	0.00
297	600717	天津港	300	1,884.00	0.00
298	601608	中信重工	500	1,860.00	0.00
299	600307	酒钢宏兴	900	1,854.00	0.00
300	601212	白银有色	500	1,840.00	0.00
301	600633	浙数文化	200	1,830.00	0.00
302	601880	大连港	900	1,827.00	0.00
303	600277	亿利洁能	400	1,824.00	0.00
304	600545	卓郎智能	300	1,821.00	0.00
305	600291	西水股份	200	1,798.00	0.00
306	600827	百联股份	200	1,796.00	0.00
307	600125	铁龙物流	300	1,794.00	0.00
308	600565	迪马股份	500	1,790.00	0.00
309	600748	上实发展	300	1,782.00	0.00
310	600478	科力远	400	1,760.00	0.00
311	600968	海油发展	600	1,758.00	0.00
312	600017	日照港	600	1,746.00	0.00
312	600120	浙江东方	200	1,746.00	0.00
314	601689	拓普集团	100	1,743.00	0.00
315	600648	外高桥	100	1,737.00	0.00
316	600499	科达洁能	400	1,732.00	0.00
317	600339	中油工程	500	1,695.00	0.00
318	600645	中源协和	100	1,693.00	0.00
319	601975	招商南油	600	1,686.00	0.00
320	601236	红塔证券	100	1,677.00	0.00
321	600835	上海机电	100	1,657.00	0.00
322	600582	天地科技	500	1,595.00	0.00
323	600073	上海梅林	200	1,594.00	0.00
324	600171	上海贝岭	100	1,575.00	0.00
325	600787	中储股份	300	1,563.00	0.00
326	601678	滨化股份	300	1,533.00	0.00
327	600317	营口港	600	1,530.00	0.00
328	601928	凤凰传媒	200	1,522.00	0.00
329	600557	康缘药业	100	1,474.00	0.00
330	600126	杭钢股份	300	1,467.00	0.00
331	600751	海航科技	500	1,465.00	0.00
332	601611	中国核建	200	1,426.00	0.00
333	600372	中航电子	100	1,424.00	0.00
334	600998	九州通	100	1,415.00	0.00
335	600859	王府井	100	1,399.00	0.00
336	601019	山东出版	200	1,390.00	0.00
337	600759	洲际油气	500	1,385.00	0.00
338	600639	浦东金桥	100	1,350.00	0.00
339	601001	大同煤业	300	1,320.00	0.00

340	600056	中国医药	100	1,305.00	0.00
340	600062	华润双鹤	100	1,305.00	0.00
342	600316	洪都航空	100	1,303.00	0.00
343	600312	平高电气	200	1,292.00	0.00
344	600575	淮河能源	500	1,285.00	0.00
345	601326	秦港股份	400	1,276.00	0.00
346	600233	圆通速递	100	1,265.00	0.00
347	600757	长江传媒	200	1,232.00	0.00
348	601016	节能风电	500	1,205.00	0.00
349	600657	信达地产	300	1,197.00	0.00
350	600195	中牧股份	100	1,155.00	0.00
351	601828	美凯龙	100	1,133.00	0.00
352	601698	中国卫通	100	1,132.00	0.00
352	603328	依顿电子	100	1,132.00	0.00
354	600428	中远海特	300	1,122.00	0.00
355	603766	隆鑫通用	300	1,119.00	0.00
356	601200	上海环境	100	1,110.00	0.00
357	600299	安迪苏	100	1,106.00	0.00
358	600862	中航高科	100	1,102.00	0.00
359	601801	皖新传媒	200	1,096.00	0.00
360	600770	综艺股份	200	1,078.00	0.00
361	600141	兴发集团	100	1,028.00	0.00
362	600765	中航重机	100	1,023.00	0.00
363	600985	淮北矿业	100	999.00	0.00
364	600350	山东高速	200	982.00	0.00
365	600006	东风汽车	200	916.00	0.00
366	600707	彩虹股份	200	840.00	0.00
367	600390	五矿资本	100	826.00	0.00
368	600996	贵广网络	100	805.00	0.00
369	600058	五矿发展	100	802.00	0.00
370	601139	深圳燃气	100	783.00	0.00
371	600928	西安银行	100	777.00	0.00
372	601162	天风证券	100	736.00	0.00
373	600874	创业环保	100	719.00	0.00
374	601298	青岛港	100	687.00	0.00
375	600623	华谊集团	100	665.00	0.00
376	600098	广州发展	100	654.00	0.00
377	600335	国机汽车	100	580.00	0.00
378	601969	海南矿业	100	579.00	0.00
379	601003	柳钢股份	100	565.00	0.00
380	601860	紫金银行	100	562.00	0.00
381	601068	中铝国际	100	554.00	0.00
382	600939	重庆建工	100	481.00	0.00

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601512	中新集团	34,792.66	0.04
2	603053	成都燃气	17,221.60	0.02
3	603109	神驰机电	12,571.92	0.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	3,040,386.00	3.10
2	600519	贵州茅台	2,302,908.00	2.35
3	600036	招商银行	1,257,421.00	1.28
4	601166	兴业银行	929,194.00	0.95
5	600276	恒瑞医药	817,412.00	0.83
6	600030	中信证券	605,475.00	0.62
7	600887	伊利股份	586,976.00	0.60
8	600016	民生银行	507,210.00	0.52
9	601328	交通银行	492,853.00	0.50
10	600900	长江电力	463,710.00	0.47
11	600000	浦发银行	456,889.00	0.47
12	601288	农业银行	454,444.00	0.46
13	601398	工商银行	409,594.00	0.42
14	600837	海通证券	384,588.00	0.39
15	600048	保利地产	364,843.00	0.37
16	601668	中国建筑	364,803.00	0.37
17	601601	中国太保	355,272.00	0.36
18	601888	中国国旅	339,096.00	0.35
19	600309	万华化学	306,968.00	0.31
20	600009	上海机场	306,475.00	0.31

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	64,586.18
卖出股票收入（成交）总额	35,463,262.02

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	163,997.12	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	163,997.12	0.17

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113029	明阳转债	620	61,998.91	0.06
2	128085	鸿达转债	390	38,999.32	0.04
3	128084	木森转债	310	30,999.46	0.03
4	128086	国轩转债	220	21,999.61	0.02
5	113030	东风转债	100	9,999.82	0.01

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 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。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 2019 年 7 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对兴业银行股份有限公司信用卡中心 1、2016 年 1 月至 2018 年 1 月在为部分客户办理信用卡业务时未遵守总授信额度管理制度；2、2016 年至 2018 年 8 月对部分信用卡申请人资信水平调查严重不尽职的违法违规行为，责令改正，并处罚款 40 万元。

2019 年 7 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对招商银行股份有限公司信用卡中心 2016 年 9 月至 2018 年 6 月在为部分客户办理信用卡业务时，未遵守总授信额度管理制度的违法违规事实，责令改正，并处罚款 20 万元。

2019 年 4 月 2 日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局针对中国民生银行股份有限公司以贷收贷，掩盖资产真实质量，以贷转存，虚增存贷款规模的违法违规事实，处以罚款 100 万元的行政处罚。

2019 年 4 月 2 日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局针对中国民生银行股份有限公司贷后管理不到位，以贷收贷，掩盖资产真实质量，贴现资金回流作银行承兑汇票保证金，滚动循环签发银行承兑汇票的违法违规事实，处以罚款 100 万元的行政处罚。

2019 年 4 月 2 日，中国银行保险监督管理委员会大连监管局针对中国民生银行股份有限公司贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金的违法违规事实，处以罚款 50 万元的行政处罚。

2019 年 12 月 14 日，中国银行保险监督管理委员会北京监管局针对中国民生银行股份有限公司如下违法违规事实：1、总行同业票据业务管理失控；2、总行违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产；3、总行案件风险信息报送管理不到位；4、总行未有效管理承兑业务；5、总行办

理无真实贸易背景承兑业务；6、总行承兑业务质押资金来源为本行贷款；7、银川分行为已注销法人公司办理票据贴现业务；8、杭州分行为票据中介办理票据贴现业务；9、上海自贸区分行为票据中介办理票据贴现业务；10、福州分行、苏州分行、郑州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实，处以责令改正，并处罚款 700 万元的行政处罚。

本基金为目标 ETF 的联接基金，上述股票系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除招商银行、兴业银行外，本基金目标 ETF 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。除招商银行、兴业银行、民生银行外，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。

8.13.2 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。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	31,522.48
2	应收证券清算款	794,657.49
3	应收股利	-
4	应收利息	1,551.18
5	应收申购款	26,302.27
6	其他应收款	123,915.30
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	977,948.72

8.13.4 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。

8.13.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达中证 800ETF 联接发起式 A	1,506	46,609.94	10,179,563.26	14.50%	60,015,013.23	85.50%
易方达中证 800ETF 联接发起式 C	606	38,877.87	2,000.00	0.01%	23,557,988.66	99.99%
合计	2,112	44,391.37	10,181,563.26	10.86%	83,573,001.89	89.14%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达中证 800ETF 联接发起式 A	6,356.31	0.0091%
	易方达中证 800ETF 联接发起式 C	100.02	0.0004%
	合计	6,456.33	0.0069%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达中证 800ETF 联接发起式 A	0
	易方达中证 800ETF 联接发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	易方达中证 800ETF 联	0

开放式基金	接发起式 A	
	易方达中证 800ETF 联接发起式 C	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	10.6661%	10,000,000.00	10.6661%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	10.6661%	10,000,000.00	10.6661%	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 800ETF 联接发起式 A	易方达中证 800ETF 联接发起式 C
基金合同生效日(2019 年 10 月 21 日)基金份额总额	112,394,758.46	113,723,913.40
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,885,486.19	3,178,299.44
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	49,085,668.16	93,342,224.18
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	70,194,576.49	23,559,988.66

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 21 日。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告,聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期,基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

报告期内,公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对我司采取责令改正措施的决定,对公司提出整改要求。公司已及时完成了整改。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中金财富	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	35,463,262.02	100.00%	33,027.78	100.00%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中信证券华南	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增中银国际证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、招商证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、平安证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东方证券股份有限公司各一个交易单元；新增中国中金财富证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、安信证券股份有限公司各两个交易单元；新增中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长城证券股份有限公司各三个交易单元；新增广发证券股份有限公司四个交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据基金所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	31,081.70	37.72%	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	51,329.80	62.28%	-	-	-	-	151,515,849.30	100.00%
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
信达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西部 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏 东财	-	-	-	-	-	-	-	-	-
南京 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通	-	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券 华南	-	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-10-22
2	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开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-10-22
3	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加方正证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-11-08
4	易方达基金管理有限公司旗下部分开放式基金增加中信建投证券为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-11-18
5	易方达基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-12-31
6	易方达基金管理有限公司关于易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同、托管协议部分条款的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-12-31

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的文件；
2. 《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基金合同》；

3.《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、营业执照。

12.2 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。

12.3 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

二〇二〇年三月三十一日