

# 易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

## 2020 年第 3 季度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

## § 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 2020 年 10 月 26 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	易方达中证 800ETF
场内简称	ZZ800ETF、中证 800ETF
基金主代码	515810
交易代码	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
报告期末基金份额总额	86,908,843.00 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。
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

### § 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 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	22,846,872.48
2.本期利润	21,148,034.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.2053
4.期末基金资产净值	110,418,570.10
5.期末基金份额净值	1.2705

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	15.35%	1.61%	9.03%	1.61%	6.32%	0.00%
过去六个月	36.16%	1.33%	24.07%	1.33%	12.09%	0.00%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	27.05%	1.42%	21.50%	1.41%	5.55%	0.01%

#### 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 800 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  
 (2019 年 10 月 8 日至 2020 年 9 月 30 日)



注：1.本基金合同于 2019 年 10 月 8 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。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 27.05%，同期业绩比较基准收益率为 21.50%。

## § 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		
林伟斌	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发起式联接基金的基金经理、易方达中证红利交易型开放式指数证券投资基金	2019-10-08	-	12 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

	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发起式联接基金的基金经理、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、指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员				助理、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理、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	本基金的基金经理、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 100 交易型开放式指数基金的基金经理、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达银行指数分级证券投资基金的基金经理 (自 2017 年 07 月 18 日至 2020 年 08 月 06 日)、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联接基金的基金经理、易方达中小板	2019-10-08	-	13 年	硕士研究生,具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计,易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员、基金经理助理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、易方达深证成指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、易方达标普医疗保健指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普生物科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、易方达标普信息科技指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。

<p>指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达并购重组指数分级证券投资基金的基金经理、易方达标普 500 指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达香港恒生综合小型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理、易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证浙江新动能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证银行指数证券投资基金(LOF)的基金经理</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，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于

社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 8 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

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。报告期内，本基金主要采取完全复制法的投资策略，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而进行相应调整。

中证 800 指数覆盖 A 股 28 个申万一级行业，由各行业中市值排名靠前的上市公司组成，指数的二级市场表现主要受经济发展形势、市场流动性、投资者风险偏好等因素影响。经济方面，9 月 PMI 继续回升，其中制造业、非制造业商务活动、服务业景气度均继续上升，建筑业高位持平；8 月规模以上工业企业利润当月同比增长 19.1%，规模以上工业增加值当月同比增长 5.6%，以上数据均显示国内经济基本面正在温和复苏。货币和流动性的边际变化是影响投资者的风险偏好与资产价格的重要因素，当前 A 股部分行业估值较高，对利率和流动性的



敏感性明显上升。三季度，市场流动性出现边际收紧的迹象，与此同时，市场担忧经济刺激政策退出对经济复苏进展的影响、疫情可能出现的再度爆发对经济的冲击、中美摩擦加剧等外围不确定性因素的干扰，大盘走势呈现冲高回落态势。行业上，休闲服务、国防军工、电气设备以及汽车行业表现较好；通信、商业贸易、计算机表现较差。三季度，中证 800 指数上涨 9%。

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。

#### 4.5 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 1.2705 元，本报告期份额净值增长率为 15.35%，同期业绩比较基准收益率为 9.03%，年化跟踪误差 1.94%，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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	101,647,053.53	90.18
	其中：股票	101,647,053.53	90.18
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,348,171.06	7.41
7	其他资产	2,715,214.17	2.41

8	合计	112,710,438.76	100.00
---	----	----------------	--------

注：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。

## 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	1,152,600.40	1.04
B	采矿业	2,198,460.95	1.99
C	制造业	53,777,040.55	48.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,964,655.60	1.78
E	建筑业	1,646,114.12	1.49
F	批发和零售业	2,080,302.20	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	2,572,370.88	2.33
H	住宿和餐饮业	134,596.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,068,760.81	4.59
J	金融业	22,289,219.76	20.19
K	房地产业	3,563,191.66	3.23
L	租赁和商务服务业	1,884,886.00	1.71
M	科学研究和技术服务业	685,004.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	284,972.80	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	143,113.00	0.13
Q	卫生和社会工作	1,136,914.60	1.03
R	文化、体育和娱乐业	841,417.20	0.76
S	综合	223,475.00	0.20
	合计	101,647,095.53	92.06

### 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	600519	贵州茅台	2,300	3,837,550.00	3.48
2	601318	中国平安	49,400	3,767,244.00	3.41
3	000858	五粮液	9,300	2,055,300.00	1.86
4	600036	招商银行	47,115	1,696,140.00	1.54
5	000333	美的集团	23,300	1,691,580.00	1.53
6	600276	恒瑞医药	17,000	1,526,940.00	1.38
7	000651	格力电器	23,100	1,231,230.00	1.12
8	600030	中信证券	38,900	1,168,167.00	1.06
9	002475	立讯精密	20,199	1,153,968.87	1.05
10	600887	伊利股份	27,635	1,063,947.50	0.96

#### 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

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC2012	IC2012	2	2,400,160.00	-123,440.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。
IF2012	IF2012	4	5,405,760.00	-226,380.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效的流动性管

					理, 以更好地跟踪标的指数, 实现投资目标。
公允价值变动总额合计(元)					-349,820.00
股指期货投资本期收益(元)					1,598,070.87
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-749,440.00

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货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, 以套期保值为目的, 按照相关法律法规的有关规定, 主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理, 本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时, 通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险对冲需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用, 降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差, 达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内, 本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

### 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 2020 年 7 月 28 日, 中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对招商银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行作出责令改正、并处罚款 100 万元的行政处罚决定: 1、2019 年 7 月, 该中心对某客户个人信息未尽安全保护义务; 2、2014 年 12 月至 2019 年 5 月, 该中心对某信用卡申请人资信水平调查严重不审慎。

2019 年 11 月 18 日, 珠海市交通运输局对珠海格力电器股份有限公司违反《超限运输车辆行驶公路管理规定》第四十三条的行为作出“罚款 4000 元”的行政处罚决定。

2019 年 12 月 4 日, 珠海市交通运输局对珠海格力电器股份有限公司违反《超限运输车辆行驶公路管理规定》第四十三条的行为作出“罚款 4000 元”的行政处罚决定。

本基金为指数型基金, 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、格力电器外, 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。

5.11.2 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	1,080,836.79
2	应收证券清算款	1,595,677.45
3	应收股利	-
4	应收利息	994.40
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	37,705.53
8	其他	-
9	合计	2,715,214.17

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

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	110,908,843.00
报告期基金总申购份额	57,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	81,000,000.00
报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	86,908,843.00

## § 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 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
中国建设银行股份有限公司—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	1	2020年07月01日~2020年09月30日	42,060,300.00	3,950,000.00	9,600,000.00	36,410,300.00	41.89%
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；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金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中证800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 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
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

二〇二〇年十月二十八日