

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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

送出日期：二〇二五年八月三十日

§ 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。本中期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 2025 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 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	53
7.7 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	53
7.8 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	53
7.9 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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54

7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 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情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
10.2 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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 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	60
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 量化增强证券投资基金
基金简称	易方达沪深 300 量化增强
基金主代码	110030
交易代码	110030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 7 月 5 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	535,941,827.87 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要策略为复制标的指数，投资组合将以标的指数的构成为基础，主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果，结合基金管理人的长期研究与实践应用，利用多因子量化模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。本基金可投资存托凭证。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金中的指数增强型基金，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。

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	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	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；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	510620；519031	100033
法定代表人	吴欣荣	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	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；广东省珠海市 横琴新区荣粤道 188 号 6 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	8,683,221.62
本期利润	38,076,519.73
加权平均基金份额本期利润	0.0690
本期加权平均净值利润率	2.73%
本期基金份额净值增长率	2.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	645,338,318.29
期末可供分配基金份额利润	1.2041
期末基金资产净值	1,395,397,098.94
期末基金份额净值	2.6036
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	160.36%

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.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。

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
过去一个月	3.38%	0.58%	2.37%	0.55%	1.01%	0.03%
过去三个月	2.20%	1.10%	1.21%	1.04%	0.99%	0.06%
过去六个月	2.66%	1.02%	0.07%	0.97%	2.59%	0.05%
过去一年	15.47%	1.34%	13.12%	1.32%	2.35%	0.02%
过去三年	-13.80%	1.09%	-11.43%	1.05%	-2.37%	0.04%
自基金合同生效起至今	160.36%	1.32%	58.39%	1.28%	101.97%	0.04%

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

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

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

(2012 年 7 月 5 日至 2025 年 6 月 30 日)



注：1.自 2013 年 6 月 7 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×80%+活期存款利率（税后）×20%”调整为“沪深 300 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 160.36%，同期业绩比较基准收益率为 58.39%。

§ 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，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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		
王建军	本基金的基金经理，易方达量化策略精选混合、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通量化增强、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达高股息量化选股股票发起式的基金经理，量化投资部负责人、量化投资决策委员会委员、投资经理	2021-09-04	-	18 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、量化投资部副总经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF 联接、易方达创业板 ETF、易方达中小板指数分级、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达重组分级的基金经理。
明朗	本基金的基金经理，易方达高股息量化选股股票发起式的基金经理，量化研究员	2023-11-09	-	10 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任交通银行股份有限公司高级投资经理，易方达基金管理有限公司投资经理、投资经理助理。

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/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行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王建军	公募基金	5	1,664,787,714.37	2021-09-04
	私募资产管理计划	1	15,696,760,496.79	2019-07-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	6	17,361,548,211.16	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 38 次，其中 31 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，7 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 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

回顾本报告期内，国内经济在复杂的国际局势下体现了一定的韧性。一、二季度的 GDP 增长平稳，分别为 5.4% 和 5.2%。制造业 PMI 数据在四月受到外部冲击降至荣枯平衡线之下后，五、六月边际回升。从 M2 指标来看，上半年的货币增速稳中有升，在六月达到上半年新高 8.3%，显示整体

经济的扩张动能在逐渐改善。消费方面，虽然国际形势复杂、外部冲击较大，但在以旧换新的政策支持下社零有韧性。投资方面，尽管地产投资负贡献较大，制造业和基建投资保持高增速，托起了整体固定资产投资增速，从而整体经济保持平稳。

从股票市场表现来看，上半年沪深 300 指数收益率为 0.03%，中证 500 指数收益率为 3.31%，创业板指数收益率为 0.53%。虽然国际环境充满挑战和不确定性，但投资者对 A 股市场依然保持乐观，市场交投活跃整体偏强。从行业表现来看，有色金属、银行和国防军工等行业表现较好，煤炭、食品饮料和房地产等行业表现较差。

报告期内，本基金依托量化选股模型，平衡中长期基本面与短期情绪指标，优选长期质地好、中短期具有性价比的公司进行均衡配置。在市场的震荡行情中，本基金积极进行调仓换股，坚持配置基本面相对优质的标的，并通过量化指标回避因标的拥挤度过高带来的风险。本基金在下阶段的投资运作中仍将坚持基本面量化投资的投资理念，以长期稳健收益为目标持续优化策略模型，力争为投资者创造稳健且持续的投资回报。

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 2.6036 元，本报告期份额净值增长率为 2.66%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。年化跟踪误差 2.04%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，尽管贸易谈判依然有不确定性，外部环境的风险尚未消除，但国内的政策应对工具丰富，可对经济起到对冲和支撑的作用。另一方面，资本市场的流动性在利率下行和政策引导的环境下保持充裕，叠加弱美元环境，外部资金也有流入的机会，因此股市风险偏好有望维持，我们看好 A 股后续表现。

管理人在下阶段的投资运作中，将坚持使用基本面量化模型优选质地优良、性价比有优势的标的进行配置，重点把握市场的结构性机会。

4.6 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程序和技术，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直接的重大利益冲突。

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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	87,583,514.03	82,915,173.12
结算备付金		3,924,467.70	5,428,325.72
存出保证金		151,227.45	264,280.55
交易性金融资产	6.4.7.2	1,317,539,176.42	1,345,307,336.16
其中：股票投资		1,317,379,219.47	1,345,307,336.16
基金投资		-	-
债券投资		159,956.95	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	7,255,191.22
应收股利		-	-
应收申购款		611,273.36	5,368,618.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,409,809,658.96	1,446,538,924.84
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		10,134,047.41	-
应付赎回款		2,774,161.90	5,992,697.84
应付管理人报酬		906,836.32	989,266.73
应付托管费		170,031.83	185,487.51
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	0.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	427,481.89	478,400.24
负债合计		14,412,560.02	7,645,852.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	535,941,827.87	567,359,008.38
未分配利润	6.4.7.8	859,455,271.07	871,534,063.94

净资产合计		1,395,397,098.94	1,438,893,072.32
负债和净资产总计		1,409,809,658.96	1,446,538,924.84

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.6036 元，基金份额总额 535,941,827.87 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		44,782,283.72	16,684,495.41
1.利息收入		156,884.77	108,701.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	156,884.77	108,701.28
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,070,490.69	-81,335,628.64
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-416,808.47	-90,632,676.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	14,933.99	10,060.74
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	66,353.83	-
股利收益	6.4.7.14	15,406,011.34	9,286,986.88
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	29,393,298.11	97,856,880.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	161,610.15	54,541.81
减：二、营业总支出		6,705,763.99	4,111,676.50
1. 管理人报酬		5,523,925.76	3,295,317.91
2. 托管费		1,035,736.06	617,872.11
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		239.54	0.13
8. 其他费用	6.4.7.18	145,862.63	198,486.35

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,076,519.73	12,572,818.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,076,519.73	12,572,818.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		38,076,519.73	12,572,818.91

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	567,359,008.38	871,534,063.94	1,438,893,072.32
二、本期期初净资产	567,359,008.38	871,534,063.94	1,438,893,072.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,417,180.51	-12,078,792.87	-43,495,973.38
（一）、综合收益总额	-	38,076,519.73	38,076,519.73
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-31,417,180.51	-50,155,312.60	-81,572,493.11
其中：1.基金申购款	43,131,098.90	65,103,023.37	108,234,122.27
2.基金赎回款	-74,548,279.41	-115,258,335.97	-189,806,615.38
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	535,941,827.87	859,455,271.07	1,395,397,098.94
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	360,331,899.04	440,796,338.61	801,128,237.65
二、本期期初净资产	360,331,899.04	440,796,338.61	801,128,237.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,443,629.63	19,417,275.78	25,860,905.41
（一）、综合收益总额	-	12,572,818.91	12,572,818.91
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	6,443,629.63	6,844,456.87	13,288,086.50
其中：1.基金申购款	40,661,728.59	50,167,284.09	90,829,012.68
2.基金赎回款	-34,218,098.96	-43,322,827.22	-77,540,926.18
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	366,775,528.67	460,213,614.39	826,989,143.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金（原名易方达量化衍伸股票型证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]627 号《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 248,871,987.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 6,407.02 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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。

根据中国证监会 2013 年 6 月 7 日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监许可[2013]742 号），易方达量化衍伸股票型证券投资基金自 2013 年 6 月 7 日起变更为易方达沪深 300 量化增强证券投资基金，修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。

6.4.2 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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 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。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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征增值税试点的通知》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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	87,583,514.03
等于：本金	87,575,376.91
加：应计利息	8,137.12
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	87,583,514.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,272,894,950.92	-	1,317,379,219.47	44,484,268.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所 市场	129,399.92	59.23	159,956.95	30,497.80
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	129,399.92	59.23	159,956.95	30,497.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,273,024,350.84	59.23	1,317,539,176.42	44,514,766.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,780.93
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	324,977.35
其中：交易所市场	324,977.35
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,723.61
合计	427,481.89

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	567,359,008.38	567,359,008.38
本期申购	43,131,098.90	43,131,098.90
本期赎回（以“-”号填列）	-74,548,279.41	-74,548,279.41
本期末	535,941,827.87	535,941,827.87

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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
上年度末	673,563,461.37	197,970,602.57	871,534,063.94
本期期初	673,563,461.37	197,970,602.57	871,534,063.94
本期利润	8,683,221.62	29,393,298.11	38,076,519.73
本期基金份额交易产生的变动数	-36,908,364.70	-13,246,947.90	-50,155,312.60
其中：基金申购款	50,213,899.66	14,889,123.71	65,103,023.37
基金赎回款	-87,122,264.36	-28,136,071.61	-115,258,335.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	645,338,318.29	214,116,952.78	859,455,271.07

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	146,578.77
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	9,850.91
其他	455.09
合计	156,884.77

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-416,808.47
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-416,808.47

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,069,858,940.61
减：卖出股票成本总额	3,067,745,135.98
减：交易费用	2,530,613.10
买卖股票差价收入	-416,808.47

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	68.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	14,865.45
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	14,933.99

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	120,881.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	106,000.00
减：应计利息总额	11.62
减：交易费用	4.84
买卖债券差价收入	14,865.45

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	66,353.83

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	15,406,011.34
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	15,406,011.34

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	29,393,298.11
——股票投资	29,362,800.31
——债券投资	30,497.80
——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	29,393,298.11

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	161,610.15
合计	161,610.15

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	34,216.24
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,902.93
指数使用费	49,236.09
合计	145,862.63

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	-	-	1,348,921,842.98	39.97%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30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	326,393.23	40.92%	160,015.29	42.52%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.2024 年 7 月 1 日前，本基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为基金提供的证券交易服务及研究服务。自 2024 年 7 月 1 日起，本基金佣金协议约定的服务仅包括证券交易服务，不包括研究服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,523,925.76	3,295,317.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,658,786.82	952,413.90
应支付基金管理人的净管理费	3,865,138.94	2,342,904.01

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，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，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,035,736.06	617,872.11

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，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，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

无。

6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	87,583,514.03	146,578.77	54,296,806.65	90,906.89

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
00135	富岭	2025-0	6 个月	新股	5.30	14.44	709	3,757.	10,237	-

6	股份	1-16		流通受限				70	.96	
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月以内	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	350	9,620.72	15,827.00	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新股流通受限	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-

301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	166	15,521.00	15,049.56	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股流通	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-

				受限						
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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、基金投资部门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、监察合规管理部门、集中交易部门、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。

本基金属股票型基金中的指数增强型基金，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。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，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 2025 年 6 月 30 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 0.01%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	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企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00

A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	159,956.95	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	159,956.95	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大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控

并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2025 年 6 月 30 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(净资产)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。

6.4.13.3.1 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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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，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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	87,583,514.03	-	-	-	87,583,514.03
结算备付金	3,924,467.70	-	-	-	3,924,467.70
存出保证金	151,227.45	-	-	-	151,227.45
交易性金融资产	-	-	159,956.95	1,317,379,219.47	1,317,539,176.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	611,273.36	611,273.36
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	91,659,209.18	-	159,956.95	1,317,990,492.83	1,409,809,658.96
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	10,134,047.41	10,134,047.41
应付赎回款	-	-	-	2,774,161.90	2,774,161.90
应付管理人报酬	-	-	-	906,836.32	906,836.32
应付托管费	-	-	-	170,031.83	170,031.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	427,481.89	427,481.89
负债总计	-	-	-	14,412,560.02	14,412,560.02
利率敏感度缺口	91,659,209.18	-	159,956.95	1,303,577,932.81	1,395,397,098.94

上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	82,915,173.12	-	-	-	82,915,173.12
结算备付金	5,428,325.72	-	-	-	5,428,325.72
存出保证金	264,280.55	-	-	-	264,280.55
交易性金融资产	-	-	-	1,345,307,336.16	1,345,307,336.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,255,191.22	7,255,191.22
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,368,618.07	5,368,618.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	88,607,779.39	-	-	1,357,931,145.45	1,446,538,924.84
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,992,697.84	5,992,697.84
应付管理人报酬	-	-	-	989,266.73	989,266.73
应付托管费	-	-	-	185,487.51	185,487.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.20	0.20
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	478,400.24	478,400.24
负债总计	-	-	-	7,645,852.52	7,645,852.52
利率敏感度缺口	88,607,779.39	-	-	1,350,285,292.93	1,438,893,072.32

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。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,317,379,219.47	94.41	1,345,307,336.16	93.50
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	1,317,379,219.47	94.41	1,345,307,336.16	93.50

6.4.13.4.3.2 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	72,136,426.23	78,500,128.53
	2.业绩比较基准下降 5%	-72,136,426.23	-78,500,128.53

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	1,317,115,133.59
第二层次	15,385.54
第三层次	408,657.29
合计	1,317,539,176.42

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,317,379,219.47	93.44
	其中：股票	1,317,379,219.47	93.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	159,956.95	0.01
	其中：债券	159,956.95	0.01
	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	91,507,981.73	6.49
8	其他各项资产	762,500.81	0.05
9	合计	1,409,809,658.96	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	15,822,140.00	1.13
B	采矿业	52,615,420.00	3.77
C	制造业	537,469,507.53	38.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,605,469.00	2.98
E	建筑业	11,796,787.00	0.85
F	批发和零售业	1,979,776.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	18,195,042.00	1.30

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,418,991.35	3.40
J	金融业	321,166,411.82	23.02
K	房地产业	5,118,264.00	0.37
L	租赁和商务服务业	6,463,936.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	17,080,896.00	1.22
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	4,310,592.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,081,043,232.70	77.47

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	1,442.00	0.00
B	采矿业	3,865,966.00	0.28
C	制造业	143,105,320.89	10.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,004,295.00	0.57
E	建筑业	19,520.00	0.00
F	批发和零售业	4,193,512.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	18,248.00	0.00
H	住宿和餐饮业	1,413.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,074,896.79	2.44
J	金融业	22,989,073.30	1.65
K	房地产业	9,293,776.00	0.67
L	租赁和商务服务业	1,343,459.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	2,168,819.79	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	1,908.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,168,275.00	0.51
S	综合	86,062.00	0.01
	合计	236,335,986.77	16.94

7.3 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

7.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	41,077	57,898,853.04	4.15
2	600036	招商银行	1,026,747	47,179,024.65	3.38
3	300750	宁德时代	183,287	46,228,647.14	3.31
4	601318	中国平安	721,088	40,005,962.24	2.87
5	600900	长江电力	810,700	24,434,498.00	1.75
6	000333	美的集团	306,258	22,111,827.60	1.58
7	601166	兴业银行	881,800	20,581,212.00	1.47
8	002594	比亚迪	58,100	19,283,971.00	1.38
9	601009	南京银行	1,616,300	18,781,406.00	1.35
10	601899	紫金矿业	935,174	18,235,893.00	1.31
11	601229	上海银行	1,579,500	16,758,495.00	1.20
12	002475	立讯精密	478,735	16,607,317.15	1.19
13	601211	国泰海通	854,456	16,371,376.96	1.17
14	600919	江苏银行	1,351,400	16,135,716.00	1.16
15	600276	恒瑞医药	305,559	15,858,512.10	1.14
16	000651	格力电器	350,587	15,748,368.04	1.13
17	300059	东方财富	654,433	15,137,035.29	1.08
18	600660	福耀玻璃	263,700	15,033,537.00	1.08
19	600030	中信证券	519,775	14,356,185.50	1.03
20	601328	交通银行	1,781,200	14,249,600.00	1.02
21	002371	北方华创	29,990	13,261,877.90	0.95
22	600031	三一重工	735,200	13,196,840.00	0.95
23	603259	药明康德	177,300	12,331,215.00	0.88
24	688041	海光信息	83,285	11,767,337.65	0.84
25	002352	顺丰控股	235,100	11,463,476.00	0.82
26	002230	科大讯飞	224,150	10,732,302.00	0.77
27	688981	中芯国际	120,783	10,649,437.11	0.76
28	601601	中国太保	275,300	10,326,503.00	0.74

29	600887	伊利股份	369,900	10,312,812.00	0.74
30	600050	中国联通	1,778,200	9,495,588.00	0.68
31	603986	兆易创新	74,700	9,451,791.00	0.68
32	300274	阳光电源	136,600	9,257,382.00	0.66
33	300760	迈瑞医疗	40,800	9,169,800.00	0.66
34	300308	中际旭创	62,780	9,157,090.80	0.66
35	601127	赛力斯	67,700	9,093,464.00	0.65
36	600809	山西汾酒	51,200	9,031,168.00	0.65
37	002714	牧原股份	214,000	8,990,140.00	0.64
38	002142	宁波银行	308,400	8,437,824.00	0.60
39	002241	歌尔股份	341,900	7,973,108.00	0.57
40	300502	新易盛	62,460	7,933,669.20	0.57
41	000001	平安银行	633,874	7,650,859.18	0.55
42	601398	工商银行	998,500	7,578,615.00	0.54
43	600926	杭州银行	443,900	7,466,398.00	0.54
44	000858	五粮液	59,800	7,110,220.00	0.51
45	002463	沪电股份	160,900	6,851,122.00	0.49
46	300498	温氏股份	400,000	6,832,000.00	0.49
47	600760	中航沈飞	114,100	6,688,542.00	0.48
48	600585	海螺水泥	303,100	6,507,557.00	0.47
49	603019	中科曙光	91,200	6,420,480.00	0.46
50	000983	山西焦煤	994,100	6,362,240.00	0.46
51	603799	华友钴业	166,800	6,174,936.00	0.44
52	600941	中国移动	54,800	6,167,740.00	0.44
53	300661	圣邦股份	81,980	5,965,684.60	0.43
54	601901	方正证券	748,000	5,916,680.00	0.42
55	601100	恒立液压	81,700	5,882,400.00	0.42
56	601066	中信建投	244,000	5,868,200.00	0.42
57	600406	国电南瑞	260,800	5,844,528.00	0.42
58	600023	浙能电力	1,099,200	5,825,760.00	0.42
59	002050	三花智控	215,200	5,676,976.00	0.41
60	300433	蓝思科技	250,600	5,588,380.00	0.40
61	601688	华泰证券	307,800	5,481,918.00	0.39
62	000063	中兴通讯	166,900	5,422,581.00	0.39
63	600489	中金黄金	364,400	5,331,172.00	0.38
64	002648	卫星化学	303,800	5,264,854.00	0.38
65	688303	大全能源	245,254	5,228,815.28	0.37
66	000977	浪潮信息	102,600	5,220,288.00	0.37
67	600160	巨化股份	181,600	5,208,288.00	0.37
68	002001	新和成	244,300	5,196,261.00	0.37
69	600219	南山铝业	1,340,600	5,134,498.00	0.37
70	601077	渝农商行	712,200	5,085,108.00	0.36
71	601878	浙商证券	465,200	5,075,332.00	0.36

72	688111	金山办公	17,547	4,914,037.35	0.35
73	600362	江西铜业	204,800	4,798,464.00	0.34
74	601088	中国神华	117,900	4,779,666.00	0.34
75	000568	泸州老窖	42,100	4,774,140.00	0.34
76	601117	中国化学	611,600	4,690,972.00	0.34
77	601816	京沪高铁	803,800	4,621,850.00	0.33
78	600600	青岛啤酒	66,200	4,598,252.00	0.33
79	688271	联影医疗	35,831	4,577,051.94	0.33
80	000708	中信特钢	380,600	4,475,856.00	0.32
81	601995	中金公司	124,100	4,388,176.00	0.31
82	601668	中国建筑	755,400	4,358,658.00	0.31
83	300015	爱尔眼科	345,400	4,310,592.00	0.31
84	601808	中海油服	312,700	4,302,752.00	0.31
85	002920	德赛西威	41,800	4,269,034.00	0.31
86	601728	中国电信	549,700	4,260,175.00	0.31
87	002415	海康威视	146,400	4,059,672.00	0.29
88	600436	片仔癀	20,200	4,040,202.00	0.29
89	600547	山东黄金	124,100	3,962,513.00	0.28
90	601838	成都银行	188,200	3,782,820.00	0.27
91	000725	京东方 A	942,200	3,759,378.00	0.27
92	600188	兖矿能源	293,800	3,575,546.00	0.26
93	605499	东鹏饮料	11,310	3,551,905.50	0.25
94	600011	华能国际	491,000	3,505,740.00	0.25
95	601888	中国中免	57,200	3,487,484.00	0.25
96	601898	中煤能源	316,100	3,458,134.00	0.25
97	300759	康龙化成	140,750	3,454,005.00	0.25
98	601818	光大银行	821,600	3,409,640.00	0.24
99	000538	云南白药	60,300	3,364,137.00	0.24
100	000425	徐工机械	423,800	3,292,926.00	0.24
101	300418	昆仑万维	94,600	3,181,398.00	0.23
102	601138	工业富联	140,200	2,997,476.00	0.21
103	002027	分众传媒	406,600	2,968,180.00	0.21
104	600886	国投电力	192,600	2,838,924.00	0.20
105	601336	新华保险	48,500	2,837,250.00	0.20
106	300033	同花顺	9,800	2,675,498.00	0.19
107	600016	民生银行	560,500	2,662,375.00	0.19
108	600048	保利发展	322,000	2,608,200.00	0.19
109	688472	阿特斯	268,614	2,457,818.10	0.18
110	605117	德业股份	45,480	2,394,976.80	0.17
111	601868	中国能建	1,052,300	2,346,629.00	0.17
112	601288	农业银行	375,800	2,209,704.00	0.16
113	601628	中国人寿	52,500	2,162,475.00	0.15
114	000661	长春高新	21,500	2,132,370.00	0.15

115	601658	邮储银行	377,600	2,065,472.00	0.15
116	002600	领益智造	230,900	1,983,431.00	0.14
117	601607	上海医药	110,500	1,975,740.00	0.14
118	600015	华夏银行	218,900	1,731,499.00	0.12
119	601766	中国中车	237,000	1,668,480.00	0.12
120	000002	万科 A	250,000	1,605,000.00	0.12
121	600893	航发动力	41,200	1,587,848.00	0.11
122	000157	中联重科	210,600	1,522,638.00	0.11
123	000100	TCL 科技	338,500	1,465,705.00	0.11
124	601689	拓普集团	30,900	1,460,025.00	0.10
125	601360	三六零	142,100	1,449,420.00	0.10
126	603288	海天味业	36,828	1,432,977.48	0.10
127	000999	华润三九	45,290	1,416,671.20	0.10
128	600027	华电国际	257,200	1,406,884.00	0.10
129	002304	洋河股份	21,600	1,394,280.00	0.10
130	300896	爱美客	7,900	1,380,999.00	0.10
131	600196	复星医药	54,900	1,377,441.00	0.10
132	600085	同仁堂	37,500	1,352,250.00	0.10
133	600000	浦发银行	95,400	1,324,152.00	0.09
134	300347	泰格医药	24,300	1,295,676.00	0.09
135	600061	国投资本	164,900	1,240,048.00	0.09
136	003816	中国广核	327,400	1,191,736.00	0.09
137	000617	中油资本	162,200	1,184,060.00	0.08
138	688169	石头科技	7,507	1,175,220.85	0.08
139	600795	国电电力	236,000	1,142,240.00	0.08
140	603369	今世缘	27,100	1,055,003.00	0.08
141	601012	隆基绿能	62,500	938,750.00	0.07
142	300394	天孚通信	11,600	926,144.00	0.07
143	601877	正泰电器	40,800	924,936.00	0.07
144	001979	招商蛇口	103,200	905,064.00	0.06
145	002074	国轩高科	26,700	866,682.00	0.06
146	600028	中国石化	153,400	865,176.00	0.06
147	603392	万泰生物	14,100	860,100.00	0.06
148	600690	海尔智家	33,500	830,130.00	0.06
149	300122	智飞生物	37,900	742,461.00	0.05
150	600089	特变电工	61,200	730,116.00	0.05
151	603195	公牛集团	15,100	728,575.00	0.05
152	601006	大秦铁路	110,200	727,320.00	0.05
153	002236	大华股份	45,300	719,364.00	0.05
154	688012	中微公司	3,943	718,808.90	0.05
155	688047	龙芯中科	5,030	670,951.70	0.05
156	600176	中国巨石	56,500	644,100.00	0.05
157	601238	广汽集团	81,800	612,682.00	0.04

158	601698	中国卫通	28,600	585,442.00	0.04
159	000792	盐湖股份	32,900	561,932.00	0.04
160	000975	山金国际	28,500	539,790.00	0.04
161	002028	思源电气	7,000	510,370.00	0.04
162	001289	龙源电力	31,300	506,434.00	0.04
163	601998	中信银行	58,700	498,950.00	0.04
164	600346	恒力石化	33,400	476,284.00	0.03
165	002311	海大集团	8,100	474,579.00	0.03
166	603501	豪威集团	3,700	472,305.00	0.03
167	300408	三环集团	13,500	450,900.00	0.03
168	600009	上海机场	13,500	428,895.00	0.03
169	603260	合盛硅业	8,900	421,860.00	0.03
170	601225	陕西煤业	21,700	417,508.00	0.03
171	601633	长城汽车	19,200	412,416.00	0.03
172	601857	中国石油	45,900	392,445.00	0.03
173	603993	洛阳钼业	46,500	391,530.00	0.03
174	000938	紫光股份	16,300	391,037.00	0.03
175	600332	白云山	14,800	390,128.00	0.03
176	601800	中国交建	43,800	389,382.00	0.03
177	300628	亿联网络	10,800	375,408.00	0.03
178	002422	科伦药业	10,100	362,792.00	0.03
179	601169	北京银行	52,900	361,307.00	0.03
180	601985	中国核电	37,900	353,228.00	0.03
181	600588	用友网络	26,400	352,968.00	0.03
182	601600	中国铝业	49,600	349,184.00	0.03
183	600377	宁沪高速	20,100	308,334.00	0.02
184	300014	亿纬锂能	6,500	297,765.00	0.02
185	600741	华域汽车	16,500	291,225.00	0.02
186	601919	中远海控	16,900	254,176.00	0.02
187	600233	圆通速递	18,600	239,754.00	0.02
188	688256	寒武纪	378	227,367.00	0.02
189	688187	时代电气	5,311	226,514.15	0.02
190	600905	三峡能源	50,700	215,982.00	0.02
191	300442	润泽科技	4,200	208,026.00	0.01
192	002460	赣锋锂业	5,500	185,735.00	0.01
193	300979	华利集团	3,500	183,995.00	0.01
194	600999	招商证券	8,900	156,551.00	0.01
195	601799	星宇股份	1,200	150,000.00	0.01
196	600183	生益科技	4,900	147,735.00	0.01
197	600584	长电科技	4,300	144,867.00	0.01
198	300124	汇川技术	2,200	142,054.00	0.01
199	600018	上港集团	23,300	133,043.00	0.01
200	002252	上海莱士	19,200	131,904.00	0.01

201	000800	一汽解放	18,000	123,480.00	0.01
202	600674	川投能源	6,700	107,468.00	0.01
203	600309	万华化学	1,600	86,816.00	0.01
204	002601	龙佰集团	5,200	84,292.00	0.01
205	000895	双汇发展	3,100	75,671.00	0.01
206	600803	新奥股份	3,900	73,710.00	0.01
207	688506	百利天恒	246	72,845.52	0.01
208	603833	欧派家居	600	33,870.00	0.00
209	600958	东方证券	3,200	30,976.00	0.00
210	300999	金龙鱼	1,000	29,530.00	0.00
211	600066	宇通客车	1,100	27,346.00	0.00
212	688009	中国通号	4,727	24,296.78	0.00
213	600989	宝丰能源	1,500	24,210.00	0.00
214	601390	中国中铁	1,900	10,659.00	0.00
215	000625	长安汽车	800	10,208.00	0.00
216	600029	南方航空	1,600	9,440.00	0.00
217	600482	中国动力	400	9,228.00	0.00
218	600415	小商品城	400	8,272.00	0.00
219	002179	中航光电	200	8,072.00	0.00
220	601021	春秋航空	100	5,565.00	0.00
221	000963	华东医药	100	4,036.00	0.00
222	600161	天坛生物	200	3,838.00	0.00
223	600104	上汽集团	200	3,210.00	0.00
224	600025	华能水电	300	2,865.00	0.00
225	600460	士兰微	100	2,482.00	0.00
226	001965	招商公路	200	2,400.00	0.00
227	000166	申万宏源	400	2,008.00	0.00
228	601699	潞安环能	100	1,055.00	0.00
229	601111	中国国航	100	789.00	0.00
230	601669	中国电建	100	487.00	0.00

7.3.2 期末积极投资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	688536	思瑞浦	43,365	6,015,592.80	0.43
2	688018	乐鑫科技	40,425	5,906,092.50	0.42
3	301536	星辰科技	94,300	5,686,290.00	0.41
4	600316	洪都航空	149,200	5,624,840.00	0.40
5	000733	振华科技	103,600	5,185,180.00	0.37
6	600163	中闽能源	995,800	5,098,496.00	0.37
7	601577	长沙银行	511,300	5,082,322.00	0.36

8	000933	神火股份	277,300	4,614,272.00	0.33
9	601456	国联民生	379,800	3,930,930.00	0.28
10	600866	星湖科技	567,400	3,920,734.00	0.28
11	002850	科达利	34,300	3,881,731.00	0.28
12	601696	中银证券	362,600	3,876,194.00	0.28
13	002939	长城证券	453,300	3,798,654.00	0.27
14	601992	金隅集团	2,332,100	3,544,792.00	0.25
15	300017	网宿科技	328,200	3,518,304.00	0.25
16	600961	株冶集团	314,600	3,517,228.00	0.25
17	300251	光线传媒	172,500	3,496,575.00	0.25
18	688322	奥比中光	57,633	3,400,923.33	0.24
19	688685	迈信林	59,855	3,342,901.75	0.24
20	000729	燕京啤酒	244,600	3,162,678.00	0.23
21	600398	海澜之家	449,800	3,130,608.00	0.22
22	600383	金地集团	815,300	3,089,987.00	0.22
23	688279	峰岬科技	16,150	2,995,825.00	0.21
24	601001	晋控煤业	237,000	2,896,140.00	0.21
25	600498	烽火通信	132,400	2,784,372.00	0.20
26	300496	中科创达	48,300	2,763,726.00	0.20
27	002244	滨江集团	282,500	2,754,375.00	0.20
28	002739	万达电影	236,800	2,706,624.00	0.19
29	001283	豪鹏科技	47,200	2,570,040.00	0.18
30	603893	瑞芯微	16,500	2,505,690.00	0.18
31	000560	我爱我家	842,300	2,501,631.00	0.18
32	002568	百润股份	94,000	2,407,340.00	0.17
33	600862	中航高科	89,200	2,326,336.00	0.17
34	603298	杭叉集团	106,100	2,222,795.00	0.16
35	603039	泛微网络	39,100	2,177,870.00	0.16
36	000959	首钢股份	628,800	2,137,920.00	0.15
37	000709	河钢股份	985,500	2,128,680.00	0.15
38	600298	安琪酵母	60,400	2,124,268.00	0.15
39	600729	重庆百货	71,200	2,123,896.00	0.15
40	600461	洪城环境	217,800	2,099,592.00	0.15
41	002153	石基信息	236,300	2,046,358.00	0.15
42	300699	光威复材	61,600	1,950,872.00	0.14
43	600959	江苏有线	567,100	1,950,824.00	0.14
44	688523	航天环宇	89,414	1,923,295.14	0.14
45	688625	呈和科技	62,443	1,909,506.94	0.14
46	300454	深信服	20,000	1,883,600.00	0.13
47	300545	联得装备	56,800	1,806,240.00	0.13
48	603890	春秋电子	154,700	1,794,520.00	0.13
49	300161	华中数控	67,600	1,790,724.00	0.13
50	688592	司南导航	38,062	1,761,889.98	0.13

51	688052	纳芯微	9,912	1,729,544.88	0.12
52	300476	胜宏科技	12,200	1,639,436.00	0.12
53	002956	西麦食品	69,600	1,633,512.00	0.12
54	600909	华安证券	279,000	1,626,570.00	0.12
55	603125	常青科技	91,296	1,606,809.60	0.12
56	600177	雅戈尔	216,700	1,581,910.00	0.11
57	600060	海信视像	68,400	1,574,568.00	0.11
58	688627	精智达	17,784	1,565,169.84	0.11
59	601528	瑞丰银行	247,990	1,435,862.10	0.10
60	603786	科博达	25,700	1,424,037.00	0.10
61	688606	奥泰生物	20,702	1,391,174.40	0.10
62	688518	联赢激光	66,734	1,360,706.26	0.10
63	300976	达瑞电子	27,300	1,359,267.00	0.10
64	003015	日久光电	78,500	1,346,275.00	0.10
65	688002	睿创微纳	19,289	1,344,829.08	0.10
66	600732	爱旭股份	102,400	1,341,440.00	0.10
67	603380	易德龙	50,400	1,340,640.00	0.10
68	688499	利元亨	32,149	1,337,719.89	0.10
69	603337	杰克股份	37,100	1,331,148.00	0.10
70	002901	大博医疗	36,600	1,326,384.00	0.10
71	600153	建发股份	127,600	1,323,212.00	0.09
72	002384	东山精密	35,000	1,321,950.00	0.09
73	688677	海泰新光	33,617	1,311,399.17	0.09
74	605116	奥锐特	62,000	1,295,800.00	0.09
75	300919	中伟股份	38,800	1,275,744.00	0.09
76	605266	健之佳	59,300	1,247,079.00	0.09
77	603198	迎驾贡酒	29,800	1,175,014.00	0.08
78	002007	华兰生物	74,100	1,161,147.00	0.08
79	301367	瑞迈特	13,800	1,160,580.00	0.08
80	002138	顺络电子	40,800	1,147,296.00	0.08
81	688200	华峰测控	7,841	1,130,672.20	0.08
82	000951	中国重汽	63,300	1,112,814.00	0.08
83	688212	澳华内镜	22,262	1,090,838.00	0.08
84	688332	中科蓝讯	10,478	1,080,072.24	0.08
85	605319	无锡振华	28,800	983,808.00	0.07
86	601921	浙版传媒	119,100	959,946.00	0.07
87	002202	金风科技	93,300	956,325.00	0.07
88	300450	先导智能	38,200	949,270.00	0.07
89	300917	特发服务	22,400	947,296.00	0.07
90	300457	赢合科技	40,900	940,700.00	0.07
91	601128	常熟银行	123,560	910,637.20	0.07
92	002558	巨人网络	38,600	909,030.00	0.07
93	300001	特锐德	36,100	865,317.00	0.06

94	002281	光迅科技	16,600	818,712.00	0.06
95	688073	毕得医药	13,274	770,157.48	0.06
96	601965	中国汽研	41,100	729,525.00	0.05
97	603290	斯达半导	8,700	707,049.00	0.05
98	603606	东方电缆	12,900	667,059.00	0.05
99	000690	宝新能源	146,500	666,575.00	0.05
100	688131	皓元医药	13,779	666,214.65	0.05
101	688117	圣诺生物	19,682	662,299.30	0.05
102	688475	萤石网络	19,879	626,586.08	0.04
103	002293	罗莱生活	70,400	615,296.00	0.04
104	301004	嘉益股份	9,200	609,316.00	0.04
105	601168	西部矿业	36,000	598,680.00	0.04
106	000997	新大陆	18,400	595,792.00	0.04
107	601665	齐鲁银行	92,900	587,128.00	0.04
108	002727	一心堂	35,400	578,436.00	0.04
109	600517	国网英大	112,400	573,240.00	0.04
110	688608	恒玄科技	1,507	524,405.86	0.04
111	002966	苏州银行	59,000	518,020.00	0.04
112	603323	苏农银行	85,600	480,216.00	0.03
113	688236	春立医疗	25,174	467,984.66	0.03
114	300724	捷佳伟创	8,200	445,260.00	0.03
115	688099	晶晨股份	6,226	442,108.26	0.03
116	688249	晶合集成	20,658	418,737.66	0.03
117	000932	华菱钢铁	93,700	412,280.00	0.03
118	600456	宝钛股份	13,000	408,590.00	0.03
119	002946	新乳业	21,400	401,678.00	0.03
120	600486	扬农化工	6,400	371,200.00	0.03
121	688141	杰华特	11,201	364,928.58	0.03
122	688300	联瑞新材	7,774	361,879.70	0.03
123	002080	中材科技	18,000	351,000.00	0.03
124	000887	中鼎股份	19,000	334,210.00	0.02
125	300212	易华录	15,200	330,752.00	0.02
126	688387	信科移动	55,145	311,569.25	0.02
127	600882	妙可蓝多	10,100	308,353.00	0.02
128	600131	国网信通	15,700	277,890.00	0.02
129	002484	江海股份	13,100	268,419.00	0.02
130	301187	欧圣电气	9,400	259,440.00	0.02
131	301196	唯科科技	3,700	250,379.00	0.02
132	000034	神州数码	6,400	240,896.00	0.02
133	300595	欧普康视	15,300	233,631.00	0.02
134	000401	冀东水泥	52,400	229,512.00	0.02
135	600299	安迪苏	22,800	220,020.00	0.02
136	603225	新凤鸣	20,300	216,195.00	0.02

137	002472	双环传动	5,900	197,591.00	0.01
138	600403	大有能源	49,700	188,363.00	0.01
139	000878	云南铜业	14,700	186,984.00	0.01
140	002440	闰土股份	23,500	179,070.00	0.01
141	600075	新疆天业	39,700	167,931.00	0.01
142	601096	宏盛华源	40,500	167,670.00	0.01
143	600273	嘉化能源	19,200	162,432.00	0.01
144	300037	新宙邦	4,600	161,920.00	0.01
145	600582	天地科技	26,700	159,933.00	0.01
146	002340	格林美	25,100	159,385.00	0.01
147	002432	九安医疗	4,200	153,006.00	0.01
148	300763	锦浪科技	2,500	143,475.00	0.01
149	601231	环旭电子	9,700	141,911.00	0.01
150	002407	多氟多	11,400	138,966.00	0.01
151	600497	驰宏锌锗	23,900	126,431.00	0.01
152	603596	伯特利	2,300	121,187.00	0.01
153	002959	小熊电器	2,500	116,100.00	0.01
154	300803	指南针	1,400	112,924.00	0.01
155	688425	铁建重工	27,287	111,330.96	0.01
156	688318	财富趋势	944	108,484.48	0.01
157	688676	金盘科技	3,196	106,906.20	0.01
158	600378	昊华科技	3,600	97,452.00	0.01
159	002240	盛新锂能	7,100	91,448.00	0.01
160	600021	上海电力	10,200	89,658.00	0.01
161	600737	中粮糖业	9,400	88,830.00	0.01
162	002532	天山铝业	10,500	87,255.00	0.01
163	600673	东阳光	7,400	86,062.00	0.01
164	002008	大族激光	3,400	82,858.00	0.01
165	002984	森麒麟	4,400	82,500.00	0.01
166	600563	法拉电子	700	76,363.00	0.01
167	688693	锆威特	2,309	76,220.09	0.01
168	603091	众鑫股份	1,200	75,924.00	0.01
169	600885	宏发股份	3,380	75,407.80	0.01
170	603659	璞泰来	3,900	73,242.00	0.01
171	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
172	600871	石化油服	33,300	64,935.00	0.00
173	601966	玲珑轮胎	4,400	64,548.00	0.00
174	603600	永艺股份	5,600	59,584.00	0.00
175	300146	汤臣倍健	5,200	58,448.00	0.00
176	603486	科沃斯	1,000	58,230.00	0.00
177	688692	达梦数据	261	58,174.29	0.00
178	000830	鲁西化工	5,100	52,530.00	0.00
179	600906	财达证券	7,200	49,104.00	0.00

180	688411	海博思创	560	46,754.40	0.00
181	600348	华阳股份	6,900	45,954.00	0.00
182	002821	凯莱英	500	44,125.00	0.00
183	000988	华工科技	900	42,309.00	0.00
184	600566	济川药业	1,600	42,128.00	0.00
185	300223	北京君正	600	41,520.00	0.00
186	300073	当升科技	900	39,483.00	0.00
187	600873	梅花生物	3,600	38,484.00	0.00
188	600707	彩虹股份	5,700	36,822.00	0.00
189	002156	通富微电	1,400	35,868.00	0.00
190	603979	金诚信	700	32,508.00	0.00
191	002603	以岭药业	2,200	31,020.00	0.00
192	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
193	601139	深圳燃气	4,100	26,076.00	0.00
194	002851	麦格米特	500	25,070.00	0.00
195	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
196	605589	圣泉集团	800	22,200.00	0.00
197	603160	汇顶科技	300	21,309.00	0.00
198	601158	重庆水务	4,400	20,416.00	0.00
199	600925	苏能股份	3,900	20,397.00	0.00
200	002127	南极电商	5,100	20,247.00	0.00
201	600820	隧道股份	3,200	19,520.00	0.00
202	002690	美亚光电	1,100	18,557.00	0.00
203	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
204	688349	三一重能	695	17,333.30	0.00
205	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
206	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
207	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
208	002572	索菲亚	1,100	15,411.00	0.00
209	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
210	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
211	601156	东航物流	1,100	14,399.00	0.00
212	002085	万丰奥威	900	14,301.00	0.00
213	603338	浙江鼎力	300	14,220.00	0.00
214	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
215	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
216	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
217	000937	冀中能源	2,200	12,650.00	0.00
218	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
219	002409	雅克科技	200	10,938.00	0.00
220	002271	东方雨虹	1,000	10,730.00	0.00
221	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
222	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00

223	300487	蓝晓科技	200	10,060.00	0.00
224	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
225	603179	新泉股份	200	9,394.00	0.00
226	000021	深科技	500	9,370.00	0.00
227	002429	兆驰股份	2,100	9,198.00	0.00
228	688278	特宝生物	126	9,085.86	0.00
229	688032	禾迈股份	89	8,887.54	0.00
230	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
231	002056	横店东磁	600	8,490.00	0.00
232	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
233	688563	航材股份	138	7,814.94	0.00
234	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
235	300390	天华新能	400	7,628.00	0.00
236	601990	南京证券	900	7,272.00	0.00
237	002738	中矿资源	220	7,075.20	0.00
238	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
239	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
240	002595	豪迈科技	100	5,922.00	0.00
241	300558	贝达药业	100	5,795.00	0.00
242	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
243	000039	中集集团	700	5,502.00	0.00
244	603207	小方制药	185	5,359.45	0.00
245	300144	宋城演艺	600	5,130.00	0.00
246	001203	大中矿业	500	4,725.00	0.00
247	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
248	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
249	002653	海思科	100	4,222.00	0.00
250	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
251	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
252	603658	安图生物	100	3,750.00	0.00
253	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
254	000559	万向钱潮	400	3,060.00	0.00
255	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
256	002152	广电运通	200	2,688.00	0.00
257	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
258	000403	派林生物	130	2,356.90	0.00
259	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
260	002831	裕同科技	100	2,342.00	0.00
261	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
262	003020	立方制药	100	2,232.00	0.00
263	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
264	600352	浙江龙盛	200	2,032.00	0.00
265	603568	伟明环保	100	1,908.00	0.00

266	600765	中航重机	100	1,688.00	0.00
267	603056	德邦股份	100	1,592.00	0.00
268	688363	华熙生物	29	1,489.15	0.00
269	600598	北大荒	100	1,442.00	0.00
270	600258	首旅酒店	100	1,413.00	0.00
271	603885	吉祥航空	100	1,347.00	0.00
272	603997	继峰股份	100	1,304.00	0.00
273	603086	先达股份	100	980.00	0.00
274	600995	南网储能	100	978.00	0.00
275	600710	苏美达	100	961.00	0.00
276	600004	白云机场	100	910.00	0.00
277	600546	山煤国际	100	873.00	0.00
278	600295	鄂尔多斯	100	871.00	0.00
279	001286	陕西能源	100	870.00	0.00
280	600867	通化东宝	100	820.00	0.00
281	600956	新天绿能	100	772.00	0.00
282	601666	平煤股份	100	741.00	0.00
283	002035	华帝股份	100	629.00	0.00
284	600325	华发股份	100	487.00	0.00
285	000883	湖北能源	100	451.00	0.00
286	600863	内蒙华电	100	411.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	26,598,766.00	1.85
2	603986	兆易创新	25,821,661.60	1.79
3	601127	赛力斯	24,584,841.00	1.71
4	601328	交通银行	24,061,907.68	1.67
5	600900	长江电力	23,936,321.00	1.66
6	600519	贵州茅台	22,509,396.00	1.56
7	601009	南京银行	22,243,016.42	1.55
8	300750	宁德时代	21,607,283.20	1.50
9	601229	上海银行	21,552,055.00	1.50
10	600660	福耀玻璃	20,810,741.76	1.45
11	002594	比亚迪	20,670,188.45	1.44
12	600406	国电南瑞	20,210,084.32	1.40
13	600031	三一重工	19,135,756.00	1.33
14	002475	立讯精密	17,952,164.41	1.25
15	300274	阳光电源	17,894,717.00	1.24
16	002850	科达利	16,421,073.00	1.14

17	002371	北方华创	16,391,626.00	1.14
18	300661	圣邦股份	15,528,678.55	1.08
19	000651	格力电器	15,345,892.00	1.07
20	603893	瑞芯微	15,224,717.00	1.06

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	000333	美的集团	28,706,637.15	2.00
2	600519	贵州茅台	27,606,789.00	1.92
3	300750	宁德时代	22,664,195.00	1.58
4	000858	五粮液	21,745,915.00	1.51
5	002594	比亚迪	20,534,754.00	1.43
6	603986	兆易创新	20,470,603.00	1.42
7	601127	赛力斯	19,199,156.96	1.33
8	603501	豪威集团	18,381,225.00	1.28
9	601166	兴业银行	17,968,409.00	1.25
10	600406	国电南瑞	17,835,836.20	1.24
11	002475	立讯精密	17,423,544.61	1.21
12	601012	隆基绿能	17,378,485.96	1.21
13	601688	华泰证券	17,234,381.00	1.20
14	000725	京东方 A	16,395,885.00	1.14
15	300124	汇川技术	16,120,163.00	1.12
16	600926	杭州银行	15,864,971.00	1.10
17	688256	寒武纪	15,752,283.88	1.09
18	002920	德赛西威	15,318,045.67	1.06
19	300274	阳光电源	15,266,694.40	1.06
20	601128	常熟银行	15,008,807.80	1.04

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。

7.4.3 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	3,010,454,218.98
卖出股票收入（成交）总额	3,069,858,940.61

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。

7.5 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）	159,956.95	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	159,956.95	0.01

7.6 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	123254	亿纬转债	1,174	145,368.67	0.01
2	113693	志邦转债	120	14,588.28	0.00

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。本基金投资股指期货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。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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业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福建监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市交通运输局的处罚。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到福建省上杭县住房和城乡建设局的处罚。

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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	151,227.45
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	611,273.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	762,500.81

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
36,925	14,514.34	141,194,672.67	26.35%	394,747,155.20	73.65%

8.2 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	536,016.75	0.1000%

8.3 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 7 月 5 日）基金份额总额	248,871,987.37
本报告期期初基金份额总额	567,359,008.38
本报告期基金总申购份额	43,131,098.90
减：本报告期基金总赎回份额	74,548,279.41
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	535,941,827.87

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本基金管理人于 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	1,981,331,177.55	32.62%	198,133.24	32.62%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	1,566,714,628.30	25.79%	156,671.62	25.79%	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
国投证券	2	248,978,966.63	4.10%	24,899.35	4.10%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	2,276,935,867.51	37.49%	227,706.00	37.49%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为中银国际证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为华源证券股份有限公司。国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司合并为国泰海通证券股份有限公司。

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。本报告期内基金证券经营机构的选择标准有调整，调整后的标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 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。

10.7.2 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
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	120,881.91	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-15

2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2025-01-21
3	关于易方达基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同、托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
4	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
5	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
8	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-25
9	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报	2025-03-31
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2025-04-22
12	易方达基金管理有限公司关于恢复北京加和基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-10
13	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-17
14	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占

		到或者超过20%的时间区间					比
机构	1	2025 年 01 月 01 日 ~2025 年 06 月 30 日	139,116,202 .63	0.00	0.00	139,116,202.6 3	25.96 %
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。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》；
- 3.《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金托管协议》；
- 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。

12.2 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。

12.3 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
二〇二五年八月三十日