**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**

**2020年第1季度报告**

**2020年3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：二〇二〇年四月二十一日**

# §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4月17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1月1日起至3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 | 4,625,883,787.82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 | 4,048,701,428.41份 | 577,182,359.41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(2020年1月1日-2020年3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 | 135,673,814.18 | 22,375,030.72 |
| 2.本期利润 | -468,453,368.51 | -79,233,143.76 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1188 | -0.1118 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,234,404,836.32 | 744,796,085.35 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2929 | 1.2904 |

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 | -9.21% | 1.84% | -9.49% | 1.86% | 0.28% | -0.02% |

**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 | -9.27% | 1.84% | -9.49% | 1.86% | 0.22% | -0.02% |

**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2020年3月31日）



易方达沪深300ETF发起式联接C：

（2019年4月26日至2020年3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29.29%，同期业绩比较基准收益率为19.39%。C类基金份额净值增长率为-4.21%，同期业绩比较基准收益率为-6.06%。

# §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、易方达上证50指数分级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、易方达证券公司指数分级证券投资基金的基金经理、易方达军工指数分级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、易方达黄金交易型开放式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、指数投资部副总经理 | 2016-04-16 | - | 15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500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（自2017年06月23日至2020年03月17日）、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（自2017年06月23日至2020年03月17日）、易方达国企改革指数分级证券投资基金的基金经理（自2017年06月23日至2020年03月17日）、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（自2019年03月20日至2020年03月25日）、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联接基金的基金经理、指数增强投资部总经理助理 | 2017-06-23 | 2020-03-18 | 11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、解决方案部总经理助理。 |

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17次，全部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

2020年一季度国内宏观经济面临新冠疫情的明显冲击，企业复工复产进度明显放缓，生产、销售受阻，导致1-2月份规模以上工业增加值、企业利润分别同比下降13.5%、38.3%。受到海外疫情不确定的影响，出口、生产恢复仍然需要时间，2020年一季度的经济增长回升势头将暂时停止，原先已表现出的经济内在动力回升趋势将受阻，整体经济增速将受到较大挑战。尽管新冠疫情在中国境内得到了有效控制，但其全球蔓延的态势自3月份以来则日渐严峻，面对疫情对经济信心的显著打击，全球各主要经济体先后采取大力度的货币宽松政策加以对冲，然而担忧情绪依旧没有消散，而且疫情发展态势也仍不明朗，疫情所带来的现实性冲击和政策性对冲的较量仍将是中短期主导全球乃至国内经济走向的关键力量。资本市场方面，海外疫情的超预期发展引起了金融市场巨震，美元流动性紧张又导致大类资产普跌，美股出现创纪录的4次熔断，美债收益率也下探至历史最低点。美联储祭出“零利率”后又推出无限QE，美国国会推出历史最大规模的2.2万亿美元经济刺激法案。相比之下国内资产在全球金融动荡中表现出了韧性。在流动性得到缓解后，全球股市明显反弹，A股也随之结束自3月初的剧烈下跌并开始反弹，一季度上证综指以下跌9.83%收官。风格主题方面，结构分化显著，在科技类板块表现领先的背景下，创业板表现优于主板，上证50指数、沪深300指数分别下跌12.20%、10.02%，而创业板指上涨4.10%；行业方面，农林牧渔、医药生物、计算机、通信等板块涨幅居前，休闲服务、保险、采掘、家用电器、交通运输、银行、房地产等板块跌幅较大。

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1.2929元，本报告期份额净值增长率为-9.21%；C类基金份额净值为1.2904元，本报告期份额净值增长率为-9.27%；同期业绩比较基准收益率为-9.49%。

报告期内本基金日跟踪偏离度的均值为0.02%，年化跟踪误差为0.415%，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 | 71,531,384.47 | 1.19 |
|  | 其中：股票 | 71,531,384.47 | 1.19 |
| 2 | 基金投资 | 5,579,420,828.33 | 92.87 |
| 3 | 固定收益投资 | 100,280,000.00 | 1.67 |
|  | 其中：债券 | 100,280,000.00 | 1.67 |
|  | 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 | 224,151,309.10 | 3.73 |
| 8 | 其他资产 | 32,128,331.37 | 0.53 |
| 9 | 合计 | 6,007,511,853.27 | 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 | 5,579,420,828.33 | 93.31 |

**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 | - | - |
| B | 采矿业 | 2,746,532.00 | 0.05 |
| C | 制造业 | 23,571,737.81 | 0.39 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,294,712.00 | 0.04 |
| E | 建筑业 | 2,384,177.00 | 0.04 |
| F | 批发和零售业 | 814,907.31 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,216,261.32 | 0.12 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,252,553.97 | 0.04 |
| J | 金融业 | 27,242,130.06 | 0.46 |
| K | 房地产业 | 1,803,452.00 | 0.03 |
| L | 租赁和商务服务业 | 611,639.00 | 0.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 524,842.00 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 68,440.00 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
|  | 合计 | 71,531,384.47 | 1.20 |

**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 | 85,237 | 5,895,843.29 | 0.10 |
| 2 | 601816 | 京沪高铁 | 906,536 | 5,094,732.32 | 0.09 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 2,925 | 3,249,675.00 | 0.05 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 78,265 | 2,526,394.20 | 0.04 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 23,212 | 2,136,200.36 | 0.04 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 110,200 | 1,753,282.00 | 0.03 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 63,800 | 1,413,808.00 | 0.02 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 46,357 | 1,384,220.02 | 0.02 |
| 9 | 601916 | 浙商银行 | 294,195 | 1,167,954.15 | 0.02 |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 66,700 | 1,153,243.00 | 0.02 |

**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 | 100,280,000.00 | 1.68 |
|  | 其中：政策性金融债 | 100,280,000.00 | 1.68 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 100,280,000.00 | 1.68 |

**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 | 130310 | 13进出10 | 600,000 | 60,228,000.00 | 1.01 |
| 2 | 170205 | 17国开05 | 400,000 | 40,052,000.00 | 0.67 |

**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 |
| IF2004 | IF2004 | 15 | 16,474,500.00 | 319,500.00 | 在本报告期内，基金利用股指期货进行套期保值操作，以应对基金由于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对冲需求，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。  |
| IF2005 | IF2005 | 2 | 2,188,080.00 | 90,480.00 | 在本报告期内，基金利用股指期货进行套期保值操作，以应对基金由于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对冲需求，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。  |
| 公允价值变动总额合计(元) | 409,980.00 |
| 股指期货投资本期收益(元) | -2,223,786.41 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | 409,980.00 |

**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。

**5.11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**

5.12.1 2019年7月8日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局针对兴业银行股份有限公司信用卡中心1、2016年1月至2018年1月在为部分客户办理信用卡业务时未遵守总授信额度管理制度；2、2016年至2018年8月对部分信用卡申请人资信水平调查严重不尽职的违法违规行为，责令改正，并处罚款40万元。

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

2019年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、格力电器外，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、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。

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 | 2,867,104.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | 290,846.64 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,539,012.62 |
| 5 | 应收申购款 | 24,532,835.04 |
| 6 | 其他应收款 | 898,532.78 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 32,128,331.37 |

**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 | 601816 | 京沪高铁 | 5,094,732.32 | 0.09 | 新股流通受限 |
| 2 | 601916 | 浙商银行 | 1,167,954.15 | 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 |
| 报告期期初基金份额总额 | 4,098,234,319.37 | 824,327,299.91 |
| 报告期基金总申购份额 | 1,307,900,285.20 | 373,696,924.33 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 1,357,433,176.16 | 620,841,864.83 |
| 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 | 4,048,701,428.41 | 577,182,359.41 |

# §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 备查文件目录

**8.1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。

**8.2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。

**8.3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**

**二〇二〇年四月二十一日**