

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

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 8 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	6
2.5	其他相关资料	6
§ 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	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6	审计报告	16
6.1	审计意见	16
6.2	形成审计意见的基础	17
6.3	其他信息	17
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4	报表附注	23
§ 8	投资组合报告	47
8.1	期末基金资产组合情况	47
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3	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	48
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	67

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	68
8.6	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	69
8.7	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	69
8.8	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贵金属投资明细	69
8.9	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	69
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	69
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12	投资组合报告附注	69
§ 9	基金份额持有人信息	70
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2	期末上市基金前十名持有人	71
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.4	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	72
§ 10	开放式基金份额变动	72
§ 11	重大事件揭示	72
11.1	基金份额持有人大会决议	72
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	72
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4	基金投资策略的改变	72
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	73
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8	其他重大事件	74
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1	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	75
§ 13	备查文件目录	76
13.1	备查文件目录	76
13.2	存放地点	76
13.3	查阅方式	76

§ 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
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
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	401,908,843.00 份
基金合同存续期	不定期
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

2.2 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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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 8 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-40,523,050.49
本期利润	-21,967,668.40
加权平均基金份额本期利润	-0.0360
本期加权平均净值利润率	-3.78%
本期基金份额净值增长率	-0.24%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末
期末可供分配利润	-16,016,979.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0399
期末基金资产净值	400,942,345.95
期末基金份额净值	0.9976
3.1.3 累计期末指标	2019 年末
基金份额累计净值增长率	-0.24%

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 8 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

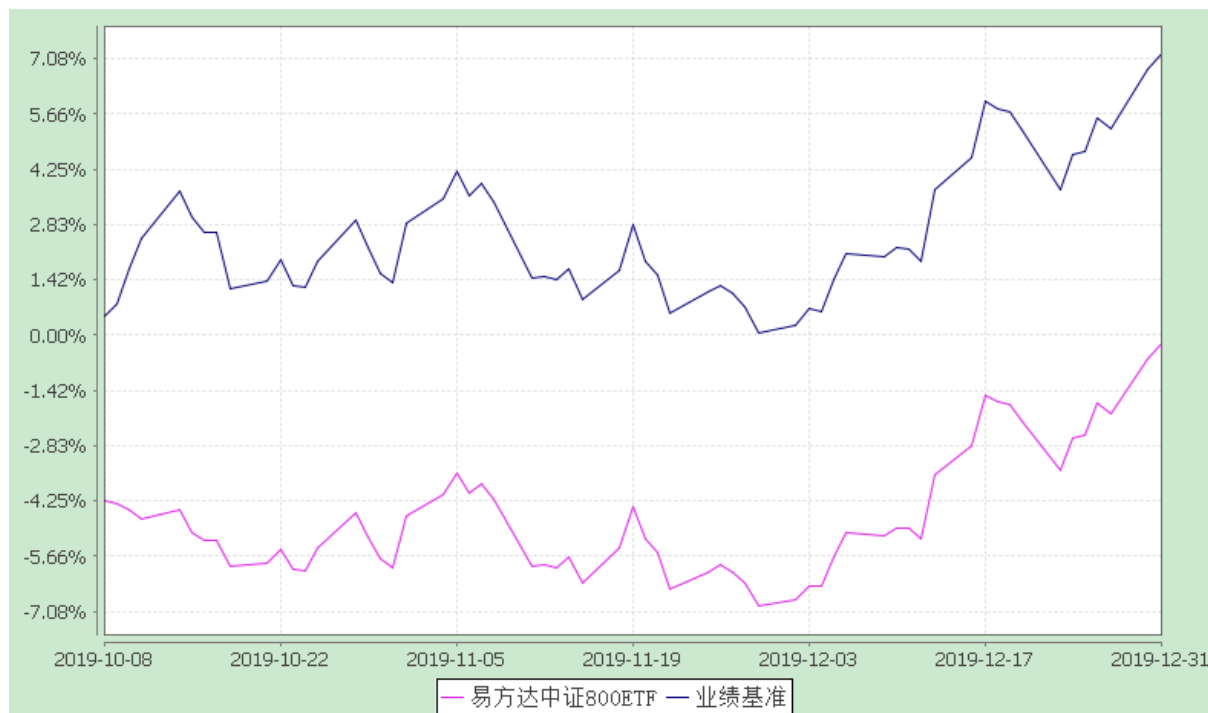
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.24%	0.87%	7.21%	0.75%	-7.45%	0.12%

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
 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 8 日至 2019 年 12 月 31 日)



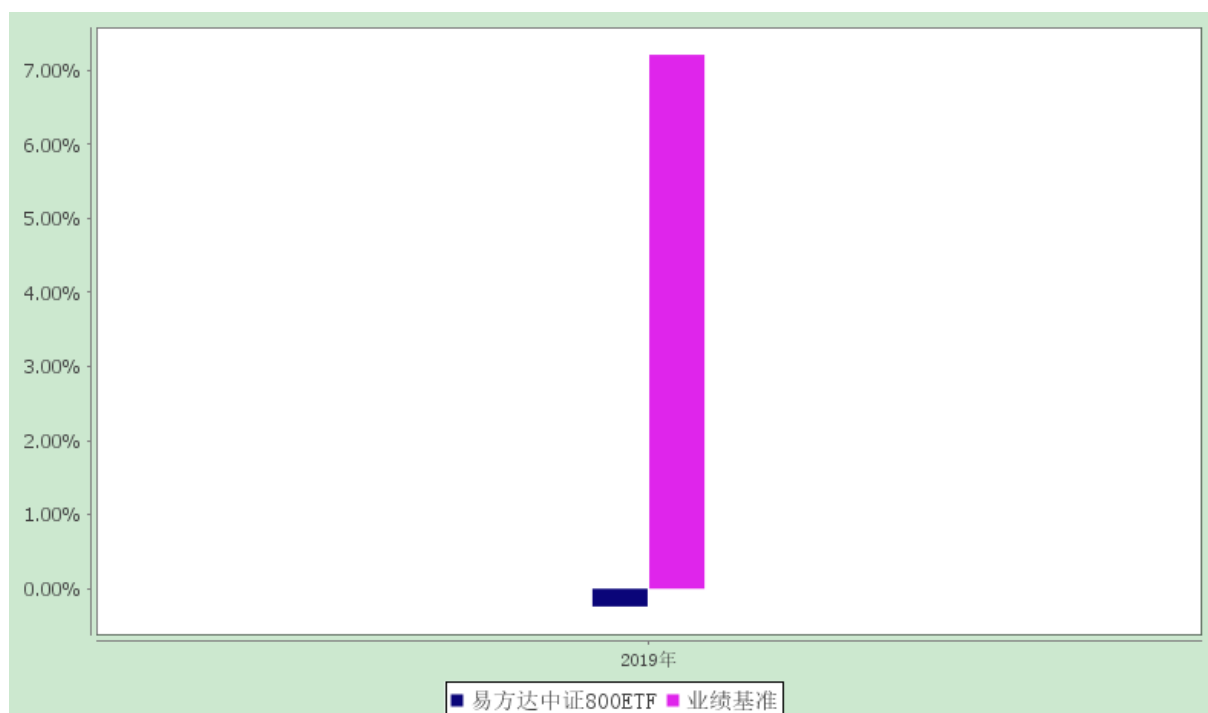
注：1.本基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，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。本报告期末本基金处于建仓期内。

3.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-0.24%，同期业绩比较基准收益率为 7.21%。

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
 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



注：本基金合同生效日为2019年10月8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8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发起式联接基金的基金经理、指数投资部副总经理	2019-10-08	-	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	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	2019-10-08	-	12 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。

<p>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>				
--	--	--	--	--

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 and 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。报告期内,本基金主要采取完全复制法投资策略,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%。

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,本基金份额净值为 0.9976 元,本报告期份额净值增长率为-0.24%,同期业绩比较基准收益率为 7.21%,本报告期本基金处于建仓期,受建仓期影响,基金年化跟踪误差 10.06%。

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

本基金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_G55 号

易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资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的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年 10 月 8 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 10 月 8 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，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

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	5,092,704.58

结算备付金		441,317.98
存出保证金		156,868.69
交易性金融资产	7.4.7.2	396,352,802.48
其中：股票投资		395,718,112.30
基金投资		-
债券投资		634,690.18
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		1,112,869.44
应收利息	7.4.7.5	2,044.05
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		403,158,607.22
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		1,000,591.60
应付赎回款		-
应付管理人报酬		56,768.18
应付托管费		18,922.72
应付销售服务费		-

应付交易费用	7.4.7.7	614,499.19
应交税费		3.38
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	525,476.20
负债合计		2,216,261.27
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	401,908,843.00
未分配利润	7.4.7.10	-966,497.05
所有者权益合计		400,942,345.95
负债和所有者权益总计		403,158,607.22

注：1.本基金合同生效日为 2019 年 10 月 8 日，2019 年度实际报告期间为 2019 年 10 月 8 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，基金份额净值 0.9976 元，基金份额总额 401,908,843.00 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

本报告期：2019 年 10 月 8 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 8 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		-20,055,885.42
1.利息收入		173,729.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	173,546.63
债券利息收入		183.30
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）		-39,514,431.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-39,759,370.62
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	104,734.17
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	140,204.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	18,555,382.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	729,434.10
减：二、费用		1,911,782.98
1. 管理人报酬		198,868.82
2. 托管费		66,289.62
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,390,004.18
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.44
7. 其他费用	7.4.7.19	256,619.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,967,668.40
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,967,668.40

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 8 日，2019 年度实际报告期间为 2019 年 10 月 8 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

本报告期：2019 年 10 月 8 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 8 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）	887,908,843.00	-	887,908,843.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-21,967,668.40	-21,967,668.40
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）	-486,000,000.00	21,001,171.35	-464,998,828.65
其中：1.基金申购款	30,000,000.00	-1,347,277.48	28,652,722.52
2.基金赎回款	-516,000,000.00	22,348,448.83	-493,651,551.17
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）	401,908,843.00	-966,497.05	400,942,345.95

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 8 日，2019 年度实际报告期间为 2019 年 10 月 8 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(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]1400 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基金合同》于 2019 年 10 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 887,908,843.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金,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 9 月 16 日至 2019 年 9 月 25 日,募集金额总额为人民币 887,908,843.00 元,其中:有效净认购金额为人民币 887,908,843.00 元,经安永华明(2019)验字第 60468000_G22 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 8 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、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。

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) 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；

(7) 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；

(8) 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；

(9) 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；

(10) 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) 本基金收益分配方式采用现金分红；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，基金管理人可进行收益分配；

(4) 本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，对上述原则进行修改或调整，而无需召开基金份额持有人大会审议。

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	5,092,704.58	
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	5,092,704.58	

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	377,162,730.21	395,718,112.30	18,555,382.09
贵金属投资-金交所黄	-	-	-

金合约				
债券	交易所市场	634,690.18	634,690.18	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	634,690.18	634,690.18	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		377,797,420.39	396,352,802.48	18,555,382.09

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	1,664.13
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	226.58
应收债券利息	82.84
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	70.50
合计	2,044.05

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	614,499.19
银行间市场应付交易费用	-
合计	614,499.19

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	163,726.03
应付替代款	313,437.40
可退替代款	2,660.60
其他应付款	45,652.17
合计	525,476.20

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2019 年 10 月 8 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	887,908,843.00	887,908,843.00
本期申购	30,000,000.00	30,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-516,000,000.00	-516,000,000.00

本期末	401,908,843.00	401,908,843.00
-----	----------------	----------------

注：本基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 887,908,843.00 份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

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	-40,523,050.49	18,555,382.09	-21,967,668.40
本期基金份额交易产生的变动数	24,506,070.54	-3,504,899.19	21,001,171.35
其中：基金申购款	-1,459,189.47	111,911.99	-1,347,277.48
基金赎回款	25,965,260.01	-3,616,811.18	22,348,448.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,016,979.95	15,050,482.90	-966,497.05

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 10 月 8 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	161,342.60
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	11,832.59
其他	371.44
合计	173,546.63

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 10 月 8 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-40,188,128.91

股票投资收益——赎回差价收入	428,758.29
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-39,759,370.62

7.4.7.12.2 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8日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	631,616,856.16
减：卖出股票成本总额	671,804,985.07
买卖股票差价收入	-40,188,128.91

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年10月8日（基金合同生效日）至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	493,651,551.17
减：现金支付赎回款总额	180,662,503.17
减：赎回股票成本总额	312,560,289.71
赎回差价收入	428,758.29

7.4.7.13 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8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	1,362,648.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,257,793.38
减：应收利息总额	120.57
买卖债券差价收入	104,734.17

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年10月8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	140,204.91
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	140,204.91

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年10月8日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1.交易性金融资产	18,555,382.09
——股票投资	18,555,382.09
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	18,555,382.09

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年10月8日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	-
基金申购费收入	-
替代损益收入	497,711.41
其他	231,722.69
合计	729,434.10

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入

(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年10月8日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,390,004.18
银行间市场交易费用	-
合计	1,390,004.18

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年10月8日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,841.72
上市费	40,000.00
指数使用费	45,652.17
其他	104,126.03
合计	256,619.92

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
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
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发起式联接基金	该基金是本基金的联接基金
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年10月8日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,204,121,294.28	81.21%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年10月8日（基金合同生效日）至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	519,342.79	84.51%	519,342.79	84.51%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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8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	198,868.82
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 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 为前一日的基金资产净值

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8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	66,289.62

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。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 为前一日的基金资产净值

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。

7.4.10.3 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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
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	89,270,200.00	22.2116%
广发证券	4,205,800.00	1.0465%

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 08 日。除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

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8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	5,092,704.58	161,342.60

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

本基金本报告期未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

为更好地实现基金合同所规定的投资目标,紧密跟踪标的指数,提高基金运作效率,本基金根据基金合同约定的投资策略,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,经基金托管人

审核同意,在报告期内投资于基金管理人股东广发证券发行的股票广发证券和托管行发行的股票建设银行。

7.4.11 利润分配情况

本基金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：股票										
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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新股流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新股流通受限	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
688300	联瑞新材	2019-11-07	2020-05-15	新股流通受限	27.28	39.84	3,164	86,313.92	126,053.76	-
688399	硕世生物	2019-11-27	2020-06-05	新股流通受限	46.78	54.51	2,290	107,126.20	124,827.90	-
002466	天齐锂业	2019-12-26	2020-01-03	配股流通受限	8.75	30.18	4,920	43,050.00	148,485.60	-
7.4.12.1.2 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
110064	建工转债	2019-12-23	2020-01-16	新发流通受限	100.00	100.00	70	6,999.82	6,999.82	-
110065	淮矿转债	2019-12-24	2020-01-13	新发流通受限	100.00	100.00	110	10,999.95	10,999.95	-
113029	明阳	2019-12-18	2020-01-07	新发	100.00	100.00	1,890	188,996.69	188,996.69	-

	转债			流通受限		0				
113030	东风转债	2019-12-26	2020-01-20	新发流通受限	100.00	100.00	280	27,999.51	27,999.51	-
123036	先导转债	2019-12-11	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	158	15,800.00	15,800.00	-
128084	木森转债	2019-12-18	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	1,080	107,998.11	107,998.11	-
128085	鸿达转债	2019-12-18	2020-01-08	新发流通受限	100.00	100.00	1,390	138,997.56	138,997.56	-
128086	国轩转债	2019-12-17	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	333	33,300.00	33,300.00	老股东配债
128086	国轩转债	2019-12-19	2020-01-10	新发流通受限	100.00	100.00	830	82,998.54	82,998.54	新债网下发行
128088	深南转债	2019-12-24	2020-01-16	新发流通受限	100.00	100.00	206	20,600.00	20,600.00	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

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	13,400	333,242.43	527,826.00	-

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。

本基金属股票基金,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,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。

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 0.16%。

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	11,000.38
AAA 以下	623,772.64
未评级	0.00
合计	634,773.02

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	5,092,704.58	-	-	-	5,092,704.58
结算备付金	441,317.98	-	-	-	441,317.98
存出保证金	156,868.69	-	-	-	156,868.69
交易性金融资产	-	-	634,690.18	395,718,112.30	396,352,802.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,112,869.44	1,112,869.44
应收利息	-	-	-	2,044.05	2,044.05
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,690,891.25	-	634,690.18	396,833,025.79	403,158,607.22
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	-	-	-	1,000,591.60	1,000,591.60
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	56,768.18	56,768.18
应付托管费	-	-	-	18,922.72	18,922.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	614,499.19	614,499.19
应交税费	-	-	-	3.38	3.38
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	525,476.20	525,476.20
负债总计	-	-	-	2,216,261.27	2,216,261.27
					7
利率敏感度缺口	5,690,891.25	-	634,690.18	394,616,764.52	400,942,345.95

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	395,718,112.30	98.70
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	395,718,112.30	98.70

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%	19,830,535.75
	2.业绩比较基准下降 5%	-19,830,535.75

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 395,330,085.05 元，属于第二层次的余额为 1,022,717.43 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。

(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	395,718,112.30	98.15
	其中：股票	395,718,112.30	98.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	634,690.18	0.16
	其中：债券	634,690.18	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	5,534,022.56	1.37
8	其他各项资产	1,271,782.18	0.32
9	合计	403,158,607.22	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	4,654,980.00	1.16
B	采矿业	10,970,158.00	2.74
C	制造业	184,322,197.72	45.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,581,802.00	2.39
E	建筑业	8,591,155.00	2.14
F	批发和零售业	8,397,898.00	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	11,319,545.04	2.82
H	住宿和餐饮业	460,809.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,170,874.20	4.78
J	金融业	104,601,692.30	26.09
K	房地产业	17,007,820.00	4.24
L	租赁和商务服务业	5,009,802.00	1.25
M	科学研究和技术服务业	1,914,930.00	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	1,061,474.04	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	465,370.00	0.12
Q	卫生和社会工作	3,858,983.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	3,118,972.00	0.78
S	综合	1,209,212.00	0.30
	合计	395,717,674.30	98.70

8.3 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	238,100	20,348,026.00	5.08
2	600519	贵州茅台	11,100	13,131,300.00	3.28

3	600036	招商银行	226,715	8,519,949.70	2.12
4	000651	格力电器	105,800	6,938,364.00	1.73
5	601166	兴业银行	319,600	6,328,080.00	1.58
6	000333	美的集团	106,800	6,221,100.00	1.55
7	600276	恒瑞医药	68,100	5,960,112.00	1.49
8	000858	五粮液	42,700	5,679,527.00	1.42
9	600030	中信证券	173,000	4,376,900.00	1.09
10	600887	伊利股份	134,000	4,145,960.00	1.03
11	000002	万科 A	128,200	4,125,476.00	1.03
12	600900	长江电力	193,400	3,554,692.00	0.89
13	000001	平安银行	213,200	3,507,140.00	0.87
14	600016	民生银行	545,500	3,442,105.00	0.86
15	601328	交通银行	603,700	3,398,831.00	0.85
16	600000	浦发银行	258,100	3,192,697.00	0.80
17	601288	农业银行	841,800	3,106,242.00	0.77
18	000661	长春高新	6,200	2,771,400.00	0.69
19	601398	工商银行	470,300	2,765,364.00	0.69
20	600837	海通证券	177,900	2,750,334.00	0.69
21	300498	温氏股份	81,800	2,748,480.00	0.69
22	002415	海康威视	82,200	2,691,228.00	0.67
23	601601	中国太保	69,100	2,614,744.00	0.65
24	601668	中国建筑	461,200	2,591,944.00	0.65
25	002475	立讯精密	70,600	2,576,900.00	0.64
26	600048	保利地产	157,300	2,545,114.00	0.63
27	000725	京东方 A	519,900	2,360,346.00	0.59
28	600585	海螺水泥	41,900	2,296,120.00	0.57
29	600031	三一重工	125,000	2,131,250.00	0.53
30	600309	万华化学	33,300	1,870,461.00	0.47
31	300059	东方财富	117,100	1,846,667.00	0.46
32	601888	中国国旅	20,700	1,841,265.00	0.46
33	000063	中兴通讯	51,800	1,833,202.00	0.46
34	601688	华泰证券	90,200	1,831,962.00	0.46
35	601169	北京银行	315,100	1,789,768.00	0.45
36	600104	上汽集团	74,300	1,772,055.00	0.44
37	601211	国泰君安	94,300	1,743,607.00	0.43
38	002142	宁波银行	60,100	1,691,815.00	0.42
39	000338	潍柴动力	104,400	1,657,872.00	0.41
40	601988	中国银行	447,400	1,650,906.00	0.41
41	600009	上海机场	20,400	1,606,500.00	0.40
42	603288	海天味业	14,800	1,591,148.00	0.40
43	600690	海尔智家	78,400	1,528,800.00	0.38
44	601818	光大银行	338,900	1,494,549.00	0.37
45	002304	洋河股份	13,100	1,447,550.00	0.36
46	601766	中国中车	201,200	1,436,568.00	0.36

47	603986	兆易创新	7,000	1,434,230.00	0.36
48	600028	中国石化	277,200	1,416,492.00	0.35
49	002027	分众传媒	222,300	1,391,598.00	0.35
50	601229	上海银行	145,200	1,377,948.00	0.34
51	600919	江苏银行	188,500	1,364,740.00	0.34
52	603259	药明康德	14,800	1,363,376.00	0.34
53	601012	隆基股份	53,600	1,330,888.00	0.33
54	002714	牧原股份	14,800	1,314,092.00	0.33
55	601899	紫金矿业	280,500	1,287,495.00	0.32
56	001979	招商蛇口	64,700	1,285,589.00	0.32
57	000568	泸州老窖	14,800	1,282,864.00	0.32
58	601088	中国神华	69,100	1,261,075.00	0.31
59	000100	TCL 集团	276,100	1,234,167.00	0.31
60	601628	中国人寿	34,000	1,185,580.00	0.30
61	601857	中国石油	198,300	1,156,089.00	0.29
62	600050	中国联通	193,900	1,142,071.00	0.28
63	603501	韦尔股份	7,800	1,118,520.00	0.28
64	002230	科大讯飞	31,400	1,082,672.00	0.27
65	600999	招商证券	58,300	1,066,307.00	0.27
66	601009	南京银行	121,500	1,065,555.00	0.27
67	600570	恒生电子	13,700	1,064,901.00	0.27
68	300033	同花顺	9,700	1,058,367.00	0.26
69	600019	宝钢股份	182,300	1,046,402.00	0.26
70	300015	爱尔眼科	26,000	1,028,560.00	0.26
71	601390	中国中铁	169,900	1,009,206.00	0.25
72	601939	建设银行	138,600	1,002,078.00	0.25
73	600406	国电南瑞	47,200	999,696.00	0.25
74	601006	大秦铁路	121,700	999,157.00	0.25
75	000166	申万宏源	194,800	997,376.00	0.25
76	601989	中国重工	189,400	992,456.00	0.25
77	600015	华夏银行	127,200	975,624.00	0.24
78	000776	广发证券	63,800	967,846.00	0.24
79	600436	片仔癀	8,800	966,856.00	0.24
80	601186	中国铁建	94,000	953,160.00	0.24
81	600703	三安光电	50,700	930,852.00	0.23
82	000538	云南白药	10,400	930,072.00	0.23
83	002241	歌尔股份	46,300	922,296.00	0.23
84	600763	通策医疗	8,700	892,011.00	0.22
85	000876	新希望	44,500	887,775.00	0.22
86	002594	比亚迪	18,400	877,128.00	0.22
87	300142	沃森生物	26,800	869,392.00	0.22
88	603160	汇顶科技	4,200	866,460.00	0.22
89	600741	华域汽车	32,100	834,279.00	0.21
90	002044	美年健康	55,900	832,351.00	0.21

91	002024	苏宁易购	81,100	819,921.00	0.20
92	002821	凯莱英	6,300	815,850.00	0.20
93	600745	闻泰科技	8,800	814,000.00	0.20
94	600958	东方证券	73,400	789,784.00	0.20
95	600809	山西汾酒	8,800	789,360.00	0.20
96	600352	浙江龙盛	53,900	779,933.00	0.19
97	002236	大华股份	39,100	777,308.00	0.19
98	002371	北方华创	8,800	774,400.00	0.19
99	600340	华夏幸福	26,100	749,070.00	0.19
100	601155	新城控股	19,300	747,296.00	0.19
101	600588	用友网络	25,893	735,361.20	0.18
102	000157	中联重科	110,000	734,800.00	0.18
103	601225	陕西煤业	81,600	733,584.00	0.18
104	601336	新华保险	14,800	727,420.00	0.18
105	601901	方正证券	83,900	727,413.00	0.18
106	300003	乐普医疗	21,800	721,144.00	0.18
107	600660	福耀玻璃	29,600	710,104.00	0.18
108	000596	古井贡酒	5,200	706,784.00	0.18
109	600346	恒力石化	43,100	693,048.00	0.17
110	600547	山东黄金	21,200	691,544.00	0.17
111	000069	华侨城 A	88,200	687,078.00	0.17
112	002202	金风科技	57,000	681,150.00	0.17
113	601669	中国电建	156,000	677,040.00	0.17
114	601377	兴业证券	95,600	676,848.00	0.17
115	300347	泰格医药	10,700	675,705.00	0.17
116	300136	信维通信	14,800	671,624.00	0.17
117	002736	国信证券	53,500	671,425.00	0.17
118	603833	欧派家居	5,730	670,410.00	0.17
119	600383	金地集团	46,000	667,000.00	0.17
120	601138	工业富联	36,500	666,855.00	0.17
121	002001	新和成	28,300	658,258.00	0.16
122	002916	深南电路	4,600	653,660.00	0.16
123	300124	汇川技术	21,200	649,568.00	0.16
124	002456	欧菲光	41,500	647,400.00	0.16
125	002466	天齐锂业	21,120	637,401.60	0.16
126	600886	国投电力	69,200	635,256.00	0.16
127	600536	中国软件	8,800	630,872.00	0.16
128	601985	中国核电	126,100	630,500.00	0.16
129	600029	南方航空	87,800	630,404.00	0.16
130	603993	洛阳钼业	144,100	628,276.00	0.16
131	600010	包钢股份	465,000	613,800.00	0.15
132	601933	永辉超市	79,500	599,430.00	0.15
133	603444	吉比特	2,000	596,980.00	0.15
134	601108	财通证券	52,500	595,350.00	0.15

135	601111	中国国航	61,300	593,997.00	0.15
136	002008	大族激光	14,800	592,000.00	0.15
137	000783	长江证券	82,900	591,906.00	0.15
138	000895	双汇发展	20,300	589,309.00	0.15
139	601877	正泰电器	21,900	586,920.00	0.15
140	002463	沪电股份	26,200	581,902.00	0.15
141	002555	三七互娱	21,500	578,995.00	0.14
142	600486	扬农化工	8,400	576,492.00	0.14
143	002032	苏泊尔	7,500	575,850.00	0.14
144	600795	国电电力	240,800	563,472.00	0.14
145	000066	中国长城	36,200	563,272.00	0.14
146	002602	世纪华通	48,600	555,498.00	0.14
147	000425	徐工机械	101,100	553,017.00	0.14
148	002352	顺丰控股	14,800	550,412.00	0.14
149	600196	复星医药	20,500	545,300.00	0.14
150	600018	上港集团	94,500	545,265.00	0.14
151	600115	东方航空	93,500	543,235.00	0.14
152	600705	中航资本	110,500	535,925.00	0.13
153	002311	海大集团	14,800	532,800.00	0.13
154	002384	东山精密	23,000	532,450.00	0.13
155	601788	光大证券	40,500	530,550.00	0.13
156	600271	航天信息	22,800	528,276.00	0.13
157	600438	通威股份	40,200	527,826.00	0.13
157	603799	华友钴业	13,400	527,826.00	0.13
159	601099	太平洋	139,200	527,568.00	0.13
160	600606	绿地控股	75,400	524,030.00	0.13
161	002007	华兰生物	14,800	520,220.00	0.13
162	600061	国投资本	34,200	517,788.00	0.13
163	002460	赣锋锂业	14,800	515,484.00	0.13
164	600089	特变电工	77,200	513,380.00	0.13
165	002050	三花智控	29,600	512,968.00	0.13
166	002410	广联达	15,000	509,700.00	0.13
167	601128	常熟银行	55,900	509,249.00	0.13
168	600011	华能国际	91,200	508,896.00	0.13
169	600584	长电科技	22,900	503,342.00	0.13
170	601997	贵阳银行	52,600	502,856.00	0.13
171	603659	璞泰来	5,900	502,385.00	0.13
172	600177	雅戈尔	71,600	499,052.00	0.12
173	603939	益丰药房	6,800	497,896.00	0.12
174	300014	亿纬锂能	9,900	496,584.00	0.12
175	601555	东吴证券	49,300	492,507.00	0.12
176	300122	智飞生物	9,800	486,668.00	0.12
177	600183	生益科技	23,200	485,344.00	0.12
178	000768	中航飞机	29,600	484,848.00	0.12

179	600176	中国巨石	44,300	482,870.00	0.12
180	600111	北方稀土	44,400	481,296.00	0.12
181	002493	荣盛石化	38,600	478,254.00	0.12
182	300408	三环集团	21,300	474,564.00	0.12
183	601600	中国铝业	133,900	474,006.00	0.12
184	002624	完美世界	10,600	467,884.00	0.12
185	000938	紫光股份	14,800	467,680.00	0.12
186	600109	国金证券	49,900	464,070.00	0.12
187	002439	启明星辰	13,700	463,060.00	0.12
188	600426	华鲁恒升	23,300	462,971.00	0.12
189	300144	宋城演艺	14,800	457,468.00	0.11
190	603019	中科曙光	13,200	456,456.00	0.11
191	600487	亨通光电	27,900	453,654.00	0.11
192	002120	韵达股份	13,600	452,880.00	0.11
193	002049	紫光国微	8,800	447,392.00	0.11
194	600201	生物股份	23,800	445,536.00	0.11
195	002812	恩捷股份	8,800	444,400.00	0.11
196	300383	光环新网	22,000	441,540.00	0.11
197	601800	中国交建	48,000	439,680.00	0.11
198	601100	恒立液压	8,800	437,800.00	0.11
199	300253	卫宁健康	29,000	434,420.00	0.11
200	601607	上海医药	23,600	433,532.00	0.11
201	300207	欣旺达	22,100	431,392.00	0.11
202	000625	长安汽车	42,900	430,287.00	0.11
203	603899	晨光文具	8,800	428,912.00	0.11
204	000961	中南建设	40,400	426,220.00	0.11
205	601919	中远海控	80,800	425,816.00	0.11
206	002179	中航光电	10,900	425,754.00	0.11
207	600100	同方股份	48,500	425,345.00	0.11
208	600522	中天科技	50,800	421,640.00	0.11
209	600038	中直股份	8,800	419,848.00	0.10
210	000728	国元证券	44,700	414,369.00	0.10
211	601872	招商轮船	50,100	413,826.00	0.10
212	300088	长信科技	40,200	412,854.00	0.10
213	002340	格林美	84,700	412,489.00	0.10
214	002129	中环股份	34,900	412,169.00	0.10
215	600221	海航控股	237,800	411,394.00	0.10
216	600332	白云山	11,500	409,515.00	0.10
217	601618	中国中冶	146,200	409,360.00	0.10
218	603517	绝味食品	8,800	408,760.00	0.10
219	002465	海格通信	37,700	408,291.00	0.10
220	300017	网宿科技	42,800	407,884.00	0.10
221	600498	烽火通信	14,800	406,260.00	0.10
222	002065	东华软件	39,300	405,576.00	0.10

223	600516	方大炭素	33,300	404,928.00	0.10
224	600637	东方明珠	43,100	403,416.00	0.10
225	300012	华测检测	27,000	402,570.00	0.10
226	002938	鹏鼎控股	8,800	395,120.00	0.10
227	601198	东兴证券	30,000	394,200.00	0.10
228	600926	杭州银行	42,900	392,964.00	0.10
229	600066	宇通客车	27,500	391,875.00	0.10
230	601998	中信银行	63,500	391,795.00	0.10
231	002271	东方雨虹	14,800	389,388.00	0.10
232	600739	辽宁成大	25,400	386,842.00	0.10
233	601021	春秋航空	8,800	386,232.00	0.10
234	600801	华新水泥	14,600	385,878.00	0.10
235	002127	南极电商	35,100	382,941.00	0.10
236	002273	水晶光电	23,600	381,376.00	0.10
237	300413	芒果超媒	10,900	381,064.00	0.10
238	000786	北新建材	14,800	376,660.00	0.09
239	600068	葛洲坝	56,300	376,084.00	0.09
240	603816	顾家家居	8,200	374,986.00	0.09
241	300529	健帆生物	5,200	373,568.00	0.09
242	600867	通化东宝	29,400	371,910.00	0.09
243	601727	上海电气	74,600	371,508.00	0.09
244	002673	西部证券	37,600	368,480.00	0.09
245	600004	白云机场	21,100	368,195.00	0.09
246	002797	第一创业	44,300	366,804.00	0.09
247	002146	荣盛发展	37,300	366,659.00	0.09
248	002353	杰瑞股份	9,800	362,208.00	0.09
249	000963	华东医药	14,800	360,824.00	0.09
250	603228	景旺电子	8,200	359,324.00	0.09
251	600362	江西铜业	21,200	358,916.00	0.09
252	002180	纳思达	10,900	358,828.00	0.09
253	600674	川投能源	36,000	354,600.00	0.09
254	300315	掌趣科技	56,800	350,456.00	0.09
255	000009	中国宝安	56,600	350,354.00	0.09
256	002422	科伦药业	14,800	347,652.00	0.09
257	002690	美亚光电	8,800	344,080.00	0.09
258	002153	石基信息	8,800	343,200.00	0.09
259	002368	太极股份	8,800	342,496.00	0.09
260	000050	深天马 A	20,900	340,461.00	0.08
261	000750	国海证券	63,600	339,624.00	0.08
262	300308	中际旭创	6,500	338,975.00	0.08
263	601233	桐昆股份	22,600	338,774.00	0.08
264	601838	成都银行	37,200	337,404.00	0.08
265	000703	恒逸石化	24,200	336,864.00	0.08
266	600208	新潮中宝	89,100	336,798.00	0.08

267	000656	金科股份	43,500	334,080.00	0.08
268	603883	老百姓	5,200	333,216.00	0.08
269	600583	海油工程	45,100	332,838.00	0.08
270	601799	星宇股份	3,500	332,430.00	0.08
271	600023	浙能电力	83,800	331,848.00	0.08
272	600219	南山铝业	147,100	329,504.00	0.08
273	000423	东阿阿胶	9,300	328,941.00	0.08
274	600170	上海建工	92,700	328,158.00	0.08
275	002508	老板电器	9,700	327,957.00	0.08
276	000401	冀东水泥	19,200	326,592.00	0.08
277	002773	康弘药业	8,800	325,336.00	0.08
278	601117	中国化学	50,400	324,576.00	0.08
279	600673	东阳光	31,600	323,584.00	0.08
280	000630	铜陵有色	138,000	321,540.00	0.08
281	000413	东旭光电	95,600	321,216.00	0.08
282	600893	航发动力	14,800	320,864.00	0.08
283	002601	龙鳞佰利	20,700	318,573.00	0.08
284	002926	华西证券	28,900	318,189.00	0.08
285	601881	中国银河	27,200	315,792.00	0.08
286	600085	同仁堂	11,200	315,616.00	0.08
287	300070	碧水源	41,500	315,400.00	0.08
288	300285	国瓷材料	13,800	315,330.00	0.08
289	600885	宏发股份	9,100	313,495.00	0.08
290	000623	吉林敖东	18,900	312,417.00	0.08
291	300024	机器人	22,300	312,200.00	0.08
292	002268	卫士通	12,100	312,059.00	0.08
293	002078	太阳纸业	31,700	311,928.00	0.08
294	600132	重庆啤酒	6,000	311,760.00	0.08
295	601878	浙商证券	27,900	310,527.00	0.08
296	600298	安琪酵母	10,100	309,767.00	0.08
297	600150	中国船舶	14,200	308,992.00	0.08
298	000028	国药一致	6,800	308,448.00	0.08
299	002507	涪陵榨菜	11,500	307,395.00	0.08
300	000627	天茂集团	43,600	306,944.00	0.08
301	601018	宁波港	80,600	306,280.00	0.08
302	002195	二三四五	94,400	304,912.00	0.08
303	600563	法拉电子	6,100	301,645.00	0.08
304	002252	上海莱士	40,500	300,510.00	0.07
305	000988	华工科技	14,800	300,292.00	0.07
306	000513	丽珠集团	8,883	299,357.10	0.07
307	600489	中金黄金	35,300	299,344.00	0.07
308	600161	天坛生物	10,700	298,958.00	0.07
309	600369	西南证券	57,600	298,944.00	0.07
310	002500	山西证券	36,000	298,440.00	0.07

311	600482	中国动力	14,900	298,000.00	0.07
312	002131	利欧股份	99,900	296,703.00	0.07
313	600642	申能股份	50,900	295,729.00	0.07
314	300296	利亚德	38,400	294,528.00	0.07
315	002572	索菲亚	14,000	293,300.00	0.07
316	600845	宝信软件	8,800	289,520.00	0.07
317	002081	金螳螂	32,700	288,414.00	0.07
318	600535	天士力	18,500	285,270.00	0.07
319	600143	金发科技	39,000	283,920.00	0.07
320	000671	阳光城	33,000	280,500.00	0.07
321	000975	银泰黄金	20,500	279,005.00	0.07
322	000999	华润三九	8,800	278,784.00	0.07
323	600760	中航沈飞	8,800	278,080.00	0.07
324	002385	大北农	55,700	277,386.00	0.07
325	601066	中信建投	9,100	276,640.00	0.07
326	000998	隆平高科	18,800	276,548.00	0.07
327	600256	广汇能源	83,200	275,392.00	0.07
328	000686	东北证券	29,600	275,280.00	0.07
329	002925	盈趣科技	6,200	272,490.00	0.07
330	000629	攀钢钒钛	93,300	272,436.00	0.07
331	600909	华安证券	37,300	272,290.00	0.07
332	600315	上海家化	8,800	272,272.00	0.07
333	600704	物产中大	51,700	271,425.00	0.07
334	600325	华发股份	34,600	270,918.00	0.07
335	002607	中公教育	15,100	269,988.00	0.07
336	600779	水井坊	5,200	269,100.00	0.07
337	002739	万达电影	14,800	268,620.00	0.07
338	002373	千方科技	14,800	266,992.00	0.07
339	600153	建发股份	29,600	266,104.00	0.07
340	600879	航天电子	44,400	265,512.00	0.07
341	600699	均胜电子	14,800	264,920.00	0.07
342	601168	西部矿业	40,000	264,800.00	0.07
343	002223	鱼跃医疗	13,000	264,160.00	0.07
344	002281	光迅科技	8,800	262,064.00	0.07
345	600528	中铁工业	22,700	261,050.00	0.07
346	600079	人福医药	19,300	260,743.00	0.07
347	600118	中国卫星	12,100	258,577.00	0.06
348	601231	环旭电子	13,400	257,682.00	0.06
349	002013	中航机电	36,900	256,086.00	0.06
350	603156	养元饮品	8,800	255,464.00	0.06
351	600728	佳都科技	27,200	255,136.00	0.06
352	603866	桃李面包	6,000	254,640.00	0.06
353	603712	七一二	10,500	253,890.00	0.06
354	002174	游族网络	10,900	253,643.00	0.06

355	601992	金隅集团	68,000	253,640.00	0.06
356	002250	联化科技	14,800	253,524.00	0.06
357	600446	金证股份	12,300	253,134.00	0.06
358	000723	美锦能源	26,800	252,724.00	0.06
359	600754	锦江酒店	8,800	252,648.00	0.06
360	600567	山鹰纸业	66,600	251,082.00	0.06
361	002670	国盛金控	19,700	250,387.00	0.06
362	603338	浙江鼎力	3,500	250,250.00	0.06
363	600027	华电国际	68,000	249,560.00	0.06
364	600655	豫园股份	31,700	248,528.00	0.06
365	603233	大参林	4,700	245,575.00	0.06
366	000778	新兴铸管	58,500	243,945.00	0.06
367	000547	航天发展	23,700	242,214.00	0.06
368	603858	步长制药	11,700	241,254.00	0.06
369	002019	亿帆医药	14,800	240,500.00	0.06
370	002152	广电运通	25,000	240,250.00	0.06
371	600511	国药股份	8,800	240,152.00	0.06
372	000581	威孚高科	12,600	240,030.00	0.06
373	600259	广晟有色	6,900	239,913.00	0.06
374	600572	康恩贝	38,900	239,235.00	0.06
375	002558	巨人网络	13,200	238,392.00	0.06
376	600820	隧道股份	39,400	237,976.00	0.06
377	300418	昆仑万维	14,200	237,850.00	0.06
378	002092	中泰化学	35,000	237,650.00	0.06
379	000709	河钢股份	92,000	237,360.00	0.06
380	002075	沙钢股份	38,000	236,740.00	0.06
381	600521	华海药业	13,700	236,462.00	0.06
382	002387	维信诺	14,865	236,353.50	0.06
383	603882	金城医学	4,600	235,612.00	0.06
384	000997	新大陆	14,800	235,024.00	0.06
385	002110	三钢闽光	25,100	234,936.00	0.06
386	000060	中金岭南	54,500	234,350.00	0.06
387	600497	驰宏锌锗	53,400	233,892.00	0.06
388	002831	裕同科技	8,800	233,640.00	0.06
389	603806	福斯特	4,800	233,280.00	0.06
390	601808	中海油服	12,100	232,320.00	0.06
391	600410	华胜天成	22,400	230,944.00	0.06
392	600273	嘉化能源	20,400	229,500.00	0.06
393	600460	士兰微	14,800	228,956.00	0.06
394	300058	蓝色光标	40,500	228,825.00	0.06
395	300168	万达信息	14,800	228,364.00	0.06
396	002920	德赛西威	7,500	227,475.00	0.06
397	600640	号百控股	8,800	227,128.00	0.06
398	600895	张江高科	14,800	226,588.00	0.06

399	002217	合力泰	40,800	226,440.00	0.06
400	002212	南洋股份	11,900	226,219.00	0.06
401	300113	顺网科技	8,800	226,072.00	0.06
402	600977	中国电影	14,800	225,256.00	0.06
403	600398	海澜之家	29,300	225,024.00	0.06
404	601966	玲珑轮胎	9,800	224,714.00	0.06
405	603707	健友股份	5,400	223,992.00	0.06
406	603000	人民网	11,300	223,627.00	0.06
407	600297	广汇汽车	68,400	222,984.00	0.06
408	600839	四川长虹	76,600	222,906.00	0.06
409	300316	晶盛机电	14,100	221,652.00	0.06
410	601005	重庆钢铁	119,700	221,445.00	0.06
411	002242	九阳股份	8,800	221,408.00	0.06
412	601238	广汽集团	18,900	220,941.00	0.06
413	000636	风华高科	14,800	220,372.00	0.05
414	000830	鲁西化工	20,900	219,659.00	0.05
415	601633	长城汽车	24,800	219,480.00	0.05
416	300274	阳光电源	20,800	219,024.00	0.05
417	600466	蓝光发展	29,600	218,152.00	0.05
418	600376	首开股份	27,200	216,784.00	0.05
419	600160	巨化股份	29,700	216,216.00	0.05
420	600848	上海临港	8,800	216,040.00	0.05
421	600881	亚泰集团	67,700	215,963.00	0.05
422	601216	君正集团	68,800	215,344.00	0.05
423	002074	国轩高科	14,800	215,340.00	0.05
424	600415	小商品城	55,500	214,785.00	0.05
425	600021	上海电力	26,500	213,325.00	0.05
426	000039	中集集团	21,700	213,094.00	0.05
427	000960	锡业股份	20,400	212,976.00	0.05
428	600566	济川药业	8,800	212,784.00	0.05
429	601333	广深铁路	69,200	211,752.00	0.05
430	300001	特锐德	12,300	211,314.00	0.05
431	000690	宝新能源	37,400	211,310.00	0.05
432	000402	金融街	25,900	210,308.00	0.05
433	601866	中远海发	80,900	209,531.00	0.05
434	300009	安科生物	13,800	208,242.00	0.05
435	600258	首旅酒店	10,100	208,161.00	0.05
436	601360	三六零	8,800	206,888.00	0.05
437	600875	东方电气	22,500	206,775.00	0.05
438	002807	江阴银行	44,300	206,438.00	0.05
439	600811	东方集团	60,900	204,624.00	0.05
440	300433	蓝思科技	14,800	204,536.00	0.05
441	000089	深圳机场	20,900	204,193.00	0.05
442	600373	中文传媒	15,000	204,150.00	0.05

443	600776	东方通信	9,800	204,134.00	0.05
444	600380	健康元	19,700	203,895.00	0.05
445	600959	江苏有线	51,200	203,776.00	0.05
446	002085	万丰奥威	28,900	202,300.00	0.05
447	000878	云南铜业	14,800	202,168.00	0.05
448	600260	凯乐科技	14,800	200,836.00	0.05
449	002589	瑞康医药	26,100	200,709.00	0.05
450	600155	华创阳安	14,300	200,629.00	0.05
451	002010	传化智联	28,700	200,326.00	0.05
452	300010	立思辰	15,500	200,105.00	0.05
453	600663	陆家嘴	14,800	199,948.00	0.05
453	600884	杉杉股份	14,800	199,948.00	0.05
455	300027	华谊兄弟	43,100	199,553.00	0.05
456	300115	长盈精密	11,200	199,248.00	0.05
457	600166	福田汽车	94,900	198,341.00	0.05
458	600816	安信信托	44,600	198,024.00	0.05
459	002411	延安必康	12,600	196,938.00	0.05
460	000983	西山煤电	32,100	196,773.00	0.05
461	603888	新华网	9,300	196,230.00	0.05
462	600167	联美控股	14,900	196,084.00	0.05
463	600755	厦门国贸	26,700	195,978.00	0.05
464	603377	东方时尚	10,700	195,382.00	0.05
465	600392	盛和资源	21,500	195,005.00	0.05
466	300244	迪安诊断	8,800	194,744.00	0.05
467	600729	重庆百货	6,500	194,025.00	0.05
468	603515	欧普照明	6,900	193,959.00	0.05
469	000563	陕国投 A	43,700	193,591.00	0.05
470	000729	燕京啤酒	29,600	192,992.00	0.05
470	600549	厦门钨业	14,800	192,992.00	0.05
472	603568	伟明环保	8,400	192,696.00	0.05
473	600022	山东钢铁	134,700	192,621.00	0.05
474	002221	东华能源	24,800	192,448.00	0.05
475	300166	东方国信	14,800	192,400.00	0.05
476	600216	浙江医药	14,400	192,240.00	0.05
477	600282	南钢股份	55,400	191,130.00	0.05
478	601898	中煤能源	37,900	190,258.00	0.05
479	000825	太钢不锈	46,500	190,185.00	0.05
480	600094	大名城	32,500	190,125.00	0.05
481	600643	爱建集团	19,800	190,080.00	0.05
482	601577	长沙银行	20,900	189,563.00	0.05
483	603260	合盛硅业	6,400	188,608.00	0.05
484	600026	中远海能	29,500	188,210.00	0.05
485	600808	马钢股份	61,200	187,884.00	0.05
486	002233	塔牌集团	14,800	186,480.00	0.05

487	600266	城建发展	23,000	186,300.00	0.05
488	002414	高德红外	8,800	184,800.00	0.05
489	600737	中粮糖业	21,800	184,428.00	0.05
490	002407	多氟多	14,000	183,540.00	0.05
491	600694	大商股份	6,700	183,513.00	0.05
492	002317	众生药业	14,400	182,880.00	0.05
493	000031	大悦城	25,400	182,372.00	0.05
494	002709	天赐材料	8,800	182,160.00	0.05
495	002372	伟星新材	13,800	181,746.00	0.05
496	603885	吉祥航空	12,100	181,500.00	0.05
497	600804	鹏博士	29,600	181,152.00	0.05
498	600171	上海贝岭	11,500	181,125.00	0.05
499	000021	深科技	14,800	180,264.00	0.04
500	000883	湖北能源	43,000	179,310.00	0.04
501	000598	兴蓉环境	38,700	179,181.00	0.04
502	601699	潞安环能	24,600	178,596.00	0.04
503	600037	歌华有线	19,800	178,398.00	0.04
504	000869	张裕 A	6,200	177,940.00	0.04
505	600580	卧龙电驱	14,800	177,896.00	0.04
506	600435	北方导航	21,300	177,216.00	0.04
507	601098	中南传媒	14,800	176,712.00	0.04
508	002038	双鹭药业	13,400	176,210.00	0.04
509	002294	信立泰	8,800	175,472.00	0.04
510	600777	新潮能源	83,200	174,720.00	0.04
511	300251	光线传媒	14,800	174,640.00	0.04
512	000898	鞍钢股份	51,800	173,530.00	0.04
513	002440	闰土股份	15,400	172,480.00	0.04
514	002028	思源电气	12,500	172,125.00	0.04
515	601118	海南橡胶	34,900	171,708.00	0.04
516	002399	海普瑞	8,800	171,688.00	0.04
517	002468	申通快递	8,800	171,600.00	0.04
518	000932	华菱钢铁	35,700	170,646.00	0.04
519	002191	劲嘉股份	14,800	168,868.00	0.04
520	600718	东软集团	14,800	167,980.00	0.04
521	600733	北汽蓝谷	28,700	167,608.00	0.04
522	002936	郑州银行	36,000	167,400.00	0.04
523	600188	兖州煤业	15,800	166,848.00	0.04
524	600782	新钢股份	32,500	166,725.00	0.04
525	002064	华峰氨纶	26,400	165,000.00	0.04
526	601319	中国人保	21,700	164,703.00	0.04
527	000559	万向钱潮	30,600	164,322.00	0.04
528	000807	云铝股份	31,900	163,966.00	0.04
529	600863	内蒙华电	59,500	163,625.00	0.04
530	000877	天山股份	13,800	163,530.00	0.04

531	600409	三友化工	25,800	163,056.00	0.04
532	600998	九州通	11,500	162,725.00	0.04
533	601106	中国一重	55,900	162,669.00	0.04
534	600597	光明乳业	12,700	161,163.00	0.04
535	000738	航发控制	12,300	160,761.00	0.04
536	600060	海信视像	14,800	160,580.00	0.04
537	603077	和邦生物	108,100	159,988.00	0.04
538	300072	三聚环保	25,300	159,896.00	0.04
539	000027	深圳能源	25,700	159,597.00	0.04
540	002004	华邦健康	32,300	159,562.00	0.04
541	000970	中科三环	14,800	159,100.00	0.04
541	300133	华策影视	21,500	159,100.00	0.04
543	601958	金钼股份	19,700	157,797.00	0.04
544	002048	宁波华翔	10,200	157,692.00	0.04
545	601000	唐山港	60,600	157,560.00	0.04
546	600967	内蒙一机	14,800	157,324.00	0.04
547	002583	海能达	18,700	157,267.00	0.04
548	600025	华能水电	37,000	156,140.00	0.04
549	601179	中国西电	42,800	155,792.00	0.04
550	000008	神州高铁	42,800	155,364.00	0.04
551	002841	视源股份	1,800	154,260.00	0.04
552	600064	南京高科	15,800	154,050.00	0.04
552	600388	龙净环保	15,800	154,050.00	0.04
554	600372	中航电子	10,800	153,792.00	0.04
555	000415	渤海租赁	40,400	153,520.00	0.04
556	601689	拓普集团	8,800	153,384.00	0.04
557	600500	中化国际	28,900	153,170.00	0.04
558	600648	外高桥	8,800	152,856.00	0.04
559	600008	首创股份	46,400	152,656.00	0.04
560	600903	贵州燃气	10,300	152,234.00	0.04
561	002815	崇达技术	8,800	152,152.00	0.04
562	300026	红日药业	43,300	151,983.00	0.04
563	000930	中粮科技	23,000	151,800.00	0.04
564	000681	视觉中国	8,800	151,712.00	0.04
565	600649	城投控股	26,500	151,580.00	0.04
566	000488	晨鸣纸业	29,600	150,664.00	0.04
567	600989	宝丰能源	15,800	150,258.00	0.04
568	600053	九鼎投资	5,900	150,037.00	0.04
569	600138	中青旅	11,900	149,940.00	0.04
570	600645	中源协和	8,800	148,984.00	0.04
571	600507	方大特钢	14,800	148,888.00	0.04
572	600039	四川路桥	44,200	148,512.00	0.04
573	600970	中材国际	21,300	148,461.00	0.04
574	601228	广州港	38,600	147,838.00	0.04

575	601236	红塔证券	8,800	147,576.00	0.04
576	300182	捷成股份	42,200	147,278.00	0.04
577	600908	无锡银行	26,500	147,075.00	0.04
578	600233	圆通速递	11,600	146,740.00	0.04
579	603556	海兴电力	9,000	146,700.00	0.04
580	002635	安洁科技	8,800	146,696.00	0.04
581	000528	柳工	21,100	146,434.00	0.04
582	601718	际华集团	44,800	146,048.00	0.04
583	600835	上海机电	8,800	145,816.00	0.04
584	600633	浙数文化	15,800	144,570.00	0.04
585	600158	中体产业	14,400	144,432.00	0.04
586	000012	南玻 A	28,800	144,288.00	0.04
587	000090	天健集团	27,200	144,160.00	0.04
588	600598	北大荒	14,800	144,152.00	0.04
589	600823	世茂股份	31,800	143,100.00	0.04
590	600515	海航基础	31,900	142,274.00	0.04
591	600056	中国医药	10,900	142,245.00	0.04
592	600827	百联股份	15,800	141,884.00	0.04
593	000400	许继电气	13,100	141,087.00	0.04
594	300180	华峰超纤	15,800	139,672.00	0.03
595	600062	华润双鹤	10,700	139,635.00	0.03
596	002665	首航节能	41,500	139,440.00	0.03
597	002701	奥瑞金	31,600	139,356.00	0.03
598	600418	江淮汽车	27,600	138,552.00	0.03
599	000712	锦龙股份	9,100	138,320.00	0.03
600	600120	浙江东方	15,820	138,108.60	0.03
601	601717	郑煤机	21,300	137,811.00	0.03
602	600348	阳泉煤业	24,800	137,144.00	0.03
603	601598	中国外运	32,100	136,746.00	0.03
604	000826	启迪环境	14,800	135,864.00	0.03
605	000301	东方盛虹	26,200	135,716.00	0.03
606	300134	大富科技	8,800	135,696.00	0.03
607	600277	亿利洁能	29,600	134,976.00	0.03
608	600307	酒钢宏兴	65,400	134,724.00	0.03
609	002030	达安基因	11,700	134,550.00	0.03
610	000758	中色股份	30,700	134,466.00	0.03
611	000887	中鼎股份	14,800	133,940.00	0.03
612	002244	滨江集团	27,100	133,332.00	0.03
613	002266	浙富控股	32,300	133,076.00	0.03
614	000158	常山北明	19,500	132,990.00	0.03
615	601608	中信重工	35,600	132,432.00	0.03
616	002183	怡亚通	31,400	132,194.00	0.03
617	002002	鸿达兴业	31,700	131,872.00	0.03
618	002945	华林证券	8,800	131,472.00	0.03

619	300002	神州泰岳	40,100	130,726.00	0.03
620	601880	大连港	64,300	130,529.00	0.03
621	000990	诚志股份	8,800	130,416.00	0.03
622	002818	富森美	10,300	130,295.00	0.03
623	000685	中山公用	15,800	130,192.00	0.03
624	600557	康缘药业	8,800	129,712.00	0.03
625	002056	横店东磁	15,800	129,560.00	0.03
626	600717	天津港	20,500	128,740.00	0.03
627	000078	海王生物	34,300	127,939.00	0.03
628	603198	迎驾贡酒	6,400	127,488.00	0.03
629	688300	联瑞新材	3,164	126,053.76	0.03
630	600862	中航高科	11,400	125,628.00	0.03
631	000062	深圳华强	8,800	125,312.00	0.03
632	002390	信邦制药	23,800	124,950.00	0.03
633	000732	泰禾集团	20,300	124,845.00	0.03
634	000501	鄂武商 A	9,400	124,832.00	0.03
635	688399	硕世生物	2,290	124,827.90	0.03
636	002155	湖南黄金	15,800	124,662.00	0.03
637	000717	韶钢松山	26,200	124,188.00	0.03
638	600859	王府井	8,800	123,112.00	0.03
639	002603	以岭药业	9,900	123,057.00	0.03
640	002203	海亮股份	12,000	123,000.00	0.03
641	002426	胜利精密	52,100	122,956.00	0.03
642	601869	长飞光纤	3,700	122,211.00	0.03
643	000156	华数传媒	11,700	122,148.00	0.03
644	600664	哈药股份	32,200	122,038.00	0.03
645	002640	跨境通	15,800	121,976.00	0.03
646	002939	长城证券	8,800	121,968.00	0.03
646	600329	中新药业	8,800	121,968.00	0.03
648	600968	海油发展	41,500	121,595.00	0.03
649	601928	凤凰传媒	15,800	120,238.00	0.03
650	000727	华东科技	57,500	120,175.00	0.03
651	002280	联络互动	31,000	119,970.00	0.03
652	002544	杰赛科技	8,800	119,856.00	0.03
653	300324	旋极信息	21,400	119,840.00	0.03
654	002745	木林森	8,800	119,768.00	0.03
655	600291	西水股份	13,300	119,567.00	0.03
656	000967	盈峰环境	19,300	119,081.00	0.03
657	600195	中牧股份	10,300	118,965.00	0.03
658	000519	中兵红箭	15,600	118,872.00	0.03
659	600639	浦东金桥	8,800	118,800.00	0.03
660	002444	巨星科技	11,000	118,140.00	0.03
661	000718	苏宁环球	30,900	118,038.00	0.03
662	600765	中航重机	11,500	117,645.00	0.03

663	600545	卓郎智能	19,300	117,151.00	0.03
664	002302	西部建设	10,300	116,287.00	0.03
665	600339	中油工程	34,200	115,938.00	0.03
666	601975	招商南油	40,900	114,929.00	0.03
667	600316	洪都航空	8,800	114,664.00	0.03
668	000025	特力 A	5,400	114,480.00	0.03
669	600499	科达洁能	26,400	114,312.00	0.03
670	000959	首钢股份	32,300	114,019.00	0.03
671	002839	张家港行	19,100	113,454.00	0.03
672	601212	白银有色	30,800	113,344.00	0.03
673	002249	大洋电机	29,300	113,098.00	0.03
674	600141	兴发集团	11,000	113,080.00	0.03
675	002408	齐翔腾达	15,800	112,970.00	0.03
676	601678	滨化股份	22,100	112,931.00	0.03
677	000761	本钢板材	28,600	112,684.00	0.03
678	601611	中国核建	15,800	112,654.00	0.03
679	000543	皖能电力	24,100	111,824.00	0.03
680	600748	上实发展	18,800	111,672.00	0.03
681	600017	日照港	38,300	111,453.00	0.03
682	600869	智慧能源	22,700	111,230.00	0.03
683	600125	铁龙物流	18,600	111,228.00	0.03
684	600565	迪马股份	30,800	110,264.00	0.03
685	600338	西藏珠峰	8,800	110,000.00	0.03
686	000987	越秀金控	11,300	109,271.00	0.03
687	600751	海航科技	37,000	108,410.00	0.03
688	601615	明阳智能	8,800	108,240.00	0.03
689	600582	天地科技	33,800	107,822.00	0.03
690	600073	上海梅林	13,500	107,595.00	0.03
691	002128	露天煤业	12,400	107,384.00	0.03
692	002382	蓝帆医疗	8,800	106,832.00	0.03
693	002285	世联行	28,300	106,125.00	0.03
694	002867	周大生	5,500	104,720.00	0.03
695	002434	万里扬	11,000	104,280.00	0.03
695	600478	科力远	23,700	104,280.00	0.03
697	002419	天虹股份	9,800	103,390.00	0.03
698	601200	上海环境	9,300	103,230.00	0.03
699	000006	深振业 A	19,200	102,912.00	0.03
700	600317	营口港	40,200	102,510.00	0.03
701	601326	秦港股份	32,000	102,080.00	0.03
702	600312	平高电气	15,800	102,068.00	0.03
703	600126	杭钢股份	20,700	101,223.00	0.03
704	002118	紫鑫药业	16,100	100,464.00	0.03
705	601127	小康股份	8,800	100,320.00	0.03
706	000848	承德露露	12,700	99,949.00	0.02

707	600901	江苏租赁	15,800	99,856.00	0.02
708	601828	美凯龙	8,800	99,704.00	0.02
709	601698	中国卫通	8,800	99,616.00	0.02
709	603328	依顿电子	8,800	99,616.00	0.02
711	000813	德展健康	15,800	99,382.00	0.02
712	603056	德邦股份	8,864	98,479.04	0.02
713	002505	大康农业	56,200	98,350.00	0.02
714	002051	中工国际	10,100	98,172.00	0.02
715	002491	通鼎互联	14,800	97,828.00	0.02
716	600299	安迪苏	8,800	97,328.00	0.02
717	002176	江特电机	25,800	97,008.00	0.02
718	300197	铁汉生态	31,500	96,390.00	0.02
719	300257	开山股份	8,800	95,744.00	0.02
720	300159	新研股份	24,400	95,648.00	0.02
721	601811	新华文轩	7,200	94,968.00	0.02
722	603225	新凤鸣	7,600	93,860.00	0.02
723	000564	供销大集	39,000	93,210.00	0.02
724	000553	安道麦 A	9,300	93,000.00	0.02
725	601139	深圳燃气	11,800	92,394.00	0.02
726	002573	清新环境	14,300	92,235.00	0.02
727	601019	山东出版	13,100	91,045.00	0.02
728	000537	广宇发展	11,700	90,909.00	0.02
729	600759	洲际油气	32,300	89,471.00	0.02
730	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
731	600985	淮北矿业	8,900	88,911.00	0.02
732	002681	奋达科技	15,800	88,164.00	0.02
733	603355	莱克电气	3,700	87,579.00	0.02
734	300376	易事特	18,900	86,562.00	0.02
735	002375	亚厦股份	14,800	85,840.00	0.02
736	603486	科沃斯	4,200	85,218.00	0.02
737	600770	综艺股份	15,800	85,162.00	0.02
738	000061	农产品	15,100	84,409.00	0.02
739	600390	五矿资本	10,200	84,252.00	0.02
740	002653	海思科	4,100	83,476.00	0.02
741	300297	蓝盾股份	14,800	83,472.00	0.02
742	600575	淮河能源	32,400	83,268.00	0.02
743	000536	华映科技	30,800	83,160.00	0.02
744	002093	国脉科技	10,300	83,018.00	0.02
745	603868	飞科电器	2,200	82,896.00	0.02
746	000426	兴业矿业	16,600	82,502.00	0.02
747	600787	中储股份	15,800	82,318.00	0.02
748	600428	中远海特	21,900	81,906.00	0.02
749	002358	森源电气	11,700	81,783.00	0.02
750	601016	节能风电	33,900	81,699.00	0.02

751	002958	青农商行	12,500	80,875.00	0.02
752	002625	光启技术	8,800	80,520.00	0.02
753	002672	东江环保	8,800	79,200.00	0.02
754	000937	冀中能源	21,600	79,056.00	0.02
755	000600	建投能源	16,100	78,729.00	0.02
756	601162	天风证券	10,600	78,016.00	0.02
757	603766	隆鑫通用	20,900	77,957.00	0.02
758	000766	通化金马	11,900	77,826.00	0.02
759	600928	西安银行	10,000	77,700.00	0.02
760	600757	长江传媒	12,600	77,616.00	0.02
761	000980	众泰汽车	26,400	77,352.00	0.02
762	002416	爱施德	10,100	76,861.00	0.02
763	002424	贵州百灵	8,800	76,648.00	0.02
764	600623	华谊集团	11,400	75,810.00	0.02
765	002503	搜于特	31,500	75,285.00	0.02
766	002366	台海核电	10,600	73,776.00	0.02
767	600098	广州发展	11,200	73,248.00	0.02
768	600006	东风汽车	15,800	72,364.00	0.02
769	600996	贵广网络	8,800	70,840.00	0.02
770	600058	五矿发展	8,800	70,576.00	0.02
771	002482	广田集团	16,100	70,518.00	0.02
772	600350	山东高速	14,300	70,213.00	0.02
773	601001	大同煤业	15,800	69,520.00	0.02
774	601298	青岛港	9,900	68,013.00	0.02
775	002437	誉衡药业	22,400	67,872.00	0.02
776	600707	彩虹股份	16,100	67,620.00	0.02
777	601801	皖新传媒	12,300	67,404.00	0.02
778	002948	青岛银行	11,300	67,122.00	0.02
779	603983	丸美股份	1,100	66,033.00	0.02
780	600874	创业环保	8,900	63,991.00	0.02
781	600657	信达地产	15,800	63,042.00	0.02
782	600917	重庆燃气	8,500	61,710.00	0.02
783	603379	三美股份	1,600	59,760.00	0.01
784	601003	柳钢股份	10,500	59,325.00	0.01
785	002941	新疆交建	3,200	56,160.00	0.01
786	300199	翰宇药业	9,400	54,520.00	0.01
787	002946	新乳业	4,300	54,008.00	0.01
788	603317	天味食品	1,200	53,880.00	0.01
789	603650	彤程新材	3,000	52,260.00	0.01
790	603025	大豪科技	5,500	52,085.00	0.01
791	600335	国机汽车	8,900	51,620.00	0.01
792	601969	海南矿业	8,800	50,952.00	0.01
793	601860	紫金银行	8,800	49,456.00	0.01
794	601068	中铝国际	8,800	48,752.00	0.01

795	601865	福莱特	3,800	46,094.00	0.01
796	002423	中粮资本	4,600	44,666.00	0.01
797	001872	招商港口	2,600	44,616.00	0.01
798	600939	重庆建工	8,800	42,328.00	0.01
799	603877	太平鸟	2,700	41,229.00	0.01
800	002957	科瑞技术	1,100	36,047.00	0.01
801	603256	宏和科技	2,400	35,448.00	0.01
802	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
803	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
804	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	48,682,184.69	12.14
2	600519	贵州茅台	31,949,730.30	7.97
3	600036	招商银行	18,701,574.76	4.66
4	000651	格力电器	14,486,094.00	3.61
5	601166	兴业银行	13,652,682.49	3.41
6	000333	美的集团	13,363,575.80	3.33
7	000858	五粮液	12,785,666.00	3.19
8	600276	恒瑞医药	12,462,315.11	3.11
9	600887	伊利股份	8,363,988.66	2.09
10	000001	平安银行	8,110,921.00	2.02
11	601328	交通银行	7,688,241.00	1.92
12	600016	民生银行	7,644,372.40	1.91
13	000002	万科 A	7,368,336.01	1.84
14	300498	温氏股份	7,335,344.00	1.83
15	600000	浦发银行	7,322,878.40	1.83
16	600900	长江电力	6,917,850.00	1.73
17	601288	农业银行	6,863,841.00	1.71
18	601398	工商银行	6,162,700.00	1.54
19	002415	海康威视	5,984,589.58	1.49
20	600837	海通证券	5,849,085.33	1.46

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。

8.4.2 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	600094	大名城	198,993,215.49	49.63
2	002387	维信诺	161,607,412.20	40.31
3	002602	世纪华通	60,261,675.46	15.03
4	000651	格力电器	8,679,900.35	2.16
5	000333	美的集团	8,088,714.91	2.02
6	000858	五粮液	7,350,289.27	1.83
7	000001	平安银行	4,555,522.00	1.14
8	300498	温氏股份	4,180,283.20	1.04
9	000002	万科 A	3,966,042.00	0.99
10	002415	海康威视	3,557,395.00	0.89
11	002475	立讯精密	3,363,880.33	0.84
12	000725	京东方 A	2,707,174.00	0.68
13	300059	东方财富	2,423,789.00	0.60
14	002714	牧原股份	2,413,803.10	0.60
15	000063	中兴通讯	2,372,833.00	0.59
16	002142	宁波银行	2,369,986.86	0.59
17	688111	金山办公	2,052,260.00	0.51
18	000568	泸州老窖	1,861,425.00	0.46
19	002049	紫光国微	1,845,622.00	0.46
20	000338	潍柴动力	1,831,462.00	0.46

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。

8.4.3 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	854,006,863.99
卖出股票收入（成交）总额	631,616,856.16

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。

8.5 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）	634,690.18	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	634,690.18	0.16

8.6 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	1,890	188,996.69	0.05
2	128085	鸿达转债	1,390	138,997.56	0.03
3	128086	国轩转债	1,163	116,298.54	0.03
4	128084	木森转债	1,080	107,998.11	0.03
5	113030	东风转债	280	27,999.51	0.01

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

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、兴业银行外，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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	156,868.69
2	应收证券清算款	1,112,869.44
3	应收股利	-
4	应收利息	2,044.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,271,782.18

8.12.4 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。

8.12.5 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

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		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	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
4,317	93,099.11	125,114,59 7.00	31.13%	276,794,246 .00	68.87%	89,270,200 .00	22.21%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“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”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信证券股份有限公司	8,802,452.00	2.19%
2	赵亚新	8,000,000.00	1.99%
3	白洞明	6,599,100.00	1.64%
4	招商证券股份有限公司	6,297,315.00	1.57%
5	福建金牛贸易有限公司	5,000,000.00	1.24%
6	张招兴	5,000,000.00	1.24%
7	广发证券股份有限公司	4,205,800.00	1.05%
8	刘青	3,990,000.00	0.99%
9	中信建投证券股份有限公司	3,850,571.00	0.96%
10	肖金明	3,000,000.00	0.75%
11	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	89,270,200.00	22.21%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

9.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 10 月 8 日)基金份额总额	887,908,843.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	30,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	516,000,000.00
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	401,908,843.00

注：本基金合同生效日为 2019 年 10 月 08 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 60,000.00 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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	58,029,066.83	3.91%	22,322.02	3.63%	-
申万宏源	4	153,268,265.34	10.34%	66,109.09	10.76%	-
华创证券	2	67,241,861.95	4.54%	6,725.29	1.09%	-
广发证券	2	1,204,121,294.28	81.21%	519,342.79	84.51%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增西藏东方财富证券股份有限公司、招商证券股份有限公司各一个交易单元,新增华创证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司各两个交易单元,新增申万宏源证券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、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司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	
	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
招商证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-
平安证券	152,247.22	11.17%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华创证券	179,152.50	13.15%	-	-	-	-
广发证券	1,031,248.40	75.68%	-	-	-	-

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	2019-10-10
2	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	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	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-10-22
4	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证券报	2019-10-22
5	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加方正证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-10-25
6	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	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	2019-10-25
7	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加国盛证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2019-10-25
8	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加招商证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-10-31

9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中信建投证券为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2019-11-04
10	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加银河证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2019-11-12
11	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办证券公司的公告	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	2019-11-18
12	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金增加长江证券为申购赎回代办证券公司的公告	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	2019-11-21
13	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
14	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 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2019 年 11 月 13 日~2019 年 12 月 31 日	-	156,070,200.00	66,800,000.00	89,270,200.00	22.21%
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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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