**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**

**2019年第4季度报告**

**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**

**报告送出日期：二〇二〇年一月十八日**

# §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1月16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2019年10月1日起至12月31日止。

# §2 基金产品概况

## 2.1基金产品概况

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 基金简称 | 易方达沪深300ETF发起式联接 | |
| 基金主代码 | 110020 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2009年8月26日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,922,561,619.28份 | |
| 投资目标 | 紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 | |
| 投资策略 | 本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，本基金投资于目标ETF 的比例不低于基金资产净值的90%。在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，本基金决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。在正常市场情况下，力争将年化跟踪误差控制在4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率X95%+活期存款利率(税后)X5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为沪深300ETF的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深300ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达沪深300ETF发起式联接A | 易方达沪深300ETF发起式联接C |
| 下属分级基金的交易代码 | 110020 | 007339 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 4,098,234,319.37份 | 824,327,299.91份 |

注：自2019年4月25日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2019年4月26日。

## 2.1.1目标基金基本情况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金名称 | 易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金 |
| 基金主代码 | 510310 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式（ETF）、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2013年3月6日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2013年3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 |

## 2.1.2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。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。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在正常市场情况下，本基金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 | 沪深300指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金，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，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。 |

# §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  (2019年10月1日-2019年12月31日) | |
| 易方达沪深300ETF发起式联接A | 易方达沪深300ETF发起式联接C |
| 1.本期已实现收益 | 194,662,947.17 | 16,364,857.98 |
| 2.本期利润 | 415,354,795.48 | 29,306,205.85 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0926 | 0.0811 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,836,476,876.30 | 1,172,321,919.22 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.4241 | 1.4222 |

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**

**易方达沪深300ETF发起式联接A：**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 | 6.86% | 0.70% | 7.03% | 0.70% | -0.17% | 0.00% |

**易方达沪深300ETF发起式联接C：**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 | 6.81% | 0.69% | 7.03% | 0.70% | -0.22% | -0.01% |

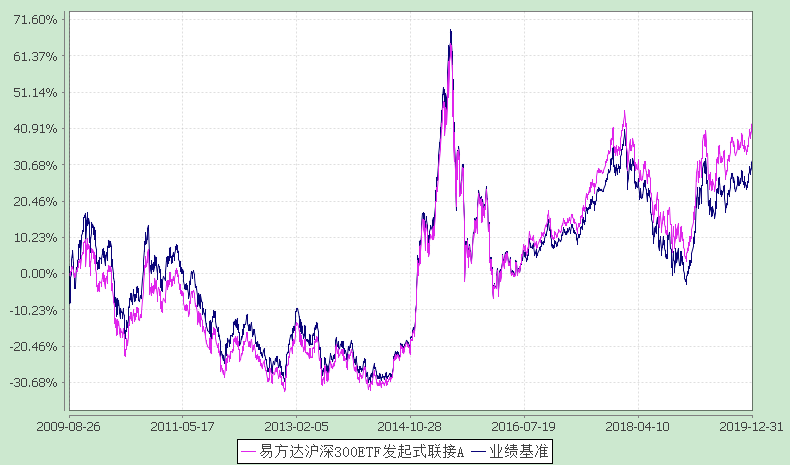
**3.2.2　自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较**

易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

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

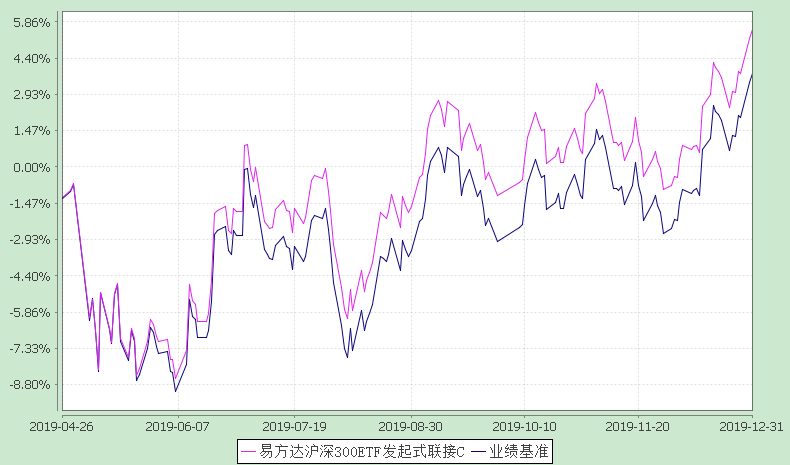
易方达沪深300ETF发起式联接A：

（2009年8月26日至2019年12月31日）



易方达沪深300ETF发起式联接C：

（2019年4月26日至2019年12月31日）



注：1.自2019年4月25日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2019年4月26日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值增长率为42.41%，同期业绩比较基准收益率为31.91%。C类基金份额净值增长率为5.57%，同期业绩比较基准收益率为3.79%。

# §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 |
| 余海燕 | 本基金的基金经理、易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达中证海外中国互联网50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达中证500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500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证50指数分级证券投资基金的基金经理、易方达上证50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50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达日兴资管日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理、易方达军工指数分级证券投资基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理、易方达黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达沪深300非银行金融交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理 | 2016-04-16 | - | 14年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行Consumer Credit Risk信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理。 |
| 杨俊 | 本基金的基金经理、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500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500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金的基金经理、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理、解决方案部总经理助理 | 2017-06-23 | - | 10年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司北京分公司渠道经理、指数与量化投资部高级账户经理。 |

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.2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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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28次，其中27次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，1次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

**4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年四季度以来国内宏观经济景气度较前期出现好转，企业库存继续回落，库存周期已由前期的主动去库存阶段进入到被动去库存阶段。最新公布的宏观经济数据呈现出改善迹象，11月份固定资产投资同比增加5.2%，与前值持平，社会消费品零售总额当月同比增加8.0%，前值7.2%；2019年1-11月规模以上工业企业利润总额累计同比增长-2.1%，前值为-2.9%，其中11月规模以上工业企业利润总额单月同比增速5.4%，大幅高于前值-9.9%；12月全国制造业PMI为50.2%，较11月持平，维持在年内次高点，且连续两个月处于扩张区间，指向制造业景气仍强。由于宏观经济整体下行压力犹存，四季度宏观经济政策延续了前期货币政策宽松和逆周期调节的力度，加速LPR作为存量贷款定价锚的改革以降低实体经济成本并推动信贷扩张。外围市场方面，在中美贸易摩擦阶段性缓和，美联储连续降息、重启回购和扩表等货币政策宽松之下，全球市场风险偏好提升，美股挑战历史新高。在中国宏观经济数据显示阶段性企稳的背景下，四季度人民币对美元即期汇率扭转前期贬值趋势，季末在岸和离岸美元对人民币即期汇率均回落至6.96附近。资本市场方面，随着经济数据回暖，央行连续调降政策利率、以及中美贸易摩擦阶段性缓和，A股市场对于后续经济企稳的预期升温，尤其12月份货币政策的边际放松超出市场预期，引发了股票市场反弹，四季度上证综指以上涨4.99%收官。风格方面，小盘股表现好于大盘股，上证50指数、沪深300指数、创业板指分别上涨5.71%、7.39%、10.48%；行业方面，建筑材料、电子、家用电器、传媒、房地产、证券公司、有色金属等板块涨幅居前，国防军工、商业贸易、保险等板块表现落后。

本基金是易方达沪深300ETF的联接基金，主要投资于沪深300ETF。报告期内本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，依据基金申购赎回变动的情况进行日常操作，控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低水平上。

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1.4241元，本报告期份额净值增长率为6.86%；C类基金份额净值为1.4222元，本报告期份额净值增长率为6.81%；同期业绩比较基准收益率为7.03%。

报告期内本基金日跟踪偏离度的均值为0.01%，年化跟踪误差为0.257%，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 | 41,083,544.08 | 0.58 |
|  | 其中：股票 | 41,083,544.08 | 0.58 |
| 2 | 基金投资 | 6,586,728,551.80 | 92.59 |
| 3 | 固定收益投资 | 231,760,982.05 | 3.26 |
|  | 其中：债券 | 231,760,982.05 | 3.26 |
|  | 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 | 228,873,138.70 | 3.22 |
| 8 | 其他资产 | 25,552,231.37 | 0.36 |
| 9 | 合计 | 7,113,998,448.00 | 100.00 |

**5.2期末投资目标基金明细**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 | 易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金 | 股票型 | 交易型开放式（ETF）、发起式 | 易方达基金管理有限公司 | 6,586,728,551.80 | 93.98 |

**5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合**

**5.3.1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 | 204,231.00 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 1,725,373.00 | 0.02 |
| C | 制造业 | 16,572,855.05 | 0.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,892,737.74 | 0.04 |
| E | 建筑业 | 946,736.00 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 420,199.00 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,025,921.00 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,424,443.55 | 0.02 |
| J | 金融业 | 13,208,310.70 | 0.19 |
| K | 房地产业 | 1,570,567.00 | 0.02 |
| L | 租赁和商务服务业 | 415,826.00 | 0.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 184,240.00 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 48,378.04 | 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 | 314,965.00 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 128,761.00 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
|  | 合计 | 41,083,544.08 | 0.59 |

**5.4 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 | 601318 | 中国平安 | 29,000 | 2,478,340.00 | 0.04 |
| 2 | 003816 | 中国广核 | 562,958 | 1,987,241.74 | 0.03 |
| 3 | 601916 | 浙商银行 | 294,195 | 1,370,948.70 | 0.02 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 1,077 | 1,274,091.00 | 0.02 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 27,000 | 1,014,660.00 | 0.01 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 13,700 | 898,446.00 | 0.01 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 5,800 | 771,458.00 | 0.01 |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 166,700 | 765,153.00 | 0.01 |
| 9 | 000333 | 美的集团 | 13,100 | 763,075.00 | 0.01 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 38,000 | 752,400.00 | 0.01 |

**5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(％) |
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 230,653,000.00 | 3.29 |
|  | 其中：政策性金融债 | 230,653,000.00 | 3.29 |
| 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） | 1,107,982.05 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 231,760,982.05 | 3.31 |

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（％） |
| 1 | 190302 | 19进出02 | 1,000,000 | 100,100,000.00 | 1.43 |
| 2 | 130310 | 13进出10 | 600,000 | 60,354,000.00 | 0.86 |
| 3 | 170205 | 17国开05 | 400,000 | 40,184,000.00 | 0.57 |
| 4 | 130208 | 13国开08 | 300,000 | 30,015,000.00 | 0.43 |
| 5 | 128085 | 鸿达转债 | 3,040 | 303,994.67 | 0.00 |

**5.7　报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**5.10.1 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 |
| - | - | - | - | - | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | - |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | -72,640.78 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | - |

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

**5.10.2 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。本基金在出现大额净申赎等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管理需求。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。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

**5.11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。

**5.12投资组合报告附注**

5.12.12019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，本基金的目标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。

5.12.2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。

**5.12.3其他各项资产构成**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 名称 | 金额(元) |
| 1 | 存出保证金 | 775,813.77 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,112,880.20 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,961,529.49 |
| 5 | 应收申购款 | 14,014,216.51 |
| 6 | 其他应收款 | 3,687,791.40 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 25,552,231.37 |

**5.12.4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。

**5.12.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
| 1 | 003816 | 中国广核 | 1,987,241.74 | 0.03 | 新股流通受限 |
| 2 | 601916 | 浙商银行 | 1,370,948.70 | 0.02 | 新股流通受限 |

# §6 开放式基金份额变动

单位：份

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 易方达沪深300ETF发起式联接A | 易方达沪深300ETF发起式联接C |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,985,135,682.31 | 210,509,981.59 |
| 本报告期基金总申购份额 | 809,881,573.23 | 1,027,344,840.42 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,696,782,936.17 | 413,527,522.10 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,098,234,319.37 | 824,327,299.91 |

# §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 | |
| 机构 | 1 | 2019年10月01日~2019年11月12日 | 1,206,158,344.25 | - | 1,206,158,344.25 | - | - | |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 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，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；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。 | | | | | | | |

# §9 备查文件目录

**9.1备查文件目录**

1.中国证监会核准易方达沪深300指数证券投资基金募集的文件；

2.中国证监会《关于易方达沪深300指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；

3.《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合同》；

4.《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托管协议》；

5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

6.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**

**二〇二〇年一月十八日**