

易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2026 年第 2 季度报告

2026 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	易方达深证 100ETF 联接
基金主代码	110019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 1 日
报告期末基金份额总额	668,996,111.63 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达深证 100ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达深证 100 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将年化跟踪误差控制在 4%以内，主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券和货币市场工具投资

	策略、金融衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资业务策略等。		
业绩比较基准	深证 100 价格指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于易方达深证 100 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与深证 100 价格指数的表现密切相关。		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	易方达深证 100ETF 联接 A	易方达深证 100ETF 联接 C	易方达深证 100ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	110019	004742	022923
报告期末下属分级基金的份额总额	590,789,293.34 份	72,275,660.92 份	5,931,157.37 份

注: 1.自2017年6月2日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年6月5日。

2.自2024年12月13日起,本基金增设Y类份额类别,份额首次确认日为2024年12月16日。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159901
基金运作方式	交易型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2006 年 3 月 24 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所

上市日期	2006 年 4 月 24 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.1% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。为更好地实现投资目标，本基金可投资存托凭证。本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品，如与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。
业绩比较基准	深证 100 价格指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期		
	(2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)		
	易方达深证 100ETF 联接 A	易方达深证 100ETF 联接 C	易方达深证 100ETF 联接 Y
1.本期已实现收益	43,922,080.35	4,822,021.64	354,635.81
2.本期利润	226,169,812.02	26,813,159.72	1,732,626.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.3635	0.3743	0.3468
4.期末基金资产净值	1,228,672,865.84	148,236,498.00	12,335,053.11
5.期末基金份额净值	2.0797	2.0510	2.0797

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达深证 100ETF 联接 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	20.70%	1.62%	20.20%	1.63%	0.50%	-0.01%
过去六个月	18.83%	1.38%	18.23%	1.39%	0.60%	-0.01%
过去一年	51.77%	1.30%	49.60%	1.30%	2.17%	0.00%
过去三年	46.24%	1.37%	38.71%	1.38%	7.53%	-0.01%
过去五年	3.62%	1.32%	-4.29%	1.33%	7.91%	-0.01%
过去七年	88.23%	1.36%	70.05%	1.37%	18.18%	-0.01%
过去十年	114.80%	1.33%	85.21%	1.34%	29.59%	-0.01%
自基金合同生效起	107.97%	1.48%	66.97%	1.47%	41.00%	0.01%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

易方达深证 100ETF 联接 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	20.63%	1.62%	20.20%	1.63%	0.43%	-0.01%
过去六个月	18.69%	1.38%	18.23%	1.39%	0.46%	-0.01%
过去一年	51.40%	1.30%	49.60%	1.30%	1.80%	0.00%
过去三年	45.15%	1.37%	38.71%	1.38%	6.44%	-0.01%
过去五年	2.34%	1.32%	-4.29%	1.33%	6.63%	-0.01%
过去七年	85.56%	1.36%	70.05%	1.37%	15.51%	-0.01%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	101.57%	1.37%	81.29%	1.38%	20.28%	-0.01%

易方达深证 100ETF 联接 Y:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	20.70%	1.62%	20.20%	1.63%	0.50%	-0.01%
过去六个月	18.83%	1.38%	18.23%	1.39%	0.60%	-0.01%
过去一年	51.77%	1.30%	49.60%	1.30%	2.17%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	48.22%	1.26%	44.25%	1.27%	3.97%	-0.01%

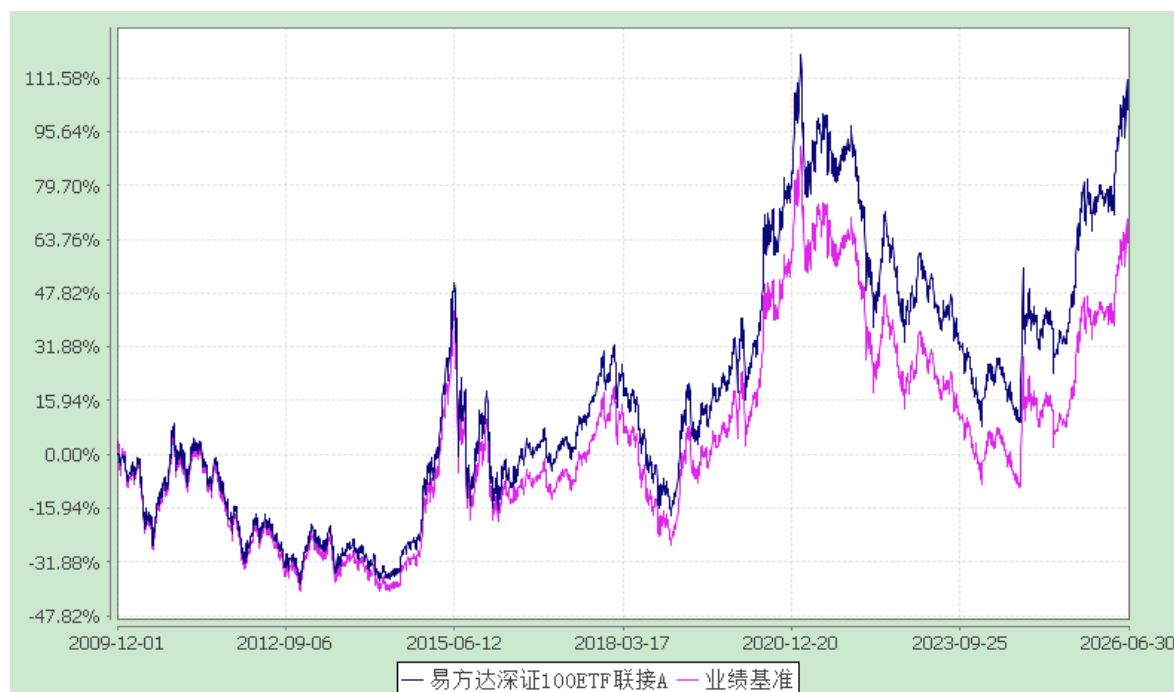
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

易方达深证 100ETF 联接 A:

(2009 年 12 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)



易方达深证 100ETF 联接 C:

(2017 年 6 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日)



易方达深证 100ETF 联接 Y

(2024 年 12 月 16 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：1.自 2017 年 6 月 2 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2017 年 6 月 5 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2024 年 12 月 16 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
刘树荣	本基金的基金经理，易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）、易方达中证 800ETF、易方达中证 800ETF 联接、易方达中证国企一带一路 ETF 联接、易方达中证国企一带	2017-07-18	-	19 年	硕士，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员，易方达深证成指 ETF 联接、易方达深证成指 ETF、易方达中小企业 100 指数（LOF）、易方达银行分级、易方达

	一路 ETF、易方达中证银行 ETF 联接 (LOF)、易方达中证银行 ETF、易方达中证 1000ETF、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证港股通消费主题 ETF 联接、易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理, 易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达创业板 200ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达创业板成长 ETF、易方达创业板 200ETF 联接、易方达创业板成长 ETF 联接发起式、易方达中证国资央企 50ETF、易方达中证金融科技主题 ETF、易方达中证国资央企 50ETF 联接发起式、易方达中证金融科技主题 ETF 联接的基金经理助理				生物分级、易方达中证万得并购重组指数 (LOF)、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达标普 500 指数 (QDII-LOF)、易方达标普医疗保健指数 (QDII-LOF)、易方达标普生物科技指数 (QDII-LOF)、易方达标普信息科技指数 (QDII-LOF)、易方达上证中盘 ETF、易方达中证浙江新动能 ETF 联接(QDII)、易方达中证浙江新动能 ETF(QDII)、易方达中证长江保护主题 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF 联接发起式的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管

理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 30 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为易方达深证 100ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资易方达深证 100ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达深证 100ETF 跟踪深证 100 指数，该指数由深圳证券交易所中市值大、流动性好的 100 只股票组成。

2026 年二季度国内经济延续修复态势，政策托底成效持续显现，产业升级与新质生产力发展稳步推进，经济向好运行态势保持稳定。投资端结构持续优化，重点加大科技赛道倾斜投入，前沿技术研发、数字化产业改造、高新装备升级配套投资持续加码，科创专项项目落地节奏提速，基建与制造业技改协同发力，持续夯实产业创新发展根基，投资内生支撑力不断增强。消费端具备韧性，服务类消费需求旺盛，新型消费持续扩容，依托多元消费场景持续挖掘内需增长空间，居民消费信心稳步修复。出口端整体保有较强韧性，内部结构深度迭代优化，增长重心向高技术产业倾斜，依托全球 AI 算力产业景气周期，集成电路、光模块、智能算力设备等高附加值科创产品外销热度高涨，高端新能源整车、工业机器人等高端装备外销同步扩容，低附加值传统加工品占比稳步回落。货币调控维持稳健取向，市场流动性保持宽裕状态，结构性金融工具精准滴灌实体经济重点领域，实体经济融资环境持续友好。资本市场内部风格呈现明显分化，成长板块依托产业高景气持续走强，而价值板块市场关注度偏弱，行情相对承压走弱。综合来看，2026 年二季度 A 股市场整体上行，成长风格相关指数表现更为突出。报告期内，深证 100 指数上涨 21.31%。

深证 100 指数历经多年动态新陈代谢，已逐步汇聚深市主板与创业板的核心龙头企业，实现对深市优势行业的全面覆盖。伴随深市产业结构升级，指数当前既涵盖消费、基建等传统经济龙头，新能源、电子、生物医药等新经济行业占比亦持续攀升。

其行业分布相对均衡，多元化配置特征不仅有助于分散投资风险，更能适配中国产业快速迭代的发展格局。整体而言，深证 100 指数兼具突出的创新成长属性与鲜明的市场化蓝筹特征，长期业绩表现稳健，是投资者分享中国经济高质量发展红利的核心工具之一。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 2.0797 元，本报告期份额净值增长率为 20.70%，同期业绩比较基准收益率为 20.20%；C 类基金份额净值为 2.0510 元，本报告期份额净值增长率为 20.63%，同期业绩比较基准收益率为 20.20%；Y 类基金份额净值为 2.0797 元，本报告期份额净值增长率为 20.70%，同期业绩比较基准收益率为 20.20%。年化跟踪误差 0.57%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	304,802.00	0.02
	其中：股票	304,802.00	0.02
2	基金投资	1,317,981,087.88	91.84
3	固定收益投资	38,145,664.68	2.66
	其中：债券	38,145,664.68	2.66
	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	48,570,466.59	3.38
8	其他资产	30,160,043.91	2.10
9	合计	1,435,162,065.06	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式（ETF）	易方达基金管理有限公司	1,317,981,087.88	94.87

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	211,202.00	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-

J	金融业	93,600.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	304,802.00	0.02

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	000776	广发证券	4,000	93,600.00	0.01
2	000725	京东方 A	8,400	72,912.00	0.01
3	002916	深南电路	100	45,790.00	0.00
4	000100	TCL 科技	5,000	29,100.00	0.00
5	000630	铜陵有色	3,700	23,532.00	0.00
6	002938	鹏鼎控股	200	21,076.00	0.00
7	002648	卫星化学	800	18,792.00	0.00

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)
1	国家债券	38,145,664.68	2.75
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,145,664.68	2.75

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	019827	26 国债 01	379,000	38,145,664.68	2.75

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

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

除上述主体外，基金管理人未发现本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的公开谴责。铜陵有色金属集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到铜陵市应急管理局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	204,263.14
2	应收证券清算款	16,897,832.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,057,948.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	30,160,043.91

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达深证 100ETF联接A	易方达深证 100ETF联接C	易方达深证 100ETF联接Y
报告期期初基金份额 总额	653,072,317.59	83,524,306.93	4,448,556.16

报告期期间基金总申购份额	27,803,643.86	50,011,425.57	2,872,862.08
减：报告期期间基金总赎回份额	90,086,668.11	61,260,071.58	1,390,260.87
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	590,789,293.34	72,275,660.92	5,931,157.37

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
- 2.《易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3.《易方达深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

9.3查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年七月二十一日