

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

2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十八日

§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 2024 年 7 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	易方达中证 800ETF 联接发起式
基金主代码	007856
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 21 日
报告期末基金份额总额	129,034,915.27 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达中证 800ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证 800ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内，主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、股票（含存托凭证）投

	资策略、债券和货币市场工具投资策略、金融衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资业务策略等。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于易方达中证 800ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与中证 800 指数的表现密切相关。	
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	易方达中证 800ETF 联接发起式 A	易方达中证 800ETF 联接发起式 C
下属分级基金的交易代码	007856	007857
报告期末下属分级基金的份额总额	92,342,724.47 份	36,692,190.80 份

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.1.2 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（含存托凭证）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，基金管理人可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。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 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。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，适当参与债券和货币市场工具的投资。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金融衍生产品。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。
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。

§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	
	(2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 800ETF 联接发起式 A	易方达中证 800ETF 联接发起式 C
1.本期已实现收益	1,766.67	45,093.88
2.本期利润	-2,299,460.09	-729,230.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0252	-0.0222
4.期末基金资产净值	102,294,290.04	40,451,706.57

5.期末基金份额净值	1.1078	1.1025
------------	--------	--------

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

易方达中证 800ETF 联接发起式 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	-2.10%	0.78%	-3.09%	0.79%	0.99%	-0.01%
过去六个月	-0.44%	0.98%	-1.64%	0.98%	1.20%	0.00%
过去一年	-8.39%	0.88%	-11.35%	0.89%	2.96%	-0.01%
过去三年	-26.65%	0.97%	-30.91%	0.99%	4.26%	-0.02%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.78%	1.07%	-7.56%	1.09%	18.34%	-0.02%

易方达中证 800ETF 联接发起式 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	-2.12%	0.78%	-3.09%	0.79%	0.97%	-0.01%
过去六个月	-0.49%	0.98%	-1.64%	0.98%	1.15%	0.00%
过去一年	-8.48%	0.88%	-11.35%	0.89%	2.87%	-0.01%
过去三年	-26.87%	0.97%	-30.91%	0.99%	4.04%	-0.02%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合	10.25%	1.07%	-7.56%	1.09%	17.81%	-0.02%

同生效起 至今						
------------	--	--	--	--	--	--

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

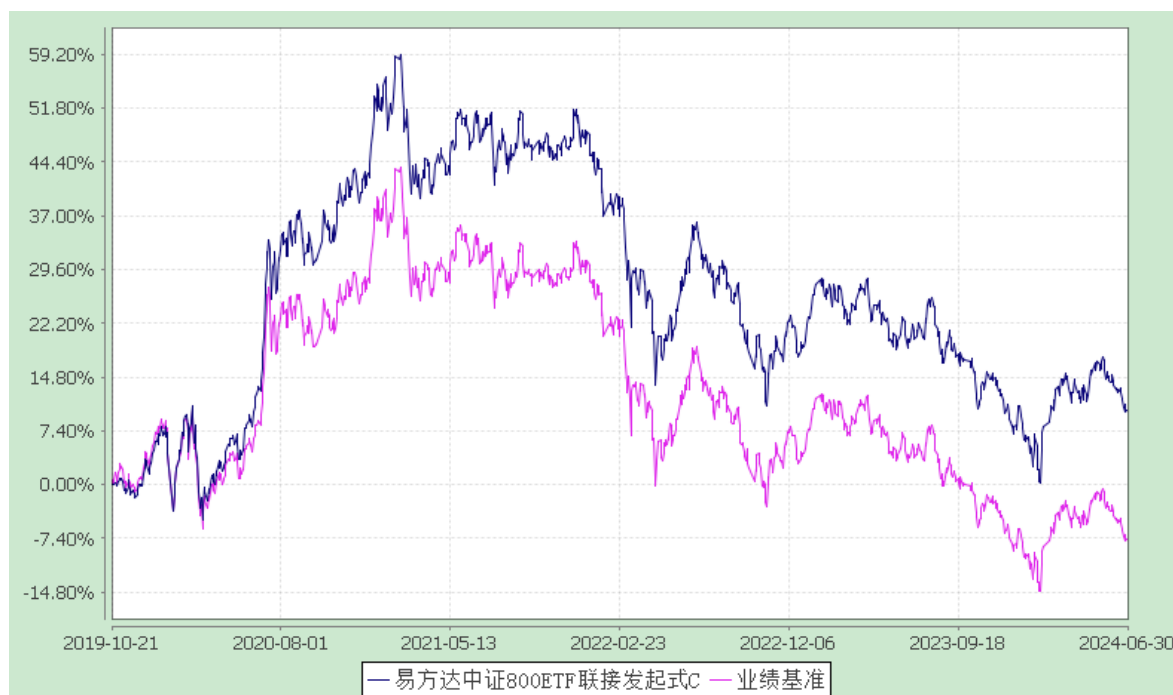
易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 10 月 21 日至 2024 年 6 月 30 日)

易方达中证 800ETF 联接发起式 A:



易方达中证 800ETF 联接发起式 C:



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 10.78%，同期业绩比较基准收益率为-7.56%；C 类基金份额净值增长率为 10.25%，同期业绩比较基准收益率为-7.56%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林伟斌	本基金的基金经理，易方达中证 800ETF、易方达中证红利 ETF、易方达中证红利 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 50ETF、易方达上证科创板 50 联接、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF 联接、易方达纳斯达克 100ETF	2019-10-21	-	16 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研究员、基金经理助理、量化基金组合部副总经理、量化策略部副总经理、指数投资部副总经理，易方达沪深 300ETF 发起式、易方达沪深 300ETF 发起

	<p>(QDII)、易方达中证 2000ETF、易方达 MSCI 美国 50ETF (QDII)、易方达中证红利低波动 ETF、易方达中证 A50ETF、易方达中证 A50ETF 联接发起式的基金经理, 指数投资部总经理、指数投资决策委员会委员</p>				<p>式联接、易方达黄金 ETF、易方达中证 500ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF)、易方达中证国有企业改革指数 (LOF)、易方达上证 50 指数 (LOF)、易方达中证 500 质量成长 ETF 的基金经理。</p>
刘树荣	<p>本基金的基金经理, 易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达中小企业 100 指数 (LOF)、易方达中证万得并购重组指数 (LOF)、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达香港恒生综合小型股指数 (QDII-LOF)、易方达上证中盘 ETF、易方达中证 800ETF、易方达中证国企一带一路 ETF 联接发起式、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达中证银行 ETF 联接 (LOF)、易方达中证银行 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF、易方达中证 1000ETF、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证港股通消费主题 ETF 联接发起式、易方达中证长江保护主题 ETF 联接发起式的基金经理, 易方达中证港股通消费主题</p>	2019-10-21	-	17 年	<p>硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计, 易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员, 易方达深证成指 ETF 联接、易方达深证成指 ETF、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达中证浙江新动能 ETF 联接 (QDII)、易方达中证浙江新动能 ETF (QDII) 的基金经理。</p>

	ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达创业板中盘 200ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达创业板成长 ETF 的基金经理助理				
--	---	--	--	--	--

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行业协会相关规定。

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 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、决策流程和交易流程，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，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 21 次，其中 18 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，3 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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为易方达中证 800ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资于易方达中证

800ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达中证 800ETF 跟踪中证 800 指数，该指数由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场中大市值公司的股票价格表现。

2024 年第二季度，受宏观政策持续效应与外部需求适度改善等积极因素的共同推动，国民经济延续了回升向好的态势，整体运行保持稳健。在此背景下，A 股市场呈现出一种先扬后抑、震荡调整的格局。具体而言，自二季度初至 5 月中旬，随着国内经济复苏迹象的逐步显现和政策层面利好消息的陆续发布，投资者的风险偏好持续上升，推动 A 股市场整体呈现震荡上涨的趋势。五月下旬至本报告期末，鉴于外部环境复杂性与严峻程度的加剧，以及国内经济在持续复苏过程中所面临的诸多困难与挑战，投资者对市场前景持审慎态度，股票市场在此期间呈现出波动调整的态势。本报告期，中证 800 指数下跌 3.27%。行业结构上看，中证 800 指数权重占比较大的行业为银行、电子、非银金融、食品饮料、电力设备与医药生物，本报告期，上述权重行业中仅银行、电子获得正收益，其他行业均有不同程度下跌拖累指数表现。

中证 800 指数作为覆盖了大部分 A 股市值的代表性宽基指数，市值风格偏向于中大盘，行业分布相对均衡，指数表现与中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关。投资者在进行指数基金投资时应充分了解指数的特点，并选择与自身风险承受能力相匹配的产品。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，依据基金申赎变动等情况进行日常组合管理，力求跟踪误差最小化。

4.5 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 1.1078 元，本报告期份额净值增长率为-2.10%，同期业绩比较基准收益率为-3.09%；C 类基金份额净值为 1.1025 元，本报告期份额净值增长率为-2.12%，同期业绩比较基准收益率为-3.09%。年化跟踪误差 0.79%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	37,012.00	0.03
	其中：股票	37,012.00	0.03
2	基金投资	131,235,639.62	91.78
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	11,007,315.35	7.70
8	其他资产	717,073.56	0.50
9	合计	142,997,040.53	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	易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	131,235,639.62	91.94

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	-	-
C	制造业	1,126.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,661.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,964.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,312.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,145.00	0.01
J	金融业	4,956.00	0.00
K	房地产业	1,848.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,012.00	0.03

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1 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	601728	中国电信	2,300	14,145.00	0.01
2	600905	三峡能源	2,100	9,156.00	0.01
3	601688	华泰证券	400	4,956.00	0.00
4	600018	上港集团	400	2,312.00	0.00
5	603939	益丰药房	80	1,964.00	0.00

6	600895	张江高科	100	1,848.00	0.00
7	601991	大唐发电	500	1,505.00	0.00
8	600399	抚顺特钢	200	1,126.00	0.00

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前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
IC2412	IC2412	3	2,900,280.00	-181,480.00	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。
IF2412	IF2412	1	1,026,600.00	-41,520.00	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)					-223,000.00
股指期货投资本期收益(元)					436,769.29
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-623,620.00

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 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

本基金为目标 ETF 的联接基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，大唐国际发电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京市发展和改革委员会的处罚。华泰证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局江苏省分局、中国人民银行江苏省分行的处罚。上海国际港务(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海市交通委员会执法总队的处罚。益丰大药房连锁股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到长沙县市场监督管理局、长沙县行政执法局、国家税务总局常德市西洞庭西湖管理区税务局、衡山县消防救援大队、湖南湘江新区管理委员会商务和市场监管局、开福区市场监督管理局、祁阳市市场监督管理局、湘潭市岳塘区市场监督管理局、湘乡市医疗保障局、益阳市城市管理和综合执法局、醴陵市城市管理和综合执法局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	484,230.41
2	应收证券清算款	99,570.22
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	133,272.93
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	717,073.56

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证800ETF 联接发起式A	易方达中证800ETF 联接发起式C
报告期期初基金份额总额	89,906,301.28	20,069,252.97
报告期期间基金总申购份额	6,456,695.94	43,633,382.44
减：报告期期间基金总赎回份额	4,020,272.75	27,010,444.61
报告期期间基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	92,342,724.47	36,692,190.80

§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

单位：份

项目	易方达中证 800ETF 联 接发起式 A	易方达中证 800ETF 联 接发起式 C
报告期期初管理人持有的本 基金份额	60,524,440.05	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本 基金份额	60,524,440.05	-
报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例（%）	65.5433	-

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份 额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份 额总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承 诺持有期限

基金管理人固有资金	60,524,440.05	46.9055%	10,000,000.00	7.7498%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	60,524,440.05	46.9055%	10,000,000.00	7.7498%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2024年04月01日~2024年06月30日	60,524,440.05	0.00	0.00	60,524,440.05	46.91%

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；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，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，本基金将按照基金合同的约定终止基金合同，不需召开基金份额持有人大会；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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

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

3. 《易方达中证 800 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》;
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

10.2 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。

10.3 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

二〇二四年七月十八日