

# 易方达高股息量化选股股票型发起式证券投资基金

## 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

|            |                                                                                                                                        |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 易方达高股息量化选股股票发起式                                                                                                                        |
| 基金主代码      | 021049                                                                                                                                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                 |
| 基金合同生效日    | 2025 年 5 月 7 日                                                                                                                         |
| 报告期末基金份额总额 | 99,962,217.89 份                                                                                                                        |
| 投资目标       | 本基金在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                          |
| 投资策略       | 资产配置方面，本基金将综合考虑宏观与微观经济、市场与政策等因素，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。股票投资方面，本基金将挖掘高股息主题相关公司的投资机会。本基金界定的高股息主题相关公司是指满足以下所有条件的公司：（1）过去两年中至少有一年派发股息 |

|                 |                                                                                                                                                                                                               |                   |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
|                 | <p>且股息率处于行业前 50%。（2）经营状况良好，具有稳定分红能力，红利分配相关政策及执行情况不存在异常。本基金不主动投资于 ST 及*ST 股票。本基金主要采用量化选股策略选择投资价值较高的股票，并结合组合优化策略，在控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。本基金投资存托凭证的策略依照上述股票投资策略执行。债券投资方面,本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资管理。</p>  |                   |
| 业绩比较基准          | 中证红利指数收益率×70%+中证港股通高股息投资指数收益率×15%+中债总指数收益率×15%                                                                                                                                                                |                   |
| 风险收益特征          | <p>本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。</p> |                   |
| 基金管理人           | 易方达基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                   |                   |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                    |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 易方达高股息量化选股股票发起式 A                                                                                                                                                                                             | 易方达高股息量化选股股票发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 021049                                                                                                                                                                                                        | 021050            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 68,489,635.08 份                                                                                                                                                                                               | 31,472,582.81 份   |

### § 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) |                   |
|                | 易方达高股息量化选股股票发起式 A                | 易方达高股息量化选股股票发起式 C |
| 1.本期已实现收益      | 502,764.50                       | 219,557.70        |
| 2.本期利润         | -4,412,200.85                    | -2,057,679.31     |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0684                          | -0.0708           |
| 4.期末基金资产净值     | 74,582,088.08                    | 34,113,691.59     |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0890                           | 1.0839            |

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

易方达高股息量化选股股票发起式 A

| 阶段    | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -5.24% | 0.88%     | -10.58%    | 0.73%         | 5.34%  | 0.15% |
| 过去六个月 | -3.37% | 0.91%     | -7.39%     | 0.79%         | 4.02%  | 0.12% |
| 过去一年  | 8.45%  | 0.79%     | -6.06%     | 0.67%         | 14.51% | 0.12% |
| 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 | 12.17% | 0.74% | -4.14% | 0.63% | 16.31% | 0.11% |

## 易方达高股息量化选股股票发起式 C

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | -5.35% | 0.88%     | -10.58%    | 0.73%         | 5.23%  | 0.15% |
| 过去六个月      | -3.58% | 0.90%     | -7.39%     | 0.79%         | 3.81%  | 0.11% |
| 过去一年       | 8.01%  | 0.79%     | -6.06%     | 0.67%         | 14.07% | 0.12% |
| 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 | 11.65% | 0.74%     | -4.14%     | 0.63%         | 15.79% | 0.11% |

## 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

易方达高股息量化选股股票型发起式证券投资基金  
 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  
 （2025 年 5 月 7 日至 2026 年 6 月 30 日）

易方达高股息量化选股股票发起式 A



### 易方达高股息量化选股股票发起式 C



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时，本基金投资于高股息主题相关股票低于非现金基金资产的 80%，为被动超标；除此之外，其他各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## § 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 |        |                                                                                                                                                                                                                        |
| 明朗  | 本基金的基金经理，易方达沪深 300 量化增强的基金经理                                                                           | 2025-05-07  | -    | 11 年   | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任交通银行股份有限公司高级投资经理，易方达基金管理有限公司投资经理、投资经理助理、量化研究员。                                                                                                                                                        |
| 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 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 | 2025-05-07  | -    | 19 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、易方达量化策略精选混合的基金经理。 |

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。

3.根据 2026 年 7 月 4 日《易方达高股息量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理变更公告》，自 2026 年 7 月 4 日起，王建军不再担任本基金的基金经理，明朗仍担任本基金的基金经理。

#### 4.1.1 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     | 4       | 1,261,061,571.07  | 2021-09-04 |
|     | 私募资产管理计划 | 5       | 11,827,619,496.40 | 2019-07-25 |
|     | 其他组合     | 0       | 0.00              | -          |
|     | 合计       | 9       | 13,088,681,067.47 | -          |

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，国内经济运行整体呈现企稳回升与新旧动能转换并存的态势。从最新公布的经济数据观察，制造业景气度展现出较强韧性，国家统计局数据显示，二季度制造业 PMI 在短暂波动后，6 月回升至扩张区间上方。从结构上看，高技术制造业持续向好，成为支撑宏观经济景气的重要力量；而传统制造业及部分内需消费链条仍处于筑底阶段。总体而言，随着宏观总量政策的稳健推进以及产业升级战略的深化，

经济基本面呈现出“科技制造强、传统动能平”的分化特征。

股票市场方面，2026 年二季度 A 股市场迎来了显著的反弹，但呈现出极端的结构性分化行情，以 AI、半导体为核心的科技成长主线重塑了市场定价逻辑。具体来看，各宽基指数在二季度均录得正收益，但涨跌幅差异极为显著：上证指数二季度收益率为 5.20%，沪深 300 指数收益率为 11.90%，中证 500 指数收益率为 18.56%；而代表科技与创新动能的创业板指与科创 50 指数则在单季度内大幅上涨，收益率分别高达 36.35% 和 75.74%。行业层面，电子、通信及半导体等硬科技板块受产业景气度持续爆发提振，单季涨幅居前；相反，农林牧渔、商贸零售及部分传统周期板块走势则相对承压。从市场风格考量，极致的科技成长风格吸纳了绝大部分市场增量资金，呈现出明显的资金集中流入效应，导致以红利资产为代表的价值防御风格在本报告期内涨幅显著落后于大盘及成长风格。

报告期内，面对风格极致偏向科技成长的市场环境，本基金依然坚守量化选股模型，严格贯彻符合高股息选股逻辑的基本面及市场因子，优选公司稳健经营、现金流充裕、股息率高且估值具备安全边际的个股进行均衡配置。二季度市场资金高度向科技主线集中，导致红利资产在大盘博弈中阶段性跑输宽基指数，但我们并未因此进行非理性的风格漂移去盲目追高。我们认为，在市场风格极端演绎、估值分化加剧的阶段，当前优质蓝筹与红利资产的安全边际进一步凸显。本基金在下阶段的投资运作中，将继续坚持基本面量化投资理念，持续优化迭代多因子模型，以获取长期稳健的绝对收益为目标，力争在不同市场环境下为投资者创造长期可持续的投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0890 元，本报告期份额净值增长率为-5.24%，同期业绩比较基准收益率为-10.58%；C 类基金份额净值为 1.0839 元，本报告期份额净值增长率为-5.35%，同期业绩比较基准收益率为-10.58%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金且发起资金持有期限不满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“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”的披露规定。

## § 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              | 100,861,826.76 | 89.66        |
|    | 其中：股票             | 100,861,826.76 | 89.66        |
| 2  | 固定收益投资            | 8,000.32       | 0.01         |
|    | 其中：债券             | 8,000.32       | 0.01         |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 10,286,659.38  | 9.14         |
| 7  | 其他资产              | 1,341,628.63   | 1.19         |
| 8  | 合计                | 112,498,115.09 | 100.00       |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 19,976,469.35 元，占净值比例 18.38%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 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         | 2,295,344.00  | 2.11         |
| B  | 采矿业              | 13,330,130.00 | 12.26        |
| C  | 制造业              | 39,256,608.19 | 36.12        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,120,497.00  | 1.03         |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业             | 945,159.00    | 0.87  |
| F | 批发和零售业          | 1,604,315.00  | 1.48  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 2,035,597.00  | 1.87  |
| H | 住宿和餐饮业          | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,689,561.12  | 1.55  |
| J | 金融业             | 15,977,780.70 | 14.70 |
| K | 房地产业            | 648,144.00    | 0.60  |
| L | 租赁和商务服务业        | 1,843,254.00  | 1.70  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 138,967.40    | 0.13  |
| 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              | 80,885,357.41 | 74.41 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别   | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 能源     | 4,210,096.36  | 3.87         |
| 材料     | 254,052.61    | 0.23         |
| 工业     | 787,366.63    | 0.72         |
| 非必需消费品 | 1,629,026.32  | 1.50         |
| 必需消费品  | 252,617.77    | 0.23         |
| 保健     | 522,300.81    | 0.48         |
| 金融     | 8,266,546.23  | 7.61         |
| 信息技术   | 334,558.51    | 0.31         |
| 电信服务   | 2,165,156.18  | 1.99         |
| 公用事业   | -             | -            |
| 房地产    | 1,554,747.93  | 1.43         |
| 合计     | 19,976,469.35 | 18.38        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 5.3 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

### 5.3.1 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  | 601318 | 中国平安 | 53,900  | 2,573,186.00 | 2.37 |
| 1  | 02318  | 中国平安 | 16,500  | 731,601.38   | 0.67 |
| 2  | 03328  | 交通银行 | 428,000 | 2,505,523.56 | 2.31 |
| 2  | 601328 | 交通银行 | 75,200  | 483,536.00   | 0.44 |
| 3  | 02611  | 国泰海通 | 105,200 | 1,356,866.18 | 1.25 |
| 3  | 601211 | 国泰海通 | 59,800  | 1,088,360.00 | 1.00 |
| 4  | 002714 | 牧原股份 | 65,600  | 2,295,344.00 | 2.11 |
| 5  | 601088 | 中国神华 | 46,700  | 1,823,168.00 | 1.68 |
| 5  | 01088  | 中国神华 | 13,500  | 470,424.05   | 0.43 |
| 6  | 600256 | 广汇能源 | 461,800 | 2,281,292.00 | 2.10 |
| 7  | 01171  | 兖矿能源 | 174,000 | 1,669,961.09 | 1.54 |
| 7  | 600188 | 兖矿能源 | 30,800  | 547,316.00   | 0.50 |
| 8  | 00700  | 腾讯控股 | 5,800   | 2,165,156.18 | 1.99 |
| 9  | 601699 | 潞安环能 | 144,400 | 2,062,032.00 | 1.90 |
| 10 | 601225 | 陕西煤业 | 90,400  | 1,839,640.00 | 1.69 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)  | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -        | -            |
| 2  | 央行票据      | -        | -            |
| 3  | 金融债券      | -        | -            |
|    | 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） | 8,000.32 | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -        | -            |
| 9  | 其他        | -        | -            |
| 10 | 合计        | 8,000.32 | 0.01         |

#### 5.5 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<br>(%) |
|---|--------|------|----|----------|------------|
| 1 | 118070 | 南芯转债 | 80 | 8,000.32 | 0.01       |

## 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。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 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。

## 5.10 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。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。山西潞安环保能源开发股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到长治市生态环境局、长治市应急管理局的处罚。中国神华能源股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京铁路督察室、鄂尔多斯市生态环境局、鄂尔多斯市伊金霍洛旗住房和城乡建设局、鄂尔多斯市应急管理局、国家矿山安全监察局陕西局、忻州市应急管理局（忻州市地方煤矿安全监督管理局）、伊金霍洛旗乌兰木伦镇人民政府、伊金霍洛旗自然资源局、榆林市能源局、榆林市生态环境局的处罚。兖矿能源集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到济宁市能源局的处罚。

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。

5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金   | 29,796.79    |
| 2 | 应收证券清算款 | 351,606.85   |
| 3 | 应收股利    | 159,909.50   |
| 4 | 应收利息    | -            |
| 5 | 应收申购款   | 800,315.49   |
| 6 | 其他应收款   | -            |
| 7 | 其他      | -            |
| 8 | 合计      | 1,341,628.63 |

#### 5.11.4 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。

#### 5.11.5 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                            | 易方达高股息量化<br>选股股票发起式A | 易方达高股息量化<br>选股股票发起式C |
|-------------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 60,470,974.64        | 28,190,332.01        |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 20,644,129.70        | 21,457,681.43        |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 12,625,469.26        | 18,175,430.63        |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -                    | -                    |
| 报告期期末基金份额总额                   | 68,489,635.08        | 31,472,582.81        |

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 易方达高股息量化选股 | 易方达高股息量化选股 |
|----|------------|------------|
|----|------------|------------|

|                          | 股票发起式 A       | 股票发起式 C |
|--------------------------|---------------|---------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,000,416.70 | -       |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             | -       |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             | -       |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,000,416.70 | -       |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 14.6014       | -       |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额（份） | 交易金额（元）     | 适用费率 |
|----|------|------------|---------|-------------|------|
| 1  | 现金分红 | 2026-06-09 | -       | -350,014.58 | -    |
| 合计 |      |            | -       | -350,014.58 |      |

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,416.70 | 10.0042%     | 10,000,416.70 | 10.0042%     | 不少于 3 年    |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -            | -             | -            | -          |
| 基金经理等人员     | -             | -            | -             | -            | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -            | -             | -            | -          |
| 其他          | -             | -            | -             | -            | -          |
| 合计          | 10,000,416.70 | 10.0042%     | 10,000,416.70 | 10.0042%     | -          |

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达高股息量化选股混合型证券投资基金变更注册的文件；
- 2.《易方达高股息量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达高股息量化选股股票型发起式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。

### 10.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年七月二十一日