

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年三月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计意见	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	75
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	76
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	76
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	76
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	76
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	76
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12	投资组合报告附注	77
§ 9	基金份额持有人信息	77
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
9.3	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	78
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	78
§ 10	开放式基金份额变动	79
§ 11	重大事件揭示	79
11.1	基金份额持有人大会决议	79
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	79
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4	基金投资策略的改变	80
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	80
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	80
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8	其他重大事件	83
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	85
§ 13	备查文件目录	85
13.1	备查文件目录	85
13.2	存放地点	85
13.3	查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达量化策略精选混合	
基金主代码	002216	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 19 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	60,891,098.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达量化策略精选混合 A	易方达量化策略精选混合 C
下属分级基金的交易代码	002216	002217
报告期末下属分级基金的份额总额	40,648,116.04 份	20,242,982.78 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用量化策略进行投资组合管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	量化策略是指根据金融市场历史数据，借助量化模型，进行金融市场的分析、判断和交易的策略。本基金基于不同市场情况，精选多种量化模型进行投资，运用的量化模型包括但不限于量化资产配置模型、多因子量化模型、行业轮动模型、事件超额收益模型。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	姓名	王玉	王小飞

负责人	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		广东省广州市天河区珠江西路21 号52层；广东省广州市天河区珠 江东路30号42层；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		510627；510623；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	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指 标	2025 年		2024 年		2023 年	
	易方达量化 策略精选混 合 A	易方达量化 策略精选混 合 C	易方达量化 策略精选混 合 A	易方达量化 策略精选混 合 C	易方达量化 策略精选混 合 A	易方达量化策 略精选混合 C
本期已实现收益	12,835,271.53	6,578,806.54	5,946,007.21	2,493,816.18	-36,626,465.23	-17,707,730.17
本期利润	16,930,527.90	8,582,103.98	7,927,515.97	2,421,980.08	-21,662,546.32	-14,373,472.45
加权平均基金份额本期利润	0.4519	0.4232	0.1332	0.1042	-0.2781	-0.2891
本期加权平均净值利润率	29.92%	29.02%	10.99%	8.80%	-20.17%	-20.87%
本期基金份额净值增长率	33.43%	32.87%	9.90%	9.27%	-18.64%	-19.04%
3.1.2 期末 数据和指 标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	易方达量化策 略精选混合 A	易方达量化策 略精选混合 C	易方达量化策 略精选混合 A	易方达量化策 略精选混合 C	易方达量化策 略精选混合 A	易方达量化策略 精选混合 C
期末可供分配利润	23,832,274.14	10,563,814.27	9,149,792.06	4,204,937.71	7,892,268.51	2,164,695.86
期末可供分配基金份额利润	0.5863	0.5219	0.2499	0.2054	0.1165	0.0824
期末基金资产净值	72,848,791.97	34,857,215.10	49,153,798.08	26,540,453.93	82,790,058.07	31,141,960.48
期末基金份额净值	1.792	1.722	1.343	1.296	1.222	1.186
3.1.3 累计 期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	易方达量化 策略精选混 合 A	易方达量化 策略精选混 合 C	易方达量化 策略精选混 合 A	易方达量化 策略精选混 合 C	易方达量化 策略精选混 合 A	易方达量化策 略精选混合 C
基金份额累计	79.20%	72.20%	34.30%	29.60%	22.20%	18.60%

净值增长率						
-------	--	--	--	--	--	--

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

易方达量化策略精选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.40%	1.12%	-0.01%	0.57%	2.41%	0.55%
过去六个月	27.18%	1.06%	10.19%	0.54%	16.99%	0.52%
过去一年	33.43%	1.14%	10.98%	0.57%	22.45%	0.57%
过去三年	19.31%	1.23%	18.19%	0.64%	1.12%	0.59%
过去五年	-1.97%	1.35%	2.90%	0.68%	-4.87%	0.67%
自基金合同生效起至今	79.20%	1.35%	29.52%	0.73%	49.68%	0.62%

易方达量化策略精选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.26%	1.11%	-0.01%	0.57%	2.27%	0.54%
过去六个月	26.90%	1.05%	10.19%	0.54%	16.71%	0.51%
过去一年	32.87%	1.14%	10.98%	0.57%	21.89%	0.57%
过去三年	17.54%	1.23%	18.19%	0.64%	-0.65%	0.59%
过去五年	-4.33%	1.35%	2.90%	0.68%	-7.23%	0.67%
自基金合同生效起至今	72.20%	1.35%	29.52%	0.73%	42.68%	0.62%

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

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

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

(2017 年 12 月 19 日至 2025 年 12 月 31 日)

易方达量化策略精选混合 A



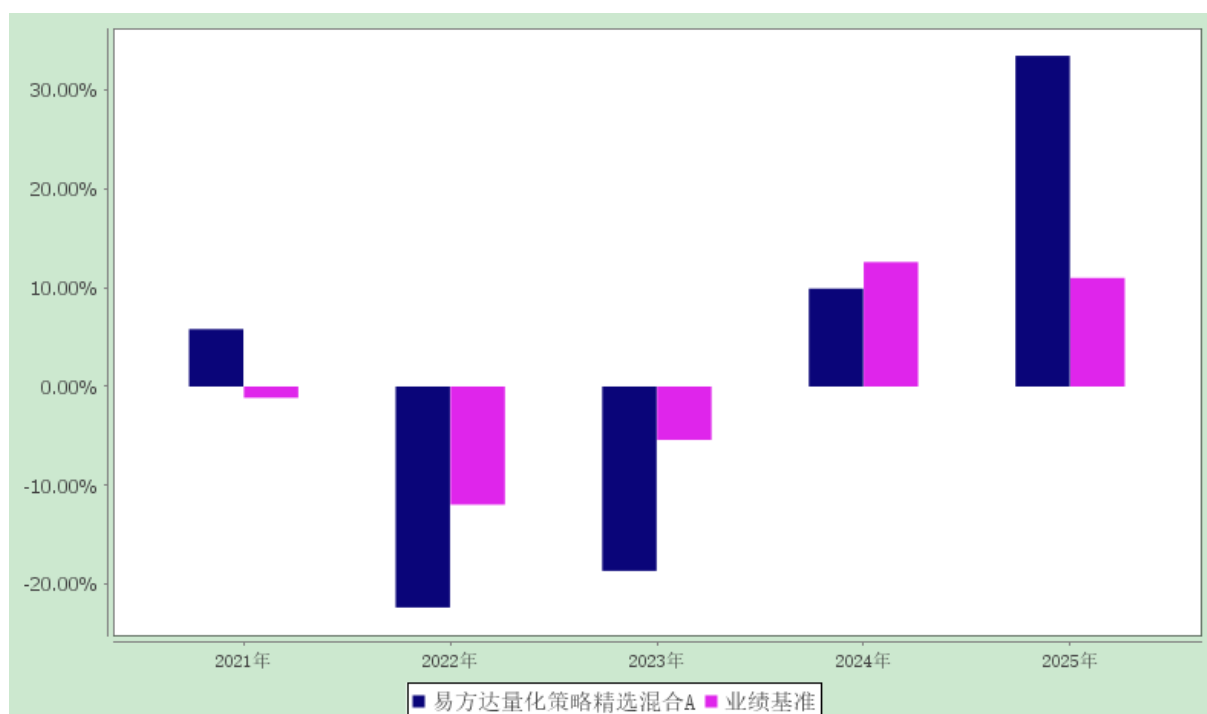
易方达量化策略精选混合 C



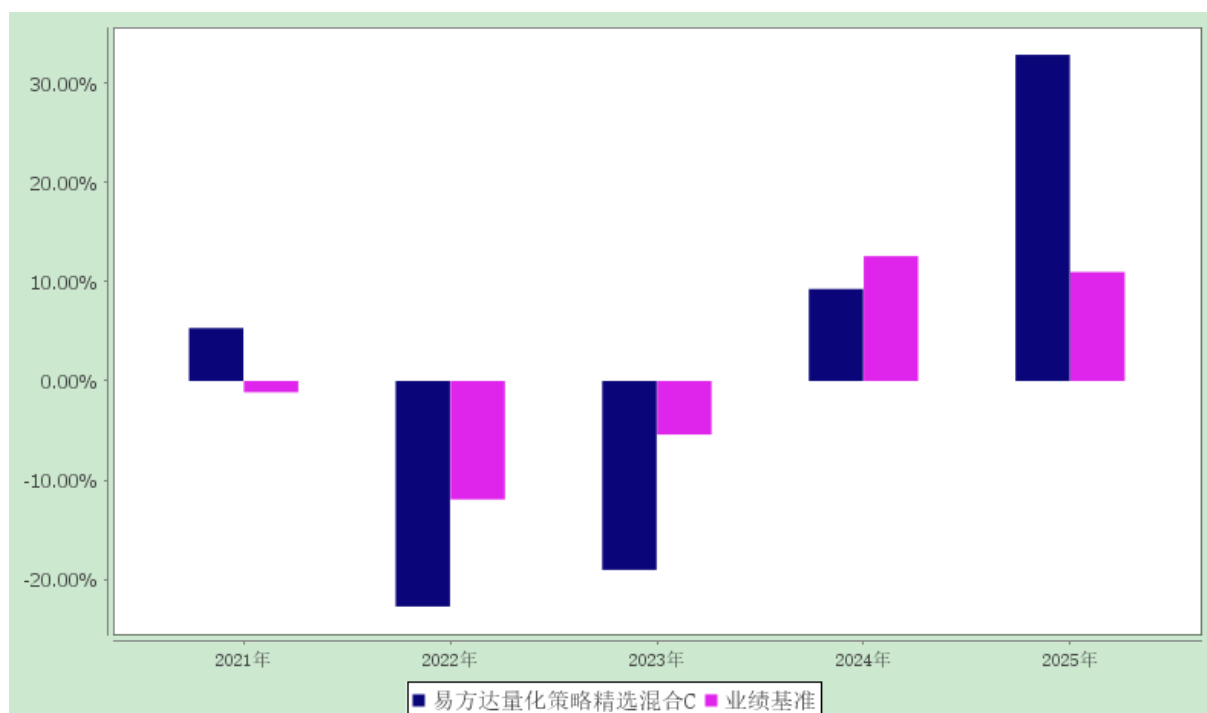
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达量化策略精选混合 A



易方达量化策略精选混合 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，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 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，易方达沪深 300 量化增强、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	2022-09-14	-	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。
黄浩东	本基金的基金经理，易方达中证 A500 增强策略 ETF、易方达中证 A500 量化增强的基金经理	2023-11-09	-	5 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量化研究员。

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.根据2026年3月5日《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2026年3月5日起，王建军不再担任本基金的基金经理，黄浩东仍担任本基金的基金经理。

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	1,371,907,808.62	2021-09-04

	私募资产管理计划	1	18,810,923,883.69	2019-07-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	6	20,182,831,692.31	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，具体按其对产品业绩和投资团队的贡献等情况综合评定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利

益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形，公司进一步加强了对投资指令下达、交易执行和反向交易控制等环节的控制措施，同时强化了对相关同向交易价差、反向交易价差及组合收益率差异的事后监测分析，按监管要求进行相关信息披露，进一步落实对兼任基金经理投资交易行为的规范和监督。本报告期内，相关制度措施执行情况良好，未发现同一基金经理管理公募基金、私募资产管理计划之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 94 次，其中 80 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，14 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。

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 2025 全年，国内宏观经济在复杂外部环境与内部结构调整下，呈现“稳中有进、边际改善、结构分化、动能转换”态势，经济复苏虽有波折，但政策协同发力、新旧动能转换贯穿全年，整体展现出较强韧性。生产端韧性凸显，结构持续优化，制造业 PMI 呈现“回升—微调—复苏”态势，最终重回扩张区间。需求端呈现结构分化特征，消费市场稳步复苏：一季度以旧换新政策带动升级类商品回暖，二季度服务消费成为亮点，而三、四季度增速承压，居民消费信心仍需激发。投资总量承压但结构优化，高技术产业投资增速较快。政策层面协同发力，有效对冲不确定性。证监会推进新“国九条”，激发资本市场活力；三季度以来政策引导行业“反内卷”，推动企业从“价格战”转向“价值战”，强化新质生产力培育支持。此外，全年 CPI 基本持平、PPI 降幅收窄，就业形势总体稳定，居民收

入与经济增长基本同步。

从市场表现来看，2025 年宽基指数整体表现较好，其中上证指数收益率为 18.41%，沪深 300 指数收益率为 17.66%，中证 2000 指数收益率为 36.42%；成长风格的创业板指数收益率为 49.57%。从风格维度来看，全年小盘明显跑赢大盘，成长风格明显跑赢价值风格。

报告期内，我们持续对模型进行了升级迭代，针对因子在不同的区域表现差异进行了深入研究，建立了更加有针对性的多因子模型；同时，纳入了机器学习相关的因子，进一步提升了模型的稳定性，使得模型更加精细化、均衡化；纳入了更多的投资策略，进一步实现了模型的多样化，并保持投资策略与偏股混合型基金整体风格的偏离在可控的范围内，力争为投资者创造稳健且持续的超额回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.792 元，本报告期份额净值增长率为 33.43%，同期业绩比较基准收益率为 10.98%；C 类基金份额净值为 1.722 元，本报告期份额净值增长率为 32.87%，同期业绩比较基准收益率为 10.98%。

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 2026 年，作为“十五五”开局之年，国内宏观经济将在政策协同发力与新质生产力加速赋能下，呈现“稳中向好、质效提升”的核心态势。宏观经济层面，政策“组合拳”将持续发力，成为内需激活与信心提振的核心支撑。财政政策更加积极有为，扩大支出规模、强化重点领域保障。行业走势方面，新质生产力相关赛道将迎来更多催化，延续 2025 年产业升级逻辑，形成“技术落地、规模化应用、政策加持”的三重利好格局。人形机器人产业进入产业化加速期，人工智能产业持续深化，高端装备制造、高技术制造业将持续领跑，新能源、半导体、数字经济等新质生产力相关领域，依托政策支持与技术突破，仍将保持高景气度，成为产业升级的核心引擎。在经济稳中向好、政策持续托底、外部流动性边际改善的多重利好叠加下，权益资产有望呈现“结构强势、稳步向好”的表现；流动性宽松环境将支撑估值修复，而产业催化与企业盈利改善或将成为行情核心驱动力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人紧扣公募基金行业高质量发展主线，根据法律法规、最新监管要求和业务发展需要，围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程，强化对法规和制度执行情况的监督检查，保障旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作情况如下：

（1）坚持投资者利益至上，大力培育良好的合规文化，严格落实从业人员廉洁从业、职业操守

和道德规范相关要求，积极探索合规文化宣贯新形式，组织面向全体员工及不同部门的合规专项培训、考试及承诺函签署等工作，引导员工将合规意识内化于心、外化于行，自觉践行“五要五不”的中国特色金融文化。

(2) 通过系统升级，进一步优化投资交易的日常监控机制，提升投前、投中和投后全链条的合规风控效能。投资合规部门与研究、投资、交易业务部门协同完善内部制度和流程，进一步明确业务执行规范。根据监管要求和业务发展情况，加强程序化交易执行监控，持续巩固公平交易和异常交易管控措施。

(3) 持续优化各类法律文件审核流程，强化全流程合规管控。坚持以投资者为本，积极推进浮动费率基金等创新产品开发论证，审慎评估各项新业务方案，保障公司各项业务稳妥有序开展，更好服务广大投资者财富管理需求。

(4) 严格遵守法律法规及监管规定，持续规范基金销售行为，强化对自媒体账号、社群运营等重点领域的合规管控。不断完善新型基金营销模式管控机制，支持创新业务与服务规范有序落地。积极探索运用数智化技术，开发宣传推介材料智能审核系统，提升合规审核效率。始终坚持以投资者利益为核心，健全投资者适当性管理长效机制，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的科学性与合理性。认真贯彻落实监管部门关于中小投资者保护工作要求，深入推进投诉溯源治理，妥善化解业务纠纷，切实维护投资者合法权益。

(5) 持续督促各部门落实法律法规、自律规则、基金法律文件中各项信息披露规定，优化完善相关制度流程；推进公司级信息披露平台和智能审核系统建设，深度探索人工智能技术在信息披露工作中的应用，以科技赋能有效应对持续增长的信息披露工作，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 深入贯彻落实新《反洗钱法》及配套法规制度要求，全面完善“基于风险”的洗钱风险管理体系，建立健全客户尽职调查和受益所有人识别机制，加强洗钱风险识别管控，推动科技赋能与数据治理，持续提升反洗钱工作有效性水平。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱、境内外子公司等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展年度内控评价、ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，全方位审视公司内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值程序和技术，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达量化策略精选混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达量化策略精选混合 C:本报告期内未实施利润分配。

4.9 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遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

安永华明（2026）审字第 70013033_G34 号

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表和净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在

审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
中国注册会计师
赵雅 林亚小
北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
2026 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	6,662,408.34	4,363,287.94
结算备付金		633,387.34	1,046,559.45
存出保证金		31,749.04	50,616.24
交易性金融资产	7.4.7.2	99,467,060.54	63,589,827.58
其中：股票投资		99,461,060.46	63,589,827.58
基金投资		-	-
债券投资		6,000.08	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	6,999,516.71
应收清算款		1,236,575.19	-
应收股利		-	-

应收申购款		94,820.32	48,667.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		108,126,000.77	76,098,475.27
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,006.69
应付赎回款		70,608.13	7,652.38
应付管理人报酬		107,603.46	78,722.72
应付托管费		17,933.90	13,120.46
应付销售服务费		14,926.82	11,759.73
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	208,921.39	291,961.28
负债合计		419,993.70	404,223.26
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	60,891,098.82	57,082,828.97
未分配利润	7.4.7.8	46,814,908.25	18,611,423.04
净资产合计		107,706,007.07	75,694,252.01
负债和净资产总计		108,126,000.77	76,098,475.27

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.792 元，C 类基金份额净值 1.722 元；基金份额总额 60,891,098.82 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 40,648,116.04 份，C 类基金份额总额 20,242,982.78 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		26,970,817.36	12,044,360.05
1.利息收入		70,741.30	79,994.03
其中：存款利息收入	7.4.7.9	27,374.06	42,438.38
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		43,367.24	37,555.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,771,681.76	10,043,345.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	19,512,316.81	8,078,506.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	26,585.34	15,543.23
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	1,232,779.61	1,949,295.11
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	6,098,553.81	1,909,672.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	29,840.49	11,348.18
减：二、营业总支出		1,458,185.48	1,694,864.00
1. 管理人报酬		1,033,635.05	1,200,246.24

2. 托管费		172,272.48	200,041.06
3. 销售服务费		148,130.01	137,553.20
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.05	0.03
8. 其他费用	7.4.7.18	104,147.89	157,023.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,512,631.88	10,349,496.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,512,631.88	10,349,496.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		25,512,631.88	10,349,496.05

7.3 净资产变动表

会计主体：易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	57,082,828.97	18,611,423.04	75,694,252.01
二、本期期初净资产	57,082,828.97	18,611,423.04	75,694,252.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,808,269.85	28,203,485.21	32,011,755.06
（一）、综合收益总额	-	25,512,631.88	25,512,631.88
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	3,808,269.85	2,690,853.33	6,499,123.18

资产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	24,077,917.35	13,684,794.32	37,762,711.67
2.基金赎回款	-20,269,647.50	-10,993,940.99	-31,263,588.49
(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	60,891,098.82	46,814,908.25	107,706,007.07
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	93,984,086.91	19,947,931.64	113,932,018.55
二、本期期初净资产	93,984,086.91	19,947,931.64	113,932,018.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,901,257.94	-1,336,508.60	-38,237,766.54
(一)、综合收益总额	-	10,349,496.05	10,349,496.05
(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)	-36,901,257.94	-11,686,004.65	-48,587,262.59
其中：1.基金申购款	28,671,169.33	9,394,532.24	38,065,701.57
2.基金赎回款	-65,572,427.27	-21,080,536.89	-86,652,964.16
(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	57,082,828.97	18,611,423.04	75,694,252.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2746 号《关于准予易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和证券基金机构监管部函[2017]1098 号《关于易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 422,049,630.98 份基金份额，其中认购资金利息折合 112,665.58 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违

约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新

评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准

金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰,由出让方缴纳。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。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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。

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	6,662,408.34	4,363,287.94
等于：本金	6,661,705.28	4,362,861.42
加：应计利息	703.06	426.52
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	6,662,408.34	4,363,287.94

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
----	-------------------------

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		94,064,079.67	-	99,461,060.46	5,396,980.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,999.99	0.09	6,000.08	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,999.99	0.09	6,000.08	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		94,070,079.66	0.09	99,467,060.54	5,396,980.79
项目		上年度末			
		2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		64,291,400.60	-	63,589,827.58	-701,573.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		64,291,400.60	-	63,589,827.58	-701,573.02

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2025 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末	
	2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,999,516.71	-
银行间市场	-	-
合计	6,999,516.71	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	65.76	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	106,355.63	136,961.28
其中：交易所市场	106,355.63	136,961.28
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	102,500.00	155,000.00
合计	208,921.39	291,961.28

7.4.7.7 实收基金

易方达量化策略精选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,610,627.44	36,610,627.44
本期申购	10,175,225.60	10,175,225.60
本期赎回（以“-”号填列）	-6,137,737.00	-6,137,737.00
本期末	40,648,116.04	40,648,116.04

易方达量化策略精选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,472,201.53	20,472,201.53
本期申购	13,902,691.75	13,902,691.75
本期赎回（以“-”号填列）	-14,131,910.50	-14,131,910.50
本期末	20,242,982.78	20,242,982.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

易方达量化策略精选混合 A

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	9,149,792.06	3,393,378.58	12,543,170.64
本期期初	9,149,792.06	3,393,378.58	12,543,170.64
本期利润	12,835,271.53	4,095,256.37	16,930,527.90
本期基金份额交易产生的变动数	1,847,210.55	879,766.84	2,726,977.39
其中：基金申购款	4,297,271.15	1,992,681.68	6,289,952.83

基金赎回款	-2,450,060.60	-1,112,914.84	-3,562,975.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,832,274.14	8,368,401.79	32,200,675.93

易方达量化策略精选混合 C

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	4,204,937.71	1,863,314.69	6,068,252.40
本期期初	4,204,937.71	1,863,314.69	6,068,252.40
本期利润	6,578,806.54	2,003,297.44	8,582,103.98
本期基金份额交易产生的变动数	-219,929.98	183,805.92	-36,124.06
其中：基金申购款	4,743,417.52	2,651,423.97	7,394,841.49
基金赎回款	-4,963,347.50	-2,467,618.05	-7,430,965.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,563,814.27	4,050,418.05	14,614,232.32

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	23,882.62	29,201.93
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	3,238.89	11,288.15
其他	252.55	1,948.30
合计	27,374.06	42,438.38

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	19,512,316.81	8,078,506.84
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	19,512,316.81	8,078,506.84

7.4.7.10.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,020,147,596.22	1,049,061,572.29
减：卖出股票成本总额	999,577,769.39	1,039,891,638.17
减：交易费用	1,057,510.02	1,091,427.28
买卖股票差价收入	19,512,316.81	8,078,506.84

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
债券投资收益——利息收入	7.36	13.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	26,577.98	15,529.56
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	26,585.34	15,543.23

7.4.7.11.2 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12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	83,088.57	104,252.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,499.75	88,698.67

减：应计利息总额	7.53	19.75
减：交易费用	3.31	4.18
买卖债券差价收入	26,577.98	15,529.56

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,232,779.61	1,949,295.11
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	1,232,779.61	1,949,295.11

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	6,098,553.81	1,909,672.66
——股票投资	6,098,553.81	1,909,672.66
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-

合计	6,098,553.81	1,909,672.66
----	--------------	--------------

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	29,840.49	11,348.18
合计	29,840.49	11,348.18

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	22,500.00	35,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	1,641.15	2,022.92
存托服务费	6.74	0.55
合计	104,147.89	157,023.47

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、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
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东

广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达私募基金管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	1,033,635.05	1,200,246.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	209,286.75	178,728.47
应支付基金管理人的净管理费	824,348.30	1,021,517.77

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

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 5 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，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	172,272.48	200,041.06

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.2\%\div \text{当年天数}$$

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 5 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，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

7.4.10.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025年1月1日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达量化策略精选混合	易方达量化策略精选混合	合计

	A	C	
易方达基金管理有限公司	-	16,498.70	16,498.70
中国建设银行	-	14,254.13	14,254.13
广发证券	-	240.96	240.96
易方达财富	-	0.01	0.01
合计	-	30,993.80	30,993.80
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达量化策略精选混合 A	易方达量化策略精选混合 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	21,629.02	21,629.02
中国建设银行	-	10,793.13	10,793.13
广发证券	-	174.57	174.57
合计	-	32,596.72	32,596.72

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期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。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年12月31日		2024年1月1日至2024年12月31日	
	易方达量化策略精选混合A	易方达量化策略精选混合C	易方达量化策略精选混合A	易方达量化策略精选混合C
报告期初持有的基金份额	22,205,773.50	-	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	22,205,773.50	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	22,205,773.50	-	22,205,773.50	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	54.6293%	-	60.6539%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达量化策略精选混合 A

无。

易方达量化策略精选混合 C

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年12月31日		2024年1月1日至2024年12月31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	6,662,408.34	23,882.62	4,363,287.94	29,201.93

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

易方达量化策略精选混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达量化策略精选混合 C

本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118063	金 05 转债	2025-12-26	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.00	60	6,000.00	6,000.08	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项停牌	78.81	2026-01-15	86.69	3,500	278,895.92	275,835.00	-
605255	天普股份	2025-12-31	重大事项停牌	218.02	2026-01-12	196.22	400	71,210.00	87,208.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项停牌	283.75	2026-01-05	278.00	861	202,086.66	244,308.75	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购

证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部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。

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、地方政府债、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%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2025年12月31日	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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31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

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31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

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	6,000.08	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	6,000.08	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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31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

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31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

7.4.13.3 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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VaR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	6,662,408.34	-	-	-	6,662,408.34
结算备付金	633,387.34	-	-	-	633,387.34
存出保证金	31,749.04	-	-	-	31,749.04
交易性金融资产	-	-	6,000.08	99,461,060.46	99,467,060.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,236,575.19	1,236,575.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	94,820.32	94,820.32
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,327,544.72	-	6,000.08	100,792,455.97	108,126,000.77
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	-	-	-	70,608.13	70,608.13
应付管理人报酬	-	-	-	107,603.46	107,603.46
应付托管费	-	-	-	17,933.90	17,933.90
应付销售服务费	-	-	-	14,926.82	14,926.82
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	208,921.39	208,921.39
负债总计	-	-	-	419,993.70	419,993.70
利率敏感度缺口	7,327,544.72	-	6,000.08	100,372,462.27	107,706,007.07
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	4,363,287.94	-	-	-	4,363,287.94
结算备付金	1,046,559.45	-	-	-	1,046,559.45
存出保证金	50,616.24	-	-	-	50,616.24
交易性金融资产	-	-	-	63,589,827.58	63,589,827.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,999,516.71	-	-	-	6,999,516.71
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	48,667.35	48,667.35
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,459,980.34	-	-	63,638,494.93	76,098,475.27
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	-	-	-	1,006.69	1,006.69
应付赎回款	-	-	-	7,652.38	7,652.38
应付管理人报酬	-	-	-	78,722.72	78,722.72
应付托管费	-	-	-	13,120.46	13,120.46
应付销售服务费	-	-	-	11,759.73	11,759.73
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	291,961.28	291,961.28
负债总计	-	-	-	404,223.26	404,223.26
利率敏感度缺口	12,459,980.34	-	-	63,234,271.67	75,694,252.01

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2025 年 12 月 31 日		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	99,461,060.46	92.34	63,589,827.58	84.01
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	99,461,060.46	92.34	63,589,827.58	84.01

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	9,613,670.17	6,016,480.94
	2.业绩比较基准下降 5%	-9,613,670.17	-6,016,480.94

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	98,853,708.71	63,589,827.58
第二层次	613,351.83	-
第三层次	-	-
合计	99,467,060.54	63,589,827.58

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产	-	-	-

计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	166,033.34	166,033.34
当期购买	-	27,609.58	27,609.58
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	188,777.59	188,777.59
当期利得或损失总额	-	-4,865.33	-4,865.33
其中：计入损益的利得或损失	-	-4,865.33	-4,865.33
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
----	----	----	--------------

1	权益投资	99,461,060.46	91.99
	其中：股票	99,461,060.46	91.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,000.08	0.01
	其中：债券	6,000.08	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	7,295,795.68	6.75
8	其他各项资产	1,363,144.55	1.26
9	合计	108,126,000.77	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	219,353.00	0.20
B	采矿业	4,982,018.00	4.63
C	制造业	71,125,263.95	66.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,653,128.00	1.53
E	建筑业	779,355.00	0.72
F	批发和零售业	1,146,893.00	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	2,852,253.00	2.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,549,696.53	5.15
J	金融业	6,828,961.00	6.34
K	房地产业	586,169.00	0.54
L	租赁和商务服务业	1,270,335.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	1,389,196.98	1.29

N	水利、环境和公共设施管理业	423,638.00	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	46,125.00	0.04
Q	卫生和社会工作	125,370.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	439,865.00	0.41
S	综合	43,440.00	0.04
	合计	99,461,060.46	92.34

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	3,700	2,257,000.00	2.10
2	300750	宁德时代	5,600	2,056,656.00	1.91
3	300502	新易盛	4,300	1,852,784.00	1.72
4	688256	寒武纪	1,063	1,440,949.65	1.34
5	601899	紫金矿业	35,900	1,237,473.00	1.15
6	002475	立讯精密	21,500	1,219,265.00	1.13
7	601138	工业富联	18,000	1,116,900.00	1.04
8	002463	沪电股份	14,500	1,059,515.00	0.98
9	000333	美的集团	13,400	1,047,210.00	0.97
10	603986	兆易创新	4,100	878,425.00	0.82
11	300274	阳光电源	4,600	786,784.00	0.73
12	300476	胜宏科技	2,700	776,466.00	0.72
13	600183	生益科技	10,100	721,241.00	0.67
14	002384	东山精密	7,800	660,270.00	0.61
15	601318	中国平安	9,600	656,640.00	0.61
16	603993	洛阳钼业	31,800	636,000.00	0.59
17	688981	中芯国际	4,954	608,499.82	0.56
18	603259	药明康德	6,500	589,160.00	0.55
19	002916	深南电路	2,400	557,496.00	0.52
20	600519	贵州茅台	400	550,872.00	0.51
21	002371	北方华创	1,180	541,714.40	0.50
22	601100	恒立液压	4,900	538,559.00	0.50
23	002050	三花智控	9,200	508,852.00	0.47
24	603799	华友钴业	7,400	505,124.00	0.47
25	688041	海光信息	2,213	496,619.33	0.46
26	600809	山西汾酒	2,700	463,590.00	0.43
27	002558	巨人网络	10,700	463,203.00	0.43

28	600690	海尔智家	17,400	453,966.00	0.42
29	002028	思源电气	2,900	448,311.00	0.42
30	002142	宁波银行	15,500	435,395.00	0.40
31	600276	恒瑞医药	7,300	434,861.00	0.40
32	600031	三一重工	20,400	431,052.00	0.40
33	002027	分众传媒	58,100	428,197.00	0.40
34	605499	东鹏饮料	1,600	427,824.00	0.40
35	600919	江苏银行	40,600	422,240.00	0.39
36	601398	工商银行	51,700	409,981.00	0.38
37	688111	金山办公	1,259	386,601.13	0.36
38	688072	拓荆科技	1,162	383,460.00	0.36
39	601288	农业银行	49,900	383,232.00	0.36
40	688183	生益电子	3,953	378,262.57	0.35
41	001317	三羊马	6,800	374,748.00	0.35
42	688002	睿创微纳	3,684	371,347.20	0.34
43	600030	中信证券	12,900	370,359.00	0.34
44	300394	天孚通信	1,800	365,454.00	0.34
45	600066	宇通客车	10,700	349,890.00	0.32
46	002415	海康威视	11,600	346,144.00	0.32
47	603766	隆鑫通用	21,100	339,921.00	0.32
48	600415	小商品城	21,300	339,735.00	0.32
49	002202	金风科技	16,500	336,600.00	0.31
50	601600	中国铝业	27,400	334,828.00	0.31
51	688235	百济神州	1,233	331,183.80	0.31
52	601336	新华保险	4,700	327,590.00	0.30
53	603699	纽威股份	6,100	317,017.00	0.29
54	000408	藏格矿业	3,700	312,280.00	0.29
55	000338	潍柴动力	18,100	311,320.00	0.29
56	300454	深信服	2,700	310,932.00	0.29
57	600989	宝丰能源	15,600	306,228.00	0.28
58	601857	中国石油	29,400	306,054.00	0.28
59	600036	招商银行	7,200	303,120.00	0.28
60	000933	神火股份	11,000	302,170.00	0.28
61	002837	英维克	2,800	299,292.00	0.28
62	002294	信立泰	6,000	297,300.00	0.28
63	688498	源杰科技	461	295,957.39	0.27
64	000792	盐湖股份	10,500	295,680.00	0.27
65	601988	中国银行	50,900	291,657.00	0.27
66	601628	中国人寿	6,400	291,200.00	0.27
67	600176	中国巨石	17,000	290,700.00	0.27
68	300442	润泽科技	5,500	290,400.00	0.27
69	300033	同花顺	900	289,962.00	0.27
70	601328	交通银行	39,800	288,550.00	0.27
71	600233	圆通速递	17,300	284,066.00	0.26

72	601225	陕西煤业	13,300	283,556.00	0.26
73	601168	西部矿业	10,200	281,928.00	0.26
74	002049	紫光国微	3,500	275,835.00	0.26
75	000729	燕京啤酒	24,100	270,643.00	0.25
76	002532	天山铝业	16,700	270,206.00	0.25
77	002273	水晶光电	10,700	268,784.00	0.25
78	688778	厦钨新能	3,460	267,700.20	0.25
79	688331	荣昌生物	3,409	265,186.11	0.25
80	603606	东方电缆	4,400	262,900.00	0.24
81	601919	中远海控	17,100	259,578.00	0.24
82	601872	招商轮船	28,900	259,522.00	0.24
83	601211	国泰海通	12,600	258,930.00	0.24
84	002048	宁波华翔	8,100	254,826.00	0.24
85	600019	宝钢股份	34,200	254,790.00	0.24
86	601881	中国银河	16,200	254,664.00	0.24
87	600115	中国东航	42,300	253,800.00	0.24
88	300373	扬杰科技	3,700	251,600.00	0.23
89	600039	四川路桥	25,000	248,750.00	0.23
90	300054	鼎龙股份	6,600	248,160.00	0.23
91	002600	领益智造	15,900	247,086.00	0.23
92	601898	中煤能源	19,700	245,068.00	0.23
93	301308	江波龙	1,000	244,840.00	0.23
94	688012	中微公司	861	244,308.75	0.23
95	601601	中国太保	5,800	243,078.00	0.23
96	002156	通富微电	6,400	241,280.00	0.22
97	601825	沪农商行	25,900	240,611.00	0.22
98	600282	南钢股份	45,400	238,804.00	0.22
99	688322	奥比中光	2,649	237,535.83	0.22
100	300850	新强联	5,700	235,809.00	0.22
101	600011	华能国际	31,600	235,736.00	0.22
102	300759	康龙化成	8,200	233,126.00	0.22
103	000708	中信特钢	14,200	232,454.00	0.22
104	000733	振华科技	4,400	230,604.00	0.21
105	601088	中国神华	5,600	226,800.00	0.21
106	688772	珠海冠宇	10,499	226,043.47	0.21
107	600933	爱柯迪	11,200	225,120.00	0.21
108	000895	双汇发展	8,500	224,995.00	0.21
109	600219	南山铝业	41,800	224,884.00	0.21
110	688428	诺诚健华	10,892	223,503.84	0.21
111	600426	华鲁恒升	7,100	223,153.00	0.21
112	600875	东方电气	9,100	220,948.00	0.21
113	600096	云天化	6,600	220,506.00	0.20
114	000651	格力电器	5,400	217,188.00	0.20
115	688303	大全能源	8,097	217,161.54	0.20

116	601808	中海油服	15,300	214,812.00	0.20
117	600362	江西铜业	3,900	214,188.00	0.20
118	601991	大唐发电	61,200	213,588.00	0.20
119	300049	福瑞医科	3,000	211,230.00	0.20
120	601717	中创智领	8,600	211,130.00	0.20
121	600372	中航机载	15,600	209,352.00	0.19
122	002074	国轩高科	5,300	207,283.00	0.19
123	002236	大华股份	10,900	206,446.00	0.19
124	002966	苏州银行	24,900	206,421.00	0.19
125	002497	雅化集团	8,300	205,425.00	0.19
126	002414	高德红外	14,000	205,380.00	0.19
127	300014	亿纬锂能	3,100	203,856.00	0.19
128	600577	精达股份	16,300	202,609.00	0.19
129	600741	华域汽车	10,100	202,000.00	0.19
130	603486	科沃斯	2,500	201,700.00	0.19
131	600309	万华化学	2,600	199,368.00	0.19
132	002020	京新药业	10,500	199,290.00	0.19
133	300003	乐普医疗	12,600	199,206.00	0.18
134	002436	兴森科技	9,400	198,998.00	0.18
135	002841	视源股份	5,000	198,150.00	0.18
136	600221	海航控股	109,200	197,652.00	0.18
137	601058	赛轮轮胎	12,200	197,396.00	0.18
138	601061	中信金属	13,700	197,280.00	0.18
139	601918	新集能源	29,800	196,978.00	0.18
140	600795	国电电力	38,900	196,056.00	0.18
141	300999	金龙鱼	6,800	195,432.00	0.18
142	301606	绿联科技	3,300	193,842.00	0.18
143	000887	中鼎股份	8,200	190,322.00	0.18
144	600378	昊华科技	5,900	188,564.00	0.18
145	600166	福田汽车	63,800	186,296.00	0.17
146	000600	建投能源	21,700	185,101.00	0.17
147	300073	当升科技	3,200	184,960.00	0.17
148	600236	桂冠电力	23,600	184,788.00	0.17
149	300357	我武生物	6,400	181,440.00	0.17
150	600988	赤峰黄金	5,800	181,192.00	0.17
151	600901	江苏金租	29,300	179,316.00	0.17
152	603179	新泉股份	2,400	177,312.00	0.16
153	000783	长江证券	21,700	176,855.00	0.16
154	603915	国茂股份	9,600	176,736.00	0.16
155	601598	中国外运	29,000	175,740.00	0.16
156	002738	中矿资源	2,200	172,810.00	0.16
157	002668	TCL 智家	16,600	172,308.00	0.16
158	300415	伊之密	6,600	171,996.00	0.16
159	600210	紫江企业	23,300	171,255.00	0.16

160	300257	开山股份	12,100	170,005.00	0.16
161	000778	新兴铸管	40,200	168,036.00	0.16
162	603049	中策橡胶	3,000	167,850.00	0.16
163	300146	汤臣倍健	13,900	166,939.00	0.15
164	002603	以岭药业	9,700	165,579.00	0.15
165	600478	科力远	23,500	161,915.00	0.15
166	301358	湖南裕能	2,500	161,650.00	0.15
167	002493	荣盛石化	13,800	161,598.00	0.15
168	300972	万辰集团	800	160,856.00	0.15
169	002595	豪迈科技	1,900	160,569.00	0.15
170	002402	和而泰	4,100	160,392.00	0.15
171	600329	达仁堂	3,500	159,670.00	0.15
172	002345	潮宏基	12,700	158,750.00	0.15
173	301382	蜂助手	4,400	155,936.00	0.14
174	002487	大金重工	3,000	155,790.00	0.14
175	000301	东方盛虹	14,300	155,727.00	0.14
176	601233	桐昆股份	9,000	154,890.00	0.14
177	601963	重庆银行	14,300	154,869.00	0.14
178	002648	卫星化学	8,700	153,816.00	0.14
179	300486	东杰智能	7,800	152,958.00	0.14
180	300857	协创数据	900	151,812.00	0.14
181	300953	震裕科技	900	151,218.00	0.14
182	002422	科伦药业	5,100	149,685.00	0.14
183	601827	三峰环境	17,600	149,072.00	0.14
184	603979	金诚信	1,900	144,685.00	0.13
185	688708	佳驰科技	2,323	144,606.75	0.13
186	605196	华通线缆	4,100	142,434.00	0.13
187	002138	顺络电子	4,000	142,120.00	0.13
188	688220	翱捷科技	1,697	140,189.17	0.13
189	002891	中宠股份	2,700	139,752.00	0.13
190	002444	巨星科技	4,100	139,482.00	0.13
191	001309	德明利	600	139,134.00	0.13
192	600986	浙文互联	16,900	132,158.00	0.12
193	603737	三棵树	2,800	129,556.00	0.12
194	600499	科达制造	9,300	128,991.00	0.12
195	603444	吉比特	300	127,155.00	0.12
196	300679	电连技术	2,600	126,568.00	0.12
197	300627	华测导航	3,600	125,676.00	0.12
198	301345	涛涛车业	500	125,660.00	0.12
199	600885	宏发股份	4,100	124,640.00	0.12
200	688200	华峰测控	651	123,820.20	0.11
201	600118	中国卫星	1,300	123,435.00	0.11
202	301061	匠心家居	1,300	123,240.00	0.11
203	600848	上海临港	10,500	122,850.00	0.11

204	002379	宏创控股	5,100	121,992.00	0.11
205	688167	炬光科技	691	120,973.37	0.11
206	603083	剑桥科技	900	120,942.00	0.11
207	002946	新乳业	6,500	120,445.00	0.11
208	300395	菲利华	1,200	120,360.00	0.11
209	002281	光迅科技	1,700	118,915.00	0.11
210	603950	长源东谷	4,100	118,695.00	0.11
211	002222	福晶科技	2,100	118,314.00	0.11
212	002244	滨江集团	11,700	117,585.00	0.11
213	300888	稳健医疗	3,100	117,304.00	0.11
214	603236	移远通信	1,200	114,492.00	0.11
215	688578	艾力斯	1,099	114,460.85	0.11
216	002984	森麒麟	5,400	114,318.00	0.11
217	601126	四方股份	3,800	114,304.00	0.11
218	688692	达梦数据	436	113,913.72	0.11
219	003006	百亚股份	5,200	113,568.00	0.11
220	600801	华新建材	4,600	112,884.00	0.10
221	603556	海兴电力	3,100	112,840.00	0.10
222	688372	伟测科技	1,030	112,362.70	0.10
223	002064	华峰化学	10,200	112,200.00	0.10
224	301031	中熔电气	1,000	112,190.00	0.10
225	002409	雅克科技	1,500	111,150.00	0.10
226	002335	科华数据	2,000	111,060.00	0.10
227	601231	环旭电子	3,700	111,000.00	0.10
228	600549	厦门钨业	2,700	110,862.00	0.10
229	002311	海大集团	2,000	110,760.00	0.10
230	300628	亿联网络	3,100	110,515.00	0.10
231	300666	江丰电子	1,200	110,400.00	0.10
232	600346	恒力石化	4,900	110,397.00	0.10
233	002484	江海股份	3,700	109,890.00	0.10
234	603379	三美股份	1,800	109,296.00	0.10
235	600938	中国海油	3,600	108,648.00	0.10
236	601665	齐鲁银行	18,800	107,912.00	0.10
237	002773	康弘药业	3,600	107,892.00	0.10
238	300413	芒果超媒	4,400	107,448.00	0.10
239	300558	贝达药业	2,300	107,387.00	0.10
240	688210	统联精密	1,941	107,376.12	0.10
241	000683	博源化工	14,400	107,136.00	0.10
242	002545	东方铁塔	5,800	107,010.00	0.10
243	600114	东睦股份	3,500	106,925.00	0.10
244	002459	晶澳科技	9,300	106,485.00	0.10
245	600323	瀚蓝环境	3,700	105,820.00	0.10
246	002043	兔宝宝	7,300	105,193.00	0.10
247	002683	广东宏大	2,200	105,160.00	0.10

248	300790	宇瞳光学	3,500	104,685.00	0.10
249	601117	中国化学	13,700	103,161.00	0.10
250	688702	盛科通信	728	103,150.32	0.10
251	002895	川恒股份	2,800	102,648.00	0.10
252	002831	裕同科技	3,600	102,636.00	0.10
253	002779	中坚科技	900	102,204.00	0.09
254	300432	富临精工	6,108	102,003.60	0.09
255	688123	聚辰股份	811	101,845.38	0.09
256	688114	华大智造	1,676	101,833.76	0.09
257	000543	皖能电力	12,800	101,760.00	0.09
258	002965	祥鑫科技	2,500	101,700.00	0.09
259	300761	立华股份	4,900	101,675.00	0.09
260	603225	新凤鸣	5,200	101,192.00	0.09
261	603040	新坐标	1,100	101,189.00	0.09
262	002690	美亚光电	4,900	100,793.00	0.09
263	002001	新和成	4,000	100,760.00	0.09
264	603939	益丰药房	4,600	99,912.00	0.09
265	605599	菜百股份	6,100	99,857.00	0.09
266	603712	七一二	4,800	99,696.00	0.09
267	301489	思泉新材	500	99,500.00	0.09
268	688116	天奈科技	2,109	99,439.35	0.09
269	301263	泰恩康	3,400	98,566.00	0.09
270	000932	华菱钢铁	17,500	98,350.00	0.09
271	300926	博俊科技	3,000	98,340.00	0.09
272	603298	杭叉集团	3,700	98,309.00	0.09
273	300363	博腾股份	4,200	97,608.00	0.09
274	002518	科士达	2,000	97,040.00	0.09
275	000657	中钨高新	3,500	96,985.00	0.09
276	600315	上海家化	4,300	96,836.00	0.09
277	603730	岱美股份	11,000	96,360.00	0.09
278	600064	南京高科	11,100	96,348.00	0.09
279	603806	福斯特	6,900	96,324.00	0.09
280	600388	龙净环保	5,900	96,229.00	0.09
281	300012	华测检测	7,100	96,205.00	0.09
282	000672	上峰水泥	7,400	96,126.00	0.09
283	603876	鼎胜新材	6,400	96,064.00	0.09
284	600352	浙江龙盛	9,000	95,940.00	0.09
285	300418	昆仑万维	2,300	95,910.00	0.09
286	688180	君实生物	2,807	95,887.12	0.09
287	300832	新产业	1,700	95,625.00	0.09
288	300724	捷佳伟创	1,000	95,600.00	0.09
289	601865	福莱特	6,100	95,587.00	0.09
290	000429	粤高速 A	8,100	95,418.00	0.09
291	000858	五粮液	900	95,346.00	0.09

292	688475	萤石网络	3,166	95,328.26	0.09
293	688208	道通科技	2,586	95,164.80	0.09
294	301200	大族数控	800	95,016.00	0.09
295	002768	国恩股份	1,800	94,824.00	0.09
296	603160	汇顶科技	1,200	94,800.00	0.09
297	002008	大族激光	2,300	94,737.00	0.09
298	688577	浙海德曼	978	94,729.08	0.09
299	600416	湘电股份	6,000	94,680.00	0.09
300	002967	广电计量	4,300	94,643.00	0.09
301	600350	山东高速	9,700	94,575.00	0.09
302	688131	皓元医药	1,312	94,568.96	0.09
303	688182	灿勤科技	3,203	94,552.56	0.09
304	300496	中科创达	1,400	94,500.00	0.09
305	600563	法拉电子	900	94,455.00	0.09
306	688025	杰普特	667	94,427.19	0.09
307	002461	珠江啤酒	10,100	93,829.00	0.09
308	603360	百傲化学	2,900	93,438.00	0.09
309	688336	三生国健	1,568	93,405.76	0.09
310	000598	兴蓉环境	13,000	93,210.00	0.09
311	688531	日联科技	1,408	92,970.24	0.09
312	002085	万丰奥威	5,800	92,858.00	0.09
313	600601	方正科技	7,900	92,588.00	0.09
314	300458	全志科技	2,200	92,466.00	0.09
315	300017	网宿科技	9,000	92,250.00	0.09
316	601156	东航物流	5,000	92,050.00	0.09
317	600057	厦门象屿	10,800	92,016.00	0.09
318	601958	金钼股份	5,900	91,922.00	0.09
319	600968	海油发展	23,900	91,776.00	0.09
320	688469	芯联集成	13,713	91,739.97	0.09
321	002739	万达电影	8,100	91,692.00	0.09
322	600458	时代新材	6,900	91,563.00	0.09
323	300573	兴齐眼药	1,300	91,377.00	0.08
324	688728	格科微	6,085	90,909.90	0.08
325	603358	华达科技	1,800	90,900.00	0.08
326	600507	方大特钢	15,400	90,706.00	0.08
327	688361	中科飞测	592	90,570.08	0.08
328	002948	青岛银行	20,200	90,496.00	0.08
329	300438	鹏辉能源	1,700	90,474.00	0.08
330	600866	星湖科技	13,000	90,350.00	0.08
331	600380	健康元	7,800	90,090.00	0.08
332	002056	横店东磁	4,600	89,700.00	0.08
333	600908	无锡银行	15,100	89,543.00	0.08
334	300602	飞荣达	2,700	89,532.00	0.08
335	002340	格林美	10,700	89,452.00	0.08

336	300009	安科生物	9,300	89,001.00	0.08
337	000682	东方电子	7,500	88,950.00	0.08
338	000050	深天马 A	9,800	88,494.00	0.08
339	300251	光线传媒	5,400	88,452.00	0.08
340	603185	弘元绿能	2,900	88,450.00	0.08
341	002987	京北方	4,100	88,273.00	0.08
342	300620	光库科技	600	88,230.00	0.08
343	603233	大参林	5,000	88,100.00	0.08
344	002096	易普力	6,600	87,912.00	0.08
345	688295	中复神鹰	2,665	87,438.65	0.08
346	605255	天普股份	400	87,208.00	0.08
347	603596	伯特利	1,700	87,159.00	0.08
348	601107	四川成渝	14,300	86,944.00	0.08
349	600038	中直股份	2,400	86,712.00	0.08
350	600490	鹏欣资源	11,200	86,576.00	0.08
351	002246	北化股份	4,800	86,496.00	0.08
352	002276	万马股份	5,100	86,241.00	0.08
353	601801	皖新传媒	13,100	86,198.00	0.08
354	300323	华灿光电	10,800	86,184.00	0.08
355	603529	爱玛科技	2,900	86,130.00	0.08
356	600863	内蒙华电	19,200	86,016.00	0.08
357	301039	中集车辆	9,400	86,010.00	0.08
358	002237	恒邦股份	6,400	85,888.00	0.08
359	600776	东方通信	5,200	85,800.00	0.08
360	000425	徐工机械	7,400	85,692.00	0.08
361	000034	神州数码	2,200	85,602.00	0.08
362	002511	中顺洁柔	10,000	85,600.00	0.08
363	601019	山东出版	9,900	85,536.00	0.08
364	600497	驰宏锌锗	11,700	85,527.00	0.08
365	600869	远东股份	10,600	85,330.00	0.08
366	600927	永安期货	5,300	85,171.00	0.08
367	300775	三角防务	2,800	85,120.00	0.08
368	002195	岩山科技	12,000	85,080.00	0.08
369	688319	欧林生物	3,350	84,956.00	0.08
370	600332	白云山	3,300	84,942.00	0.08
371	002091	江苏国泰	9,400	84,882.00	0.08
372	301029	怡合达	3,200	84,864.00	0.08
373	002373	千方科技	7,200	84,744.00	0.08
374	600517	国网英大	14,100	84,741.00	0.08
375	600100	同方股份	9,500	84,740.00	0.08
376	688536	思瑞浦	530	84,736.40	0.08
377	601108	财通证券	9,700	84,584.00	0.08
378	601609	金田股份	7,800	84,240.00	0.08
379	600063	皖维高新	14,300	84,227.00	0.08

380	600489	中金黄金	3,600	84,096.00	0.08
381	688425	铁建重工	16,585	84,085.95	0.08
382	000800	一汽解放	12,400	84,072.00	0.08
383	300296	利亚德	13,300	84,056.00	0.08
384	300382	斯莱克	5,400	84,024.00	0.08
385	300587	天铁科技	13,700	83,981.00	0.08
386	688411	海博思创	335	83,763.40	0.08
387	300768	迪普科技	4,500	83,385.00	0.08
388	002062	宏润建设	9,000	83,250.00	0.08
389	002010	传化智联	14,300	83,083.00	0.08
390	603279	景津装备	4,900	82,663.00	0.08
391	688206	概伦电子	2,373	82,651.59	0.08
392	000069	华侨城 A	33,300	82,584.00	0.08
393	600867	通化东宝	10,100	82,517.00	0.08
394	600572	康恩贝	18,500	82,510.00	0.08
395	601608	中信重工	12,500	82,375.00	0.08
396	000917	电广传媒	8,000	82,240.00	0.08
397	603505	金石资源	4,400	82,192.00	0.08
398	688553	汇宇制药	4,617	82,136.43	0.08
399	600113	浙江东日	1,300	82,121.00	0.08
400	605099	共创草坪	2,300	82,087.00	0.08
401	600339	中油工程	24,500	82,075.00	0.08
402	300735	光弘科技	3,300	82,038.00	0.08
403	002847	盐津铺子	1,200	81,972.00	0.08
404	002815	崇达技术	6,000	81,960.00	0.08
405	600871	石化油服	37,900	81,864.00	0.08
406	601975	招商南油	27,100	81,842.00	0.08
407	000629	钒钛股份	26,400	81,840.00	0.08
408	300185	通裕重工	28,800	81,792.00	0.08
409	000828	东莞控股	7,600	81,776.00	0.08
410	600037	歌华有线	11,200	81,760.00	0.08
410	601880	辽港股份	51,100	81,760.00	0.08
412	300428	立中集团	3,500	81,725.00	0.08
413	688352	硕中科技	6,480	81,712.80	0.08
414	300353	东土科技	4,000	81,440.00	0.08
415	001308	康冠科技	3,900	81,354.00	0.08
416	002399	海普瑞	6,900	81,351.00	0.08
417	601326	秦港股份	23,300	81,317.00	0.08
418	688538	和辉光电	30,558	81,284.28	0.08
419	600022	山东钢铁	53,800	81,238.00	0.08
420	600740	山西焦化	21,600	81,216.00	0.08
421	001221	悍高集团	1,400	81,074.00	0.08
422	600884	杉杉股份	6,000	81,060.00	0.08
423	600873	梅花生物	8,000	81,040.00	0.08

424	301267	华夏眼科	4,500	80,910.00	0.08
425	002392	北京利尔	10,800	80,784.00	0.08
426	300319	麦捷科技	6,900	80,661.00	0.07
427	000049	德赛电池	3,000	80,640.00	0.07
428	688549	中巨芯	8,797	80,228.64	0.07
429	002636	金安国纪	4,800	80,208.00	0.07
430	600498	烽火通信	2,500	80,200.00	0.07
431	301275	汉朔科技	1,500	80,130.00	0.07
432	000553	安道麦 A	14,600	80,008.00	0.07
433	000031	大悦城	28,300	79,806.00	0.07
434	300841	康华生物	1,100	79,486.00	0.07
435	002838	道恩股份	3,300	79,464.00	0.07
436	001286	陕西能源	8,500	79,135.00	0.07
437	302132	中航成飞	1,000	79,000.00	0.07
438	002850	科达利	500	78,930.00	0.07
439	603301	振德医疗	1,100	77,550.00	0.07
440	600547	山东黄金	2,000	77,420.00	0.07
441	002975	博杰股份	1,000	77,000.00	0.07
442	603929	亚翔集成	800	76,400.00	0.07
443	002714	牧原股份	1,500	75,870.00	0.07
444	000791	甘肃能源	11,700	75,465.00	0.07
444	603855	华荣股份	3,900	75,465.00	0.07
446	300681	英搏尔	3,000	75,180.00	0.07
447	688185	康希诺	1,188	74,665.80	0.07
448	688590	新致软件	3,995	74,546.70	0.07
449	000612	焦作万方	6,700	73,834.00	0.07
450	688109	品茗科技	579	73,590.90	0.07
451	000021	深科技	2,900	73,312.00	0.07
452	301162	国能日新	1,400	71,764.00	0.07
453	002293	罗莱生活	6,900	70,863.00	0.07
454	300138	晨光生物	5,700	70,737.00	0.07
455	301357	北方长龙	500	70,480.00	0.07
456	002609	捷顺科技	7,500	69,675.00	0.06
457	688084	晶品特装	820	67,896.00	0.06
458	000848	承德露露	7,900	67,150.00	0.06
459	603520	司太立	7,100	66,740.00	0.06
460	688639	华恒生物	2,006	65,355.48	0.06
461	300779	惠城环保	500	65,055.00	0.06
462	688378	奥来德	2,371	64,728.30	0.06
463	002080	中材科技	1,700	61,778.00	0.06
464	301068	大地海洋	2,300	60,536.00	0.06
465	688028	沃尔德	931	60,086.74	0.06
466	603181	皇马科技	4,200	60,018.00	0.06
467	002127	南极电商	17,800	59,986.00	0.06

468	002380	科远智慧	2,200	59,840.00	0.06
469	603309	维力医疗	4,400	59,796.00	0.06
470	600073	光明肉业	9,300	59,520.00	0.06
471	605128	上海沿浦	1,600	58,976.00	0.05
472	002594	比亚迪	600	58,632.00	0.05
473	600733	北汽蓝谷	7,300	58,619.00	0.05
474	603119	浙江荣泰	500	57,835.00	0.05
475	688678	福立旺	2,389	57,766.02	0.05
476	688788	科思科技	850	57,239.00	0.05
477	000726	鲁泰 A	8,000	56,960.00	0.05
478	002206	海利得	9,700	56,745.00	0.05
479	688191	智洋创新	1,751	56,347.18	0.05
480	601577	长沙银行	5,800	56,260.00	0.05
481	301093	华兰股份	1,100	56,210.00	0.05
482	603969	银龙股份	5,500	55,605.00	0.05
483	301070	开勒股份	900	55,395.00	0.05
484	300369	绿盟科技	7,400	55,352.00	0.05
485	002749	国光股份	4,100	54,653.00	0.05
486	300119	瑞普生物	2,900	54,433.00	0.05
487	603889	新澳股份	6,800	54,060.00	0.05
488	603611	诺力股份	2,200	53,790.00	0.05
489	600059	古越龙山	5,800	53,708.00	0.05
490	688550	瑞联新材	1,185	53,692.35	0.05
491	000975	山金国际	2,200	53,526.00	0.05
492	300911	亿田智能	1,600	53,280.00	0.05
493	605056	咸亨国际	3,200	52,800.00	0.05
494	601339	百隆东方	9,100	52,689.00	0.05
495	688685	迈信林	947	52,539.56	0.05
496	688103	国力电子	867	52,531.53	0.05
497	603885	吉祥航空	3,500	52,080.00	0.05
498	301307	美利信	1,500	51,870.00	0.05
499	688108	赛诺医疗	2,674	51,447.76	0.05
500	301096	百诚医药	900	51,426.00	0.05
501	688776	国光电气	506	50,974.44	0.05
502	688687	凯因科技	2,041	50,861.72	0.05
503	002367	康力电梯	6,300	50,778.00	0.05
504	002919	名臣健康	2,200	50,578.00	0.05
505	000404	长虹华意	7,400	50,098.00	0.05
506	688375	国博电子	538	50,093.18	0.05
507	688334	西高院	2,587	50,084.32	0.05
508	002818	富森美	4,500	49,995.00	0.05
509	002073	软控股份	6,100	49,715.00	0.05
510	688399	硕世生物	722	49,457.00	0.05
511	002817	黄山胶囊	6,500	49,400.00	0.05

512	688008	澜起科技	419	49,358.20	0.05
513	600170	上海建工	18,600	49,290.00	0.05
514	002996	顺博合金	6,500	49,140.00	0.05
515	688593	新相微	2,433	49,097.94	0.05
516	605286	同力天启	1,200	48,732.00	0.05
517	301007	德迈仕	1,200	48,624.00	0.05
518	300206	理邦仪器	3,800	48,602.00	0.05
519	688557	兰剑智能	1,332	48,524.76	0.05
520	688697	纽威数控	3,132	48,170.16	0.04
521	000885	城发环境	3,500	48,020.00	0.04
522	688280	精进电动	5,515	47,980.50	0.04
523	600664	哈药股份	13,900	47,955.00	0.04
524	301280	珠城科技	900	47,934.00	0.04
525	601678	滨化股份	11,300	47,912.00	0.04
526	300696	爱乐达	1,500	47,865.00	0.04
527	301260	格力博	2,800	47,740.00	0.04
528	002452	长高电新	5,800	47,734.00	0.04
529	002731	萃华珠宝	3,800	47,728.00	0.04
529	300226	上海钢联	1,900	47,728.00	0.04
531	603303	得邦照明	3,700	47,693.00	0.04
532	600626	申达股份	9,800	47,334.00	0.04
533	603987	康德莱	5,500	47,300.00	0.04
534	605050	福然德	3,500	47,145.00	0.04
535	000498	山东路桥	7,800	47,034.00	0.04
535	002454	松芝股份	5,400	47,034.00	0.04
537	002935	天奥电子	2,100	46,935.00	0.04
538	003019	宸展光电	1,400	46,872.00	0.04
539	603609	禾丰股份	6,600	46,794.00	0.04
540	300925	法本信息	2,200	46,728.00	0.04
541	300193	佳士科技	5,200	46,540.00	0.04
542	300991	创益通	1,100	46,398.00	0.04
543	002492	恒基达鑫	5,300	46,322.00	0.04
544	000529	广弘控股	7,700	46,277.00	0.04
545	603071	物产环能	3,500	46,270.00	0.04
546	300145	南方泵业	9,800	46,256.00	0.04
547	300018	中元股份	4,200	46,200.00	0.04
548	600661	昂立教育	4,500	46,125.00	0.04
549	002357	富临运业	4,300	46,096.00	0.04
550	601218	吉鑫科技	9,100	46,046.00	0.04
551	002801	微光股份	1,300	46,033.00	0.04
552	002082	万邦德	3,300	45,969.00	0.04
553	002241	歌尔股份	1,600	45,968.00	0.04
553	300263	隆华科技	5,200	45,968.00	0.04
555	300084	海默科技	4,600	45,954.00	0.04

556	600305	恒顺醋业	5,800	45,936.00	0.04
557	002004	华邦健康	9,600	45,888.00	0.04
558	002314	南山控股	16,100	45,885.00	0.04
559	601599	浙文影业	11,500	45,770.00	0.04
560	603162	海通发展	3,800	45,752.00	0.04
561	300408	三环集团	1,000	45,750.00	0.04
562	603687	大胜达	4,800	45,744.00	0.04
563	300938	信测标准	1,400	45,640.00	0.04
564	301393	昊帆生物	900	45,621.00	0.04
565	301081	严牌股份	4,500	45,585.00	0.04
566	000987	越秀资本	5,600	45,584.00	0.04
567	002099	海翔药业	7,300	45,552.00	0.04
568	002376	新北洋	5,900	45,548.00	0.04
569	300365	恒华科技	7,200	45,504.00	0.04
569	300756	金马游乐	800	45,504.00	0.04
571	600780	通宝能源	8,000	45,440.00	0.04
572	301603	乔锋智能	600	45,420.00	0.04
573	300863	卡倍亿	900	45,360.00	0.04
574	000030	富奥股份	7,900	45,346.00	0.04
575	300158	振东制药	7,800	45,318.00	0.04
576	300331	苏大维格	1,400	45,304.00	0.04
577	002587	奥拓电子	6,700	45,292.00	0.04
578	688079	美迪凯	3,990	45,166.80	0.04
579	000990	诚志股份	5,700	45,144.00	0.04
580	688505	复旦张江	5,426	45,035.80	0.04
581	688373	盟科药业	7,450	44,998.00	0.04
582	605100	华丰股份	1,000	44,970.00	0.04
583	300412	迦南科技	8,400	44,940.00	0.04
584	002106	莱宝高科	4,100	44,936.00	0.04
585	002282	博深股份	6,100	44,835.00	0.04
586	000757	浩物股份	9,200	44,804.00	0.04
587	002950	奥美医疗	4,100	44,772.00	0.04
588	002494	华斯股份	8,300	44,737.00	0.04
589	603516	淳中科技	200	44,700.00	0.04
590	601999	出版传媒	6,500	44,655.00	0.04
591	002042	华孚时尚	10,500	44,625.00	0.04
592	002707	众信旅游	6,200	44,578.00	0.04
593	600284	浦东建设	5,300	44,520.00	0.04
594	000153	丰原药业	7,100	44,517.00	0.04
595	300143	盈康生命	4,500	44,460.00	0.04
596	002054	德美化工	6,000	44,280.00	0.04
597	300074	华平股份	9,600	44,256.00	0.04
598	688468	科美诊断	6,023	44,208.82	0.04
599	300190	维尔利	10,300	44,187.00	0.04

600	000008	神州高铁	15,500	44,175.00	0.04
601	301178	天亿马	900	44,172.00	0.04
602	002988	豪美新材	1,200	44,160.00	0.04
603	002826	易明医药	2,400	44,112.00	0.04
604	600676	交运股份	7,500	44,100.00	0.04
605	000554	泰山石油	6,800	44,064.00	0.04
606	600758	辽宁能源	12,100	44,044.00	0.04
607	601199	江南水务	7,900	44,003.00	0.04
608	600386	北巴传媒	10,000	43,900.00	0.04
609	601515	衢州东峰	10,200	43,860.00	0.04
610	603848	好太太	2,400	43,848.00	0.04
611	603219	富佳股份	2,600	43,784.00	0.04
612	002793	罗欣药业	9,100	43,680.00	0.04
613	688707	振华新材	3,142	43,516.70	0.04
614	002386	天原股份	8,000	43,440.00	0.04
614	600805	悦达投资	8,000	43,440.00	0.04
616	600223	福瑞达	5,900	43,424.00	0.04
617	600488	津药药业	10,600	43,354.00	0.04
618	603335	迪生力	7,700	43,351.00	0.04
619	600746	江苏索普	6,300	43,344.00	0.04
620	600052	东望时代	9,200	43,332.00	0.04
621	603213	镇洋发展	3,300	43,329.00	0.04
622	002440	闰土股份	5,800	43,326.00	0.04
623	600425	青松建化	10,400	43,264.00	0.04
624	002375	亚厦股份	11,400	43,206.00	0.04
625	002723	小崧股份	5,100	43,197.00	0.04
626	603867	新化股份	1,700	43,180.00	0.04
627	600448	华纺股份	13,700	43,155.00	0.04
628	601518	吉林高速	15,300	43,146.00	0.04
629	002135	东南网架	9,500	43,130.00	0.04
630	600613	神奇制药	7,100	43,097.00	0.04
631	605066	天正电气	5,900	43,070.00	0.04
632	300425	中建环能	8,700	43,065.00	0.04
633	002998	优彩资源	5,700	43,035.00	0.04
634	600326	西藏天路	3,900	43,017.00	0.04
635	600854	春兰股份	8,600	42,914.00	0.04
636	603776	永安行	2,400	42,912.00	0.04
637	600790	轻纺城	11,200	42,896.00	0.04
638	600616	金枫酒业	8,000	42,880.00	0.04
639	002358	森源电气	7,900	42,818.00	0.04
640	300039	上海凯宝	7,100	42,813.00	0.04
641	000597	东北制药	8,200	42,804.00	0.04
642	688371	菲沃泰	2,315	42,758.05	0.04
643	300521	爱司凯	1,500	42,750.00	0.04

643	600569	安阳钢铁	19,000	42,750.00	0.04
645	300422	博世科	9,300	42,687.00	0.04
646	688758	赛分科技	2,407	42,676.11	0.04
647	000782	恒申新材	8,600	42,656.00	0.04
648	300572	安车检测	1,500	42,645.00	0.04
649	600935	华塑股份	17,400	42,630.00	0.04
650	000707	双环科技	7,000	42,350.00	0.04
651	603980	吉华集团	8,400	42,336.00	0.04
652	002489	浙江永强	11,000	42,130.00	0.04
653	300057	万顺新材	7,400	42,106.00	0.04
654	603615	茶花股份	1,800	42,084.00	0.04
655	600846	同济科技	3,200	42,080.00	0.04
656	301168	通灵股份	900	42,030.00	0.04
657	600691	潞化科技	15,200	41,952.00	0.04
658	603223	恒通股份	4,500	41,850.00	0.04
659	300511	雪榕生物	6,700	41,808.00	0.04
660	002365	永安药业	2,800	41,776.00	0.04
661	001313	粤海饲料	5,700	41,724.00	0.04
662	301458	钧崴电子	1,300	41,717.00	0.04
663	603815	交建股份	5,600	41,664.00	0.04
664	000968	蓝焰控股	6,300	41,643.00	0.04
665	301051	信濠光电	2,100	41,160.00	0.04
666	600510	黑牡丹	4,900	41,111.00	0.04
667	300341	麦克奥迪	2,500	40,850.00	0.04
668	600941	中国移动	400	40,420.00	0.04
669	688518	联赢激光	1,642	39,884.18	0.04
670	301448	开创电气	800	39,872.00	0.04
671	605580	恒盛能源	1,700	38,352.00	0.04
672	000603	盛达资源	1,200	37,152.00	0.03
673	002956	西麦食品	1,300	36,556.00	0.03
674	000807	云铝股份	1,100	36,124.00	0.03
675	002616	长青集团	6,200	33,852.00	0.03
676	600760	中航沈飞	600	33,690.00	0.03
677	688037	芯源微	226	33,563.26	0.03
678	600900	长江电力	1,200	32,628.00	0.03
679	002270	华明装备	1,300	32,552.00	0.03
680	688169	石头科技	188	28,587.28	0.03
681	688653	康希通信	2,347	28,516.05	0.03
682	603129	春风动力	100	27,868.00	0.03
683	002352	顺丰控股	700	26,824.00	0.02
684	300292	吴通控股	5,800	26,158.00	0.02
685	300973	立高食品	600	25,800.00	0.02
686	605305	中际联合	600	24,996.00	0.02
687	300531	优博讯	1,300	23,452.00	0.02

688	301270	汉仪股份	600	22,428.00	0.02
689	603183	建研院	5,100	21,981.00	0.02
690	000931	中关村	4,200	20,454.00	0.02
691	688306	均普智能	1,686	19,557.60	0.02
692	688277	天智航	1,255	19,063.45	0.02
693	001328	登康口腔	400	15,792.00	0.01
694	688548	广钢气体	536	7,793.44	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300750	宁德时代	7,576,798.00	10.01
2	601899	紫金矿业	6,427,299.00	8.49
3	300498	温氏股份	5,394,635.00	7.13
4	601988	中国银行	5,228,082.00	6.91
5	000001	平安银行	4,724,932.00	6.24
6	688256	寒武纪	4,413,068.77	5.83
7	600519	贵州茅台	4,375,974.00	5.78
8	300308	中际旭创	3,726,345.00	4.92
9	688235	百济神州	3,645,118.26	4.82
10	603259	药明康德	3,413,709.00	4.51
11	600276	恒瑞医药	3,399,177.00	4.49
12	603151	邦基科技	3,372,269.00	4.46
13	002475	立讯精密	3,315,145.00	4.38
14	688271	联影医疗	3,227,523.74	4.26
15	300502	新易盛	3,088,262.00	4.08
16	600900	长江电力	3,082,053.00	4.07
17	002241	歌尔股份	2,960,775.00	3.91
18	600941	中国移动	2,946,419.00	3.89
19	601898	中煤能源	2,876,369.00	3.80
20	000333	美的集团	2,875,019.00	3.80
21	601166	兴业银行	2,840,701.00	3.75
22	002384	东山精密	2,828,506.00	3.74
23	688041	海光信息	2,789,998.95	3.69
24	601288	农业银行	2,774,324.00	3.67
25	002371	北方华创	2,712,940.00	3.58
26	002594	比亚迪	2,693,530.00	3.56
27	600710	苏美达	2,678,203.00	3.54
28	600919	江苏银行	2,645,068.00	3.49

29	000933	神火股份	2,634,751.00	3.48
30	600030	中信证券	2,590,080.00	3.42
31	601138	工业富联	2,501,578.00	3.30
32	300033	同花顺	2,473,324.00	3.27
33	600050	中国联通	2,473,065.00	3.27
34	600031	三一重工	2,454,023.00	3.24
35	600938	中国海油	2,448,880.00	3.24
36	601211	国泰海通	2,421,738.00	3.20
37	603993	洛阳钼业	2,400,736.00	3.17
38	600461	洪城环境	2,382,770.00	3.15
39	002558	巨人网络	2,336,912.00	3.09
40	000858	五粮液	2,293,829.00	3.03
41	002600	领益智造	2,241,627.00	2.96
42	002714	牧原股份	2,240,927.00	2.96
43	605296	神农集团	2,227,142.00	2.94
44	300383	光环新网	2,227,079.00	2.94
45	688608	恒玄科技	2,190,557.81	2.89
46	600809	山西汾酒	2,184,808.00	2.89
47	601088	中国神华	2,148,120.00	2.84
48	002463	沪电股份	2,123,858.80	2.81
49	300476	胜宏科技	2,123,362.00	2.81
50	688692	达梦数据	2,107,545.42	2.78
51	600901	江苏金租	2,103,804.00	2.78
52	601825	沪农商行	2,087,382.00	2.76
53	002294	信立泰	2,086,644.01	2.76
54	601838	成都银行	2,077,476.00	2.74
55	002233	塔牌集团	2,075,530.00	2.74
56	688111	金山办公	2,071,295.30	2.74
57	000807	云铝股份	2,048,063.00	2.71
58	600729	重庆百货	2,032,093.00	2.68
59	601658	邮储银行	2,028,959.00	2.68
60	002230	科大讯飞	2,027,310.00	2.68
61	600015	华夏银行	2,022,021.00	2.67
62	601229	上海银行	2,016,712.66	2.66
63	000425	徐工机械	2,010,010.00	2.66
64	603477	巨星农牧	1,985,936.00	2.62
65	601225	陕西煤业	1,984,789.00	2.62
66	002032	苏泊尔	1,958,612.00	2.59
67	300442	润泽科技	1,947,277.00	2.57
68	688981	中芯国际	1,940,057.00	2.56
69	600064	南京高科	1,925,149.00	2.54
70	002966	苏州银行	1,920,652.90	2.54
71	603288	海天味业	1,915,972.00	2.53
72	601398	工商银行	1,892,855.00	2.50

73	603986	兆易创新	1,879,968.00	2.48
74	600098	广州发展	1,868,576.00	2.47
75	603565	中谷物流	1,838,864.00	2.43
76	000975	山金国际	1,837,191.00	2.43
77	300363	博腾股份	1,832,734.00	2.42
78	601818	光大银行	1,792,620.00	2.37
79	603606	东方电缆	1,788,255.00	2.36
80	002244	滨江集团	1,787,748.00	2.36
81	601107	四川成渝	1,785,139.00	2.36
82	600926	杭州银行	1,768,963.00	2.34
83	002311	海大集团	1,766,470.00	2.33
84	601628	中国人寿	1,766,024.00	2.33
85	601688	华泰证券	1,756,451.00	2.32
86	688617	惠泰医疗	1,744,126.02	2.30
87	000651	格力电器	1,740,433.00	2.30
88	000729	燕京啤酒	1,736,056.60	2.29
89	600377	宁沪高速	1,730,801.00	2.29
90	002100	天康生物	1,704,811.00	2.25
91	600036	招商银行	1,703,639.00	2.25
92	688088	虹软科技	1,692,537.98	2.24
93	300274	阳光电源	1,689,826.00	2.23
94	300433	蓝思科技	1,688,897.00	2.23
95	601169	北京银行	1,676,488.00	2.21
96	601665	齐鲁银行	1,661,305.00	2.19
97	600887	伊利股份	1,656,471.00	2.19
98	600060	海信视像	1,650,657.00	2.18
99	601668	中国建筑	1,645,183.00	2.17
100	600585	海螺水泥	1,644,819.00	2.17
101	002916	深南电路	1,637,288.00	2.16
102	600000	浦发银行	1,606,319.54	2.12
103	300759	康龙化成	1,601,593.00	2.12
104	600988	赤峰黄金	1,594,716.00	2.11
105	600177	雅戈尔	1,572,101.00	2.08
106	600415	小商品城	1,571,687.00	2.08
107	000538	云南白药	1,567,873.40	2.07
108	601881	中国银河	1,565,817.00	2.07
109	688336	三生国健	1,557,521.74	2.06
110	688428	诺诚健华	1,546,924.19	2.04
111	300394	天孚通信	1,541,891.00	2.04
112	688212	澳华内镜	1,541,616.51	2.04
113	600016	民生银行	1,531,034.00	2.02
114	601328	交通银行	1,529,861.00	2.02
115	601689	拓普集团	1,517,397.00	2.00

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	300750	宁德时代	7,800,336.00	10.31
2	601899	紫金矿业	6,757,116.57	8.93
3	300498	温氏股份	5,453,844.00	7.21
4	601988	中国银行	5,151,198.00	6.81
5	000001	平安银行	4,695,635.00	6.20
6	600519	贵州茅台	4,547,524.00	6.01
7	688256	寒武纪	3,876,251.39	5.12
8	300308	中际旭创	3,771,545.28	4.98
9	688235	百济神州	3,391,505.05	4.48
10	603151	邦基科技	3,371,080.30	4.45
11	600276	恒瑞医药	3,353,387.00	4.43
12	002594	比亚迪	3,341,049.00	4.41
13	300502	新易盛	3,307,784.40	4.37
14	002241	歌尔股份	3,243,671.76	4.29
15	688271	联影医疗	3,195,169.78	4.22
16	600900	长江电力	3,106,101.00	4.10
17	603259	药明康德	3,065,059.00	4.05
18	600941	中国移动	2,988,190.67	3.95
19	002475	立讯精密	2,962,693.52	3.91
20	600710	苏美达	2,863,222.00	3.78
21	601166	兴业银行	2,852,857.00	3.77
22	000333	美的集团	2,851,232.00	3.77
23	688041	海光信息	2,804,021.09	3.70
24	002371	北方华创	2,792,033.00	3.69
25	601288	农业银行	2,734,319.00	3.61
26	002384	东山精密	2,695,376.00	3.56
27	601898	中煤能源	2,603,192.00	3.44
28	300476	胜宏科技	2,587,215.00	3.42
29	000858	五粮液	2,477,901.76	3.27
30	600050	中国联通	2,454,331.00	3.24
31	603993	洛阳钼业	2,445,494.00	3.23
32	600030	中信证券	2,425,525.00	3.20
33	600461	洪城环境	2,414,484.00	3.19
34	002714	牧原股份	2,370,111.00	3.13
35	000807	云铝股份	2,364,186.00	3.12

36	000933	神火股份	2,362,932.00	3.12
37	600938	中国海油	2,342,817.00	3.10
38	605296	神农集团	2,335,201.00	3.09
39	601211	国泰海通	2,333,525.00	3.08
40	600031	三一重工	2,323,363.00	3.07
41	300033	同花顺	2,305,262.00	3.05
42	600919	江苏银行	2,254,161.00	2.98
43	688608	恒玄科技	2,239,301.73	2.96
44	600015	华夏银行	2,225,945.00	2.94
45	002233	塔牌集团	2,197,002.00	2.90
46	601088	中国神华	2,140,171.00	2.83
47	601229	上海银行	2,134,557.00	2.82
48	000975	山金国际	2,110,859.00	2.79
49	601838	成都银行	2,059,787.00	2.72
50	300383	光环新网	2,036,860.00	2.69
51	603288	海天味业	2,033,829.00	2.69
52	600729	重庆百货	2,021,100.00	2.67
53	002230	科大讯飞	2,016,012.00	2.66
54	002463	沪电股份	2,014,516.00	2.66
55	002600	领益智造	2,007,571.00	2.65
56	002558	巨人网络	1,993,937.00	2.63
57	000425	徐工机械	1,993,228.00	2.63
58	601658	邮储银行	1,980,648.00	2.62
59	688692	达梦数据	1,977,470.89	2.61
60	002032	苏泊尔	1,965,138.00	2.60
61	600901	江苏金租	1,952,258.00	2.58
62	600064	南京高科	1,951,912.00	2.58
63	603477	巨星农牧	1,924,208.00	2.54
64	601818	光大银行	1,916,640.00	2.53
65	002311	海大集团	1,910,929.00	2.52
66	600887	伊利股份	1,910,282.00	2.52
67	600098	广州发展	1,886,158.00	2.49
68	601689	拓普集团	1,878,655.00	2.48
69	002294	信立泰	1,868,302.00	2.47
70	601825	沪农商行	1,858,015.00	2.45
71	300433	蓝思科技	1,857,369.00	2.45
72	600809	山西汾酒	1,847,041.00	2.44
73	603565	中谷物流	1,840,795.00	2.43
74	603606	东方电缆	1,835,008.00	2.42
75	601688	华泰证券	1,828,873.00	2.42
76	600585	海螺水泥	1,825,719.00	2.41
77	688617	惠泰医疗	1,785,733.75	2.36
78	300274	阳光电源	1,774,911.00	2.34
79	688336	三生国健	1,771,903.24	2.34

80	300394	天孚通信	1,766,273.40	2.33
81	600926	杭州银行	1,753,111.00	2.32
82	300363	博腾股份	1,749,289.00	2.31
83	600000	浦发银行	1,749,082.00	2.31
84	601398	工商银行	1,743,157.00	2.30
85	000651	格力电器	1,724,513.00	2.28
86	600377	宁沪高速	1,719,380.00	2.27
87	002100	天康生物	1,709,093.00	2.26
88	688212	澳华内镜	1,709,084.67	2.26
89	002244	滨江集团	1,703,508.00	2.25
90	601107	四川成渝	1,702,040.00	2.25
91	688088	虹软科技	1,696,691.61	2.24
92	601138	工业富联	1,690,870.00	2.23
93	688981	中芯国际	1,685,852.73	2.23
94	002966	苏州银行	1,684,122.00	2.22
95	600021	上海电力	1,675,622.00	2.21
96	601628	中国人寿	1,674,964.00	2.21
97	601009	南京银行	1,657,768.00	2.19
98	601169	北京银行	1,654,883.00	2.19
99	600016	民生银行	1,644,490.00	2.17
100	601668	中国建筑	1,639,330.00	2.17
101	601225	陕西煤业	1,633,426.00	2.16
102	688111	金山办公	1,632,124.46	2.16
103	300442	润泽科技	1,627,471.00	2.15
104	600060	海信视像	1,622,056.10	2.14
105	000568	泸州老窖	1,604,667.00	2.12
106	600177	雅戈尔	1,575,785.00	2.08
107	000538	云南白药	1,573,794.00	2.08
108	601665	齐鲁银行	1,566,613.00	2.07
109	600036	招商银行	1,529,649.00	2.02
110	688428	诺诚健华	1,527,211.02	2.02

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,029,350,448.46
卖出股票收入（成交）总额	1,020,147,596.22

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,000.08	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,000.08	0.01

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118063	金 05 转债	60	6,000.08	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，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龙岩市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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	31,749.04
2	应收清算款	1,236,575.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	94,820.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,363,144.55

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
易方达量化策略精选混合 A	1,170	34,741.98	22,451,750.35	55.23%	18,196,365.69	44.77%
易方达量化策略精选混合 C	1,048	19,315.82	217,209.56	1.07%	20,025,773.22	98.93%
合计	2,218	27,453.16	22,668,959.91	37.23%	38,222,138.91	62.77%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达量化策略精选混合 A	78,340.02	0.1927%
	易方达量化策略精选混合 C	31,415.24	0.1552%
	合计	109,755.26	0.1802%

9.3 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	份额级别	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	易方达量化策略精选混合 A	0
	易方达量化策略精选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达量化策略精选混合 A	0
	易方达量化策略精选混合 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
王建军	公募基金	10~50
	私募资产管理计划	0

	合计	10~50
--	----	-------

注：持有本人管理的产品份额总量的数量区间为基金经理本人及其直系亲属持有份额的合计数。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达量化策略精选混合 A	易方达量化策略精选混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 19 日）基金份额总额	193,032,569.46	229,017,061.52
本报告期期初基金份额总额	36,610,627.44	20,472,201.53
本报告期基金总申购份额	10,175,225.60	13,902,691.75
减：本报告期基金总赎回份额	6,137,737.00	14,131,910.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,648,116.04	20,242,982.78

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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。本基金管理人于 2025 年 9 月 30 日发布公告，自 2025 年 9 月 29 日起张清华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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金已连续 2 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 22,500.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《货币市场基金监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管部门对管理人上述方面部分制度机制不完善、规定执行不严格提出整改意见，管理人已及时通过完善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改，整改成果已经监管部门验收通过。
其他	/

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，本基金相关从业人员未受到调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	25,675,934.16	1.25%	9,371.88	2.26%	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	2,023,793,680.52	98.75%	404,781.90	97.74%	-
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	-	-	-	-	-

银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
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国泰海通证券股份有限公司、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、浙商证券股份有限公司。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。本年度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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
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	83,088.57	100.00%	353,000,000.00	100.00%	-	-
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	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达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	中国证券报	2025-01-21
2	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2025-03-22

		金电子披露网站	
4	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
6	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-25
7	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
8	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	中国证券报	2025-03-31
9	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	中国证券报	2025-04-22
10	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-17
11	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06
12	易方达基金管理有限公司关于设立易方达财富管理基金销售（广州）有限公司的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-07-03
13	易方达基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-07-10
14	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-07-21
15	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	中国证券报	2025-08-30
16	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-05
17	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-30
18	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-10-28
19	易方达基金管理有限公司关于终止锦州银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-01

20	关于易方达财富管理基金销售（广州）有限公司展业及易方达基金管理有限公司零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-23
21	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-25

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025 年 01 月 01 日 ~2025 年 12 月 31 日	22,205,773.50	0.00	0.00	22,205,773.50	36.47 %
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。							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
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。

13.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年三月三十一日