

易方达优质精选混合型证券投资基金

2026 年中期报告

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

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	41
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	41
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	42
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	49
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	51
7.8 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	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	51

7.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	52
7.11	投资组合报告附注	52
§ 8	基金份额持有人信息	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2	盈利投资者数量占比	53
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.4	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	53
§ 9	开放式基金份额变动	53
§ 10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4	基金投资策略的改变	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	54
10.8	其他重大事件	62
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	63
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	63
§ 12	备查文件目录	63
12.1	备查文件目录	63
12.2	存放地点	63
12.3	查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达优质精选混合型证券投资基金
基金简称	易方达优质精选混合（QDII）
基金主代码	110011
交易代码	110011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 10 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
报告期末基金份额总额	1,704,481,647.01 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过精选优质企业，力求在有效控制风险的前提下，实现基金资产的长期增值。
投资策略	资产配置方面，本基金结合宏观经济与市场分析，评估各类资产的预期收益与风险，在基金合同约定的范围内，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，本基金基于深度的研究分析，在内地和香港市场精选具有良好治理结构、在细分行业具有竞争优势以及有较高成长性的优质企业；本基金投资存托凭证的策略依照上述股票投资策略执行。其他投资策略方面，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；可在综合考虑预期收益率、信用风险、流动性等因素的基础上进行资产支持证券投资；根据风险管理的原则并综合考虑多种因素，可投资股指期货、国债期货、股票期权；可在符合有关法律法规、严格控制风险的前提下，进行证券借贷交易、回购交易、融资交易等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证香港 300 指数收益率×30%+中债总指数收益率×20%
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。 本基金可投资港股通股票以及港股通以外的香港市场挂牌交易的股票，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、股价波动较大的风险等投资于香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有风险。本基金投资香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有风险详见招募说明书。

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	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街1 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	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		510627；510623；519031	100818
法定代表人		吴欣荣	葛海蛟

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	无	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	无	中国银行(香港)有限公司
注册地址		无	香港中环花园道一号，中银大厦 14 楼
办公地址		无	香港德辅道中 2A 中国银行大厦 5 楼
邮政编码		无	无

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-739,156,934.74
本期利润	-2,453,397,438.62
加权平均基金份额本期利润	-1.2727
本期加权平均净值利润率	-25.74%
本期基金份额净值增长率	-25.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,158,908,411.90
期末可供分配基金份额利润	2.4400
期末基金资产净值	6,777,001,473.91
期末基金份额净值	3.9760
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-46.19%

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

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

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	-19.03%	1.00%	3.20%	0.87%	-22.23%	0.13%
过去六个月	-25.11%	1.08%	-0.89%	0.84%	-24.22%	0.24%
过去一年	-19.36%	1.02%	9.77%	0.77%	-29.13%	0.25%
过去三年	-27.15%	1.33%	21.37%	0.88%	-48.52%	0.45%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	-46.19%	1.53%	0.14%	0.91%	-46.33%	0.62%

3.2.2 自基金转型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

易方达优质精选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
(2021 年 9 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：本基金由原易方达中小盘混合型证券投资基金于 2021 年 9 月 10 日变更注册而来。

§ 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		
张坤	本基金的基金经理，易方达亚洲精选股票（QDII）、易方达蓝筹精选混合、易方达优质企业三年持有混合的基金经理，高级董事总经理、权益投资决策委员会委员	2021-09-10	-	18 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行业研究员、基金经理助理、研究部总经理助理、副总经理级高级管理人员，

					易方达中小盘混合、易方达新丝路混合的基金经理。
彭珂	本基金的基金经理，易方达科益混合（自 2023 年 10 月 14 日至 2026 年 05 月 28 日）、易方达行业领先混合、易方达研究精选股票、易方达消费机遇混合的基金经理	2026-06-27	-	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中银国际证券有限责任公司分析员，九泰基金管理有限公司研究员，易方达基金管理有限公司行业研究员、投资经理。

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/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。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 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》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人努力通过建立有纪律、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相应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，通过投资交易系统内的公平交易模块，同时依据境外市场的交易特点规范交易委托方式，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。

4.4.2 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 64 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股市场方面，沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 800 指数上涨 11.12%，上证指数上涨 3.16%，创业板指数上涨 35.58%。香港市场震荡下跌，恒生指数下跌 10.73%，恒生中国企业指数下跌 15.21%。

地产方面，1-6 月份，新建商品房销售面积同比下降 11.6%，新建商品房销售额同比下降 13.6%，全国房地产开发投资同比下降 18.0%，房地产行业的下行压力依然较大。上半年，国内需求继续下行，5 月份社会消费品零售总额同比下降 0.6%，是疫情结束后首次负增长，上半年社会消费品零售总额同比增长 1.3%。2026 年二季度 GDP 同比增速为 4.3%，是 2023 年以来单季度 GDP 的最低增速。根据中国新就业形态研究中心的研究，预计 2026 年灵活就业人数达到 3.2 亿。另一方面，以 Anthropic 和 OpenAI 为代表的头部模型公司的模型能力不断进步，订阅收入快速增长，进而拉动全球 AI 资本投资的不断上修，并在供应链的一些环节出现供不应求导致的涨价情况。股票市场方面，上半年分化明显，电子、通信等行业表现较好，而消费、农业、钢铁等行业表现相对落后。

本基金在上半年开始由团队共同管理，对结构进行了调整，增加了电子、通信等行业的配置比例，降低了食品饮料、医药等行业的配置比例。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 3.9760 元，本报告期份额净值增长率为-25.11%，同期业绩比较基准收益率为-0.89%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从中国经济的中长期发展中枢来看，考虑 2035 年迈入中等发达国家的目标，我国需要保持 4.5% 以上的实际 GDP 增长。如果考虑打破通缩后 GDP 平减系数回到 1.5% 左右，那么中国的 GDP 名义增速在 6% 左右是正常的。进一步考虑中国在全球主要国家中几乎最低的居民消费占比，居民消费占 GDP 比例有较大提升空间，因此长期来看居民消费以 7% 的速度增长应该是不奇怪的。

然而，2026 年 1-6 月社零增速仅为 1.3%，和 7% 产生了较大的偏差。这仅仅用 AI 带来的“K 型分化”是无法解释的，一个例子是 AI 发展最快、K 型冲击更大的美国 1-6 月的社零增速为 5.1%。中枢水平的高低是无法用分化来解释的。疫情后，居民超额储蓄金额不断增加，消费意愿下降，预防性储蓄上升，以应对未来就业等不确定性。然而，凯恩斯曾经提出过“节俭悖论”，当个人增加储蓄

时，短期内可能减少消费支出，从而降低总需求，导致产量下降、失业增加，最终国民收入下降。目前，可能需要借助外力打破“节俭悖论”和螺旋加强的负面预期，使经济循环重新活跃起来。

以老百姓日常生活为例，中国内地的老百姓接受的电商、外卖、快递、打车、OTA（在线旅游）等服务，在全球来看质量都是领先的，费用却几乎是最低的。不少在海外生活的中国人回国后都会赞叹其性价比水平。然而，服务价格是否越低越好？14 亿中国人中，大部分人不止是消费者，同时也通过服务 14 亿人获得收入，一个人的支出就是另一个人的收入，甲可能因为乙的缩减支出而收入下降，导致缩减自己的支出，进而影响到丙的收入。消费循环的顺畅是至关重要的。链家的创始人左晖先生曾表达过，帮助经纪人为消费者提供有品质、有效率、平等的服务，让服务者能够有合理的不错的收入，能够一定程度上平衡自己的工作、时间和家庭，从而让消费者的体验是愉悦的。服务者得不到尊重，就很难尊重消费者；只有服务者有尊严、收入体面、工作生活平衡，才能持续给消费者提供高品质服务，形成正循环。

从海外的经验来看，一个更加繁荣的经济环境，对于科技创新的突破也是更加有利的。在 AI 发展的时代，我们认为 AI 的发展和人类的消费并不是对立的，到目前为止 AI 的角色绝大部分是作为生产力工具。然而，人类的底层代码基因决定了人和人之间始终是需要感情、信任和连接，以及在人与人的关系中寻找生命的意义。我们认为，至少在人类能改写自身的底层代码基因之前，这些是 AI 无法替代的。

AI 产业方面，底层模型能力依然在不断进步，行业天花板被进一步打开。但有两个现实问题也是行业后续不可避免要面对的，首先是伴随着编程领域渗透率预期已经显著上升、北美资本开支预期将达万亿美金体量之际，如何解锁编程之外的新领域，进一步打开资本开支上行预期。其次是涨价预期过高带来的回落风险以及市场的杠杆问题。这可能会对全球科技产业产生连锁反应。

AI 投资方面，我们看到了一些企业的业绩爆发，但同时我们认为企业是否能够长期受益至少是同等重要的。企业的竞争壁垒是否足够高？在产业链的位置是否难以替代？两三年短期盈利爆发后是否会面临供给格局的长期恶化？提价带来的短期盈利增长能否持续？特别是对于硬件公司，这些问题同样值得思考。如果产品的难度不够高，那么随着时间的推移，供给的持续增加迟早会把企业的超额收益抹平，甚至可能会导致后面很长时间都无法获得社会平均回报率水平。我们希望通过企业的高竞争壁垒或者高现金/市值比提供更多的下行保护。

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

本基金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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达优质精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达优质精选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	771,704,762.08	701,160,031.14
结算备付金		325.35	-
存出保证金		861,684.76	489,373.63
交易性金融资产	6.4.7.2	5,512,355,887.86	10,746,773,781.87
其中：股票投资		5,512,355,887.86	10,746,773,781.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		560,015,317.06	26,092,605.45
应收股利		20,695,047.50	-
应收申购款		6,809,227.47	3,959,946.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		6,872,442,252.08	11,478,475,739.03
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		85,498,198.13	79,005,733.58
应付管理人报酬		7,329,435.28	12,094,229.10
应付托管费		1,221,572.56	2,015,704.84
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.6	1,391,572.20	433,639.06
负债合计		95,440,778.17	93,549,306.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,704,481,647.01	2,144,400,699.04
未分配利润	6.4.7.8	5,072,519,826.90	9,240,525,733.41
净资产合计		6,777,001,473.91	11,384,926,432.45
负债和净资产总计		6,872,442,252.08	11,478,475,739.03

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.9760 元，基金份额总额 1,704,481,647.01 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达优质精选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,386,634,564.80	234,755,571.90
1.利息收入		180,130.81	455,673.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	180,130.81	455,673.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-642,542,314.23	-973,656,852.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-736,996,550.93	-1,157,028,110.16
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	1,363,494.66
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	94,454,236.70	182,007,763.14
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,714,240,503.88	1,222,507,846.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-31,063,091.37	-15,563,209.58
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,031,213.87	1,012,113.15
减：二、营业总支出		66,762,873.82	95,306,231.55
1. 管理人报酬		57,020,712.28	81,224,014.50
2. 托管费		9,503,452.04	13,537,335.77

3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	18,016.32
其中：卖出回购金融资产支出		-	18,016.32
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	238,709.50	526,864.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,453,397,438.62	139,449,340.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,453,397,438.62	139,449,340.35
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,453,397,438.62	139,449,340.35

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达优质精选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,144,400,699.04	9,240,525,733.41	11,384,926,432.45
二、本期期初净资产	2,144,400,699.04	9,240,525,733.41	11,384,926,432.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-439,919,052.03	-4,168,005,906.51	-4,607,924,958.54
（一）、综合收益总额	-	-2,453,397,438.62	-2,453,397,438.62
（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）	-439,919,052.03	-1,714,608,467.89	-2,154,527,519.92
其中：1.基金申购款	133,334,441.19	517,702,182.32	651,036,623.51
2.基金赎回款	-573,253,493.22	-2,232,310,650.21	-2,805,564,143.43
（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	1,704,481,647.01	5,072,519,826.90	6,777,001,473.91
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,785,167,827.24	10,847,545,604.61	13,632,713,431.85
二、本期期初净资产	2,785,167,827.24	10,847,545,604.61	13,632,713,431.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-193,041,625.54	-658,697,602.24	-851,739,227.78
（一）、综合收益总额	-	139,449,340.35	139,449,340.35
（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）	-193,041,625.54	-798,146,942.59	-991,188,568.13
其中：1.基金申购款	116,808,583.78	479,372,551.39	596,181,135.17
2.基金赎回款	-309,850,209.32	-1,277,519,493.98	-1,587,369,703.30
（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	2,592,126,201.70	10,188,848,002.37	12,780,974,204.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：齐昕

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达优质精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册而成。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[2021]2431 号《关于准予易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册的批复》和基金管理人于 2021 年 9 月 10 日发布

的《易方达基金管理有限公司关于易方达中小盘混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金，并相应调整基金投资策略和投资比例限制、业绩比较基准、开放日安排、估值条款、基金费用条款、收益分配政策等，基金名称相应变更为“易方达优质精选混合型证券投资基金”。2021 年 9 月 10 日起，原《易方达中小盘混合型证券投资基金基金合同》失效，《易方达优质精选混合型证券投资基金基金合同》生效。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，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、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》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》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。资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。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。

至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（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及金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，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，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，免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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。

(5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行；

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征收企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	771,704,762.08
等于：本金	771,690,735.31
加：应计利息	14,026.77
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	771,704,762.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,392,218,438.97	-	5,512,355,887.86	-1,879,862,551.11

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		7,392,218,438.97	-	5,512,355,887.86	-1,879,862,551.11

注：“股票”包括普通股、存托凭证和优先股等。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	37,865.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,251,006.84
其中：交易所市场	1,251,006.84
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	102,699.40
合计	1,391,572.20

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,144,400,699.04	2,144,400,699.04
本期申购	133,334,441.19	133,334,441.19
本期赎回（以“-”号填列）	-573,253,493.22	-573,253,493.22
本期末	1,704,481,647.01	1,704,481,647.01

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,170,139,687.99	3,070,386,045.42	9,240,525,733.41
本期期初	6,170,139,687.99	3,070,386,045.42	9,240,525,733.41
本期利润	-739,156,934.74	-1,714,240,503.88	-2,453,397,438.62
本期基金份额交易产生的变动数	-1,272,074,341.35	-442,534,126.54	-1,714,608,467.89
其中：基金申购款	385,843,236.04	131,858,946.28	517,702,182.32
基金赎回款	-1,657,917,577.39	-574,393,072.82	-2,232,310,650.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,158,908,411.90	913,611,415.00	5,072,519,826.90

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	151,651.44
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	27,530.98
其他	948.39
合计	180,130.81

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-736,996,550.93
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	-736,996,550.93

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,054,261,953.39
减：卖出股票成本总额	5,781,680,914.97
减：交易费用	9,577,589.35
买卖股票差价收入	-736,996,550.93

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	94,454,236.70
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	94,454,236.70

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-1,714,240,503.88
——股票投资	-1,714,240,503.88
——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	-1,714,240,503.88

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,031,213.87
合计	1,031,213.87

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	43,192.03
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	50,329.61
银行间账户维护费	18,000.00
港股通证券组合费	56,838.31
其他	10,842.18
合计	238,709.50

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司	境外托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	882,258.95	0.01%	282,389.40	0.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	322.03	0.01%	267.61	0.02%
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	103.07	0.00%	103.07	0.01%

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

2.本基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务及研究服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人

管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	57,020,712.28	81,224,014.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,586,177.13	25,310,661.43
应支付基金管理人的净管理费	37,434,535.15	55,913,353.07

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.2\%\div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,503,452.04	13,537,335.77

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对

一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中银香港-活期存款	558,408,854.70	-	815,722,213.14	-
中国银行-活期存款	213,295,907.38	151,651.44	208,142,925.70	431,319.40

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

广发证券（香港）经纪有限公司	1989 HK	广合科技	新股发行	20,700	1,308,145.99
中银国际亚洲有限公司	3355 HK	飞速创新	新股发行	45,800	1,676,760.72
广发证券股份有限公司	603435 CH	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
广发证券股份有限公司	920189 CH	康美特	新股发行	200	1,628.00
中银国际亚洲有限公司	9630 HK	芯碁微装	新股发行	4,550	1,000,144.22
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券（香港）经纪有限公司,中银国际亚洲有限公司	3288 HK	海天味业	新股发行	42,900	1,423,375.93
中银国际证券股份有限公司	603409 CH	汇通控股	新股发行	1,000	24,180.00

注：广发证券（香港）经纪有限公司为本基金管理人股东的关联方,中银国际亚洲有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方,中银国际证券股份有限公司为本基金托管人中国银行股份有限公司的关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				型						
001220 CH	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237 CH	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248 CH	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-
001257 CH	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312 CH	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365 CH	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393 CH	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399 CH	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
1768 HK	Busy Ming Group Co Ltd	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	205.50	261.12	103,600	21,961,066.25	27,052,122.34	-
301513 CH	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531 CH	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599 CH	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666 CH	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669 CH	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-

				受限						
30168 0 CH	固德 电材	2026-0 2-27	6 个月	新股 流通 受限	58.00	112.16	117	6,786. 00	13,122 .72	-
30168 2 CH	宏明 电子	2026-0 3-18	6 个月	新股 流通 受限	69.66	160.06	714	49,737 .24	114,28 2.84	-
30168 3 CH	慧谷 新材	2026-0 3-24	6 个月	新股 流通 受限	78.38	121.77	96	7,524. 48	11,689 .92	-
30168 7 CH	新广 益	2025-1 2-24	6 个月	新股 流通 受限	21.93	77.78	195	4,276. 35	15,167 .10	-
30169 6 CH	三瑞 智能	2026-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	24.68	86.80	216	5,330. 88	18,748 .80	-
601112 CH	振石 股份	2026-0 1-21	6 个月	新股 流通 受限	11.18	17.59	775	8,664. 50	13,632 .25	-
60328 4 CH	林平 发展	2026-0 2-03	6 个月	新股 流通 受限	37.88	34.87	46	1,742. 48	1,604. 02	-
60329 3 CH	埃泰 克	2026-0 4-09	6 个月	新股 流通 受限	33.49	33.93	72	2,411. 28	2,442. 96	-
60335 2 CH	至信 股份	2026-0 1-08	6 个月	新股 流通 受限	21.88	25.52	112	2,450. 56	2,858. 24	-
60343 5 CH	嘉德 利	2026-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	15.76	46.71	104	1,639. 04	4,857. 84	-
60345 9 CH	红板 科技	2026-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	17.70	84.32	330	5,841. 00	27,825 .60	-
68863 5 CH	长进 光子	2026-0 5-20	6 个月	新股 流通 受限	40.98	308.19	128	5,245. 44	39,448 .32	-
68871 2 CH	北芯 生命	2026-0 1-28	6 个月	新股 流通 受限	17.52	35.92	1,500	26,280 .00	53,880 .00	-
68875 9 CH	必贝 特	2025-1 0-21	9 个月	新股 流通 受限	17.78	30.65	12,552	223,17 4.56	384,71 8.80	-
68878	视涯	2026-0	9 个月	新股	22.68	42.16	6,335	143,67	267,08	-

1 CH	科技	3-18		流通受限				7.80	3.60	
688783 CH	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
688785 CH	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790 CH	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795 CH	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	10,828	1,237,423.84	7,329,906.32	-
688797 CH	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802 CH	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688808 CH	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811 CH	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813 CH	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816 CH	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818 CH	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820 CH	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
920136 CH	永励精密	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
920189 CH	康美特	2026-06-30	1 个月以内	新股流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-

92019 3 CH	吉和 昌	2026-0 6-18	1 个月 以内	新股 流通 受限	8.52	8.52	300	2,556. 00	2,556. 00	-
---------------	---------	----------------	------------	----------------	------	------	-----	--------------	--------------	---

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，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。

本基金可投资港股通股票以及港股通以外的香港市场挂牌交易的股票，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、股价波动较大的风险等投资于香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有风险。本基金投资香港市场的特有风险以及港股通机制相关的特有风险详见招募说明书。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定

的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金在境内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；在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。于 2026 年 6 月 30 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 0.00%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025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

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金

合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2026 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金可投资境外市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。此外，境外证券市场的每日证券交易价格无涨跌幅限制或涨跌幅空间大于国内市场，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	771,704,762.08	-	-	-	771,704,762.08
结算备付金	325.35	-	-	-	325.35
存出保证金	861,684.76	-	-	-	861,684.76
交易性金融资产	-	-	-	5,512,355,887.86	5,512,355,887.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	560,015,317.06	560,015,317.06
应收股利	-	-	-	20,695,047.50	20,695,047.50
应收申购款	-	-	-	6,809,227.47	6,809,227.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	772,566,772.19	-	-	6,099,875,479.89	6,872,442,252.08
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	-	-	-	85,498,198.13	85,498,198.13
应付管理人报酬	-	-	-	7,329,435.28	7,329,435.28
应付托管费	-	-	-	1,221,572.56	1,221,572.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	1,391,572.20	1,391,572.20
负债总计	-	-	-	95,440,778.17	95,440,778.17

利率敏感度缺口	772,566,772.19	-	-	6,004,434,701.72	6,777,001,473.91
上年度末 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	701,160,031.14	-	-	-	701,160,031.14
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	489,373.63	-	-	-	489,373.63
交易性金融资产	-	-	-	10,746,773,781.87	10,746,773,781.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	26,092,605.45	26,092,605.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,959,946.94	3,959,946.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	701,649,404.77	-	-	10,776,826,334.26	11,478,475,739.03
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	-	-	-	79,005,733.58	79,005,733.58
应付管理人报酬	-	-	-	12,094,229.10	12,094,229.10
应付托管费	-	-	-	2,015,704.84	2,015,704.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	433,639.06	433,639.06
负债总计	-	-	-	93,549,306.58	93,549,306.58

利率敏感度缺口	701,649,404.77	-	-	10,683,277,027.68	11,384,926,432.45
---------	----------------	---	---	-------------------	-------------------

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金可投资于海外市场，海外市场金融品种以外币计价，如果所投资市场的货币相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；外币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	25,330,690.63	647,993,980.99	-	673,324,671.62
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	2,540,214,749.30	-	2,540,214,749.30
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
应收股利	5,363,583.75	10,748,306.25	-	16,111,890.00
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	30,694,274.38	3,198,957,036.54	-	3,229,651,310.92
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	30,694,274.38	3,198,957,036.54	-	3,229,651,310.92

项目	上年度末			
	2025年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	1,003,712.64	632,841,609.23	-	633,845,321.87
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	5,323,039,457.66	-	5,323,039,457.66
衍生金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	16,253,417.23	-	16,253,417.23
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	1,003,712.64	5,972,134,484.12	-	5,973,138,196.76
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,003,712.64	5,972,134,484.12	-	5,973,138,196.76

6. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-161,482,565.55	-298,656,909.84
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	161,482,565.55	298,656,909.84

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易

的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VaR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	5,512,355,887.86	81.34	10,746,773,781.87	94.39
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	5,512,355,887.86	81.34	10,746,773,781.87	94.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	275,617,794.39	537,338,689.09
	2.业绩比较基准下降 5%	-275,617,794.39	-537,338,689.09

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	5,469,241,240.20
第二层次	20,078.00
第三层次	43,094,569.66
合计	5,512,355,887.86

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,512,355,887.86	80.21
	其中：普通股	5,512,355,887.86	80.21
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	771,705,087.43	11.23
8	其他各项资产	588,381,276.79	8.56
9	合计	6,872,442,252.08	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 686,546,389.76 元，占净值比例 10.13%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国内地	2,972,141,138.56	43.86
中国香港	2,540,214,749.30	37.48
合计	5,512,355,887.86	81.34

注：1.国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2.ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
能源	647,243,460.00	9.55
材料	83,579,916.57	1.23
工业	20,192,198.24	0.30
非必需消费品	1,385,321,204.23	20.44
必需消费品	2,119,422,161.94	31.27
保健	96,745,191.48	1.43
金融	-	-
信息技术	509,267,501.23	7.51
电信服务	650,287,249.24	9.60
公用事业	-	-
房地产	-	-

其他-GICS 未分类	297,004.93	0.00
合计	5,512,355,887.86	81.34

注：1.以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

2.本基金本报告期末持有的部分股票尚无 GICS 行业分类，因此将其归入“其他-GICS 未分类”。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量（股）	公允价值	占基金资 产净值比 例（%）
1	H World Group Limited	华住集团 有限公司	1179 HK	香港证 券交易 所	中国香港	22,000,000	637,446,216.00	9.41
2	Kweichow Moutai Co.,Ltd.	贵州茅台 酒股份有 限公司	600519 CH	上海证 券交易 所	中国内地	527,700	625,583,073.00	9.23
3	CNOOC Limited	中国海洋 石油有限 公司	883 HK	香港证 券交易 所	中国香港	32,500,000	573,590,420.00	8.46
4	Shanxi Xinghuac un Fen Wine Factory Co.,Ltd.	山西杏花 村汾酒厂 股份有限 公司	600809 CH	上海证 券交易 所	中国内地	4,546,380	497,237,580.60	7.34
5	Wuliangy e Yibin Co.,Ltd.	宜宾五粮 液股份有 限公司	000858 CH	深圳证 券交易 所	中国内地	6,613,909	489,429,266.00	7.22
6	Alibaba Group Holding Limited	阿里巴巴 集团控股 有限公司	9988 HK	香港证 券交易 所	中国香港	6,000,000	483,869,205.00	7.14
7	Luzhou Laojiao Co.,Ltd	泸州老窖 股份有限 公司	000568 CH	深圳证 券交易 所	中国内地	6,193,500	480,120,120.00	7.08
8	Tencent Holdings Limited	腾讯控股 有限公司	700 HK	香港证 券交易 所	中国香港	1,212,200	452,517,642.04	6.68
9	Yum China Holdings, Inc.	百胜中国 控股有限 公司	9987 HK	香港证 券交易 所	中国香港	950,900	263,958,980.72	3.89
10	Focus	分众传媒	002027 CH	深圳证	中国内地	35,050,100	169,642,484.00	2.50

	Media Informati on Technolog y Co., Ltd.	信息技术 股份有限 公司		券交易 所				
11	NAURA Technolog y Group Co.,Ltd.	北方华创 科技集团 股份有限 公司	002371 CH	深圳证 券交易 所	中国内地	153,300	135,603,048.00	2.00
12	Eoptolink Technolog y Inc.,Ltd.	成都新易 盛通信技 术股份有 限公司	300502 CH	深圳证 券交易 所	中国内地	141,732	86,031,324.00	1.27
13	Shenzhen New Industries Biomedic al Engineeri ng Co.,Ltd.	深圳市新 产业生物 医学工程 股份有限 公司	300832 CH	深圳证 券交易 所	中国内地	1,770,800	74,373,600.00	1.10
14	Petrochin a Company Limited	中国石 油天然 气股份 有限公 司	857 HK	香港证 券交易 所	中国香港	10,000,000	73,653,040.00	1.09
15	Foxconn Industrial Internet Co.,Ltd.	富士康工 业互联网 股份有限 公司	601138 CH	上海证 券交易 所	中国内地	972,700	70,180,305.00	1.04
16	Konfoong Materials Internatio nal Co., Ltd.	宁波江丰 电子材料 股份有限 公司	300666 CH	深圳证 券交易 所	中国内地	148,100	54,589,660.00	0.81
17	Sinoma Science & Technolog y Co.,Ltd.	中材科技 股份有限 公司	002080 CH	深圳证 券交易 所	中国内地	428,300	38,547,000.00	0.57
18	China Jushi Co.,Ltd	中国巨石 股份有限 公司	600176 CH	上海证 券交易 所	中国内地	466,600	34,005,808.00	0.50
19	Anji Microelec tronics	安集微电 子科技(上 海)股份有	688019 CH	上海证 券交易 所	中国内地	82,976	28,167,032.96	0.42

	Technology (Shanghai) Co., Ltd.	有限公司						
20	Netease, Inc.	网易公司	9999 HK	香港证券交易所	中国香港	160,000	28,127,123.20	0.42
21	Shengyi Technology Co., Ltd.	广东生益科技股份有限公司	600183 CH	上海证券交易所	中国内地	158,600	27,501,240.00	0.41
22	Gigadevice Semiconductor Inc.	兆易创新科技集团股份有限公司	603986 CH	上海证券交易所	中国内地	33,200	27,058,000.00	0.40
23	Busy Ming Group Co., Ltd.	湖南鸣鸣很忙商业连锁股份有限公司	1768 HK	香港证券交易所	中国香港	103,600	27,052,122.34	0.40
24	Shannon Semiconductor Technology Co., Ltd.	香农芯创科技股份有限公司	300475 CH	深圳证券交易所	中国内地	86,400	25,920,000.00	0.38
25	Nanya New Material Technology Co., Ltd.	南亚新材料科技股份有限公司	688519 CH	上海证券交易所	中国内地	64,549	24,531,201.96	0.36
26	Apt Medical Inc.	深圳惠泰医疗器械股份有限公司	688617 CH	上海证券交易所	中国内地	120,803	21,932,992.68	0.32
27	Suzhou Kematek, Inc.	苏州珂玛材料科技股份有限公司	301611 CH	深圳证券交易所	中国内地	110,800	19,951,756.00	0.29
28	Shennan Circuits Co., Ltd.	深南电路股份有限公司	002916 CH	深圳证券交易所	中国内地	32,200	14,744,380.00	0.22
29	Intco Recycling Resources Co., Ltd.	英科再生资源股份有限公司	688087 CH	上海证券交易所	中国内地	327,012	10,928,741.04	0.16
30	Moore	摩尔线程	688795 CH	上海证	中国内地	10,828	7,329,906.32	0.11

	Threads Technology Co., Ltd.	智能科技(北京)股份有限公司		券交易所				
31	Metax Integrated Circuits (Shanghai) Co., Ltd.	沐曦集成电路(上海)股份有限公司	688802 CH	上海证券交易所	中国内地	3,994	3,070,946.66	0.05
32	Xi'An Eswin Material Technology Co., Ltd.	西安奕斯伟材料科技股份有限公司	688783 CH	上海证券交易所	中国内地	44,370	2,547,725.40	0.04
33	Dapustor Corporation	深圳大普微电子股份有限公司	301666 CH	深圳证券交易所	中国内地	1,220	565,262.60	0.01
34	Bebetter Med Inc.	广州必贝特医药股份有限公司	688759 CH	上海证券交易所	中国内地	12,552	384,718.80	0.01
35	Sj Semiconductor Corporation	盛合晶微半导体有限公司	688820 CH	上海证券交易所	中国内地	2,391	338,302.59	0.00
36	Beijing Onmicro Electronics Co., Ltd.	北京昂瑞微电子技术有限公司	688790 CH	上海证券交易所	中国内地	2,319	293,237.55	0.00
37	Seeya Technology Corp.	视涯科技股份有限公司	688781 CH	上海证券交易所	中国内地	6,335	267,083.60	0.00
38	Semight Instruments Co., Ltd.	苏州联讯仪器股份有限公司	688808 CH	上海证券交易所	中国内地	163	258,245.79	0.00
39	HKC Corporation Limited	惠科股份有限公司	001399 CH	深圳证券交易所	中国内地	6,488	179,912.24	0.00
40	Cetc Lantian	中电科蓝天科技股	688818 CH	上海证券交易所	中国内地	1,717	120,430.38	0.00

	Technology Co., Ltd.	份有限公司		所				
41	Chengdu Hongming Electronic Co., Ltd	成都宏明电子股份有限公司	301682 CH	深圳证券交易所	中国内地	714	114,282.84	0.00
42	Chongqing Genor Technology Co., Ltd.	重庆臻宝科技股份有限公司	688797 CH	上海证券交易所	中国内地	207	97,014.69	0.00
43	Insight Lifetech Co., Ltd.	深圳北芯生命科技股份有限公司	688712 CH	上海证券交易所	中国内地	1,500	53,880.00	0.00
44	Shenzhen CSL Vacuum Science and Technology Co., Ltd.	深圳市恒运昌真空技术股份有限公司	688785 CH	上海证券交易所	中国内地	116	53,725.40	0.00
45	Xi'an Taijin Xinneng Technology Co., Ltd.	西安泰金新能科技股份有限公司	688813 CH	上海证券交易所	中国内地	234	40,269.06	0.00
46	Wuhan Changjin Photonics Technology Co., Ltd	武汉长进光子技术股份有限公司	688635 CH	上海证券交易所	中国内地	128	39,448.32	0.00
47	Luoyang Shenglong Mining Group Co., Ltd.	洛阳盛龙矿业集团股份有限公司	001257 CH	深圳证券交易所	中国内地	1,743	36,149.82	0.00
48	Jiangxi Redboard Technology Co., Ltd.	江西红板科技股份有限公司	603459 CH	上海证券交易所	中国内地	330	27,825.60	0.00

49	Tianhai Auto Electronics Group Co., Ltd.	天海汽车电子集团股份有限公司	001365 CH	深圳证券交易所	中国内地	719	22,511.89	0.00
50	Grinm Metal Composites (Beijing) Technology Co., Ltd.	有研金属复合材料(北京)股份有限公司	688811 CH	上海证券交易所	中国内地	834	20,124.42	0.00
51	Nanchang Sanrui Intelligence Technology Co., Ltd.	南昌三瑞智能科技股份有限公司	301696 CH	深圳证券交易所	中国内地	216	18,748.80	0.00
52	Ningbo Hicon Industry Technology Co., Ltd.	宁波惠康工业科技股份有限公司	001237 CH	深圳证券交易所	中国内地	285	16,740.90	0.00
53	Hangzhou Gold Electronic Equipment Co., Ltd.	杭州高特电子设备股份有限公司	301669 CH	深圳证券交易所	中国内地	546	15,506.40	0.00
54	Suzhou Xinguangyi Electronics Co., Ltd.	苏州市新广益电子股份有限公司	301687 CH	深圳证券交易所	中国内地	195	15,167.10	0.00
55	Beijing Victory Electric Co., Ltd.	北京维通利电气股份有限公司	001393 CH	深圳证券交易所	中国内地	387	15,089.13	0.00
56	Shandong Chunguang Technology Group Co., Ltd.	山东春光科技集团股份有限公司	301531 CH	深圳证券交易所	中国内地	290	14,952.40	0.00

57	Wuxi Rich Intelligent Equipment Co., Ltd.	无锡理奇智能装备股份有限公司	301599 CH	深圳证券交易所	中国内地	433	14,059.51	0.00
58	Zhejiang Zhenshi New Materials Co., Ltd.	浙江振石新材料股份有限公司	601112 CH	上海证券交易所	中国内地	775	13,632.25	0.00
59	Goode Electronics (Suzhou) Corp., Ltd.	固德电材系统(苏州)股份有限公司	301680 CH	深圳证券交易所	中国内地	117	13,122.72	0.00
60	Guangzhou Huayu New Material Science and Technology Co., Ltd.	广州慧谷新材料科技股份有限公司	301683 CH	深圳证券交易所	中国内地	96	11,689.92	0.00
61	China Resources New Energy Holdings Company Limited	华润新能源控股有限公司	001248 CH	深圳证券交易所	中国内地	1,000	10,110.00	0.00
62	Isvision(Hangzhou) Technology Co., Ltd.	易思维(杭州)科技股份有限公司	688816 CH	上海证券交易所	中国内地	177	10,106.70	0.00
63	Shangshui Smartech Ltd.	深圳市尚水智能股份有限公司	301513 CH	深圳证券交易所	中国内地	138	7,032.48	0.00
64	Zhejiang Yongli Precision Manufacturing Co., Ltd	浙江永励精密制造股份有限公司	920136 CH	北京证券交易所	中国内地	300	5,784.00	0.00
65	Quanzhou Jiadeli	泉州嘉德利电子材	603435 CH	上海证券交易所	中国内地	104	4,857.84	0.00

	Electronic s Material Co., Ltd.	料股份公 司		所				
66	Chongqin g Zhixin Industrial Co., Ltd	重庆至信 实业股份 有限公司	603352 CH	上海证 券交易 所	中国内地	112	2,858.24	0.00
67	Wuhan Jadecchem New Materials Co., Ltd.	武汉吉和 昌新材料 股份有限 公司	920193 CH	北京证 券交易 所	中国内地	300	2,556.00	0.00
68	Wuhu Atech Automoti ve Co., Ltd.	芜湖埃泰 克汽车电 子股份有 限公司	603293 CH	上海证 券交易 所	中国内地	72	2,442.96	0.00
69	Hangzhou Fuen Co., Ltd	杭州福恩 股份有限 公司	001312 CH	深圳证 券交易 所	中国内地	134	2,248.52	0.00
70	Beijing Kmt Technolog y Co., Ltd.	北京康美 特科技股 份有限公 司	920189 CH	北京证 券交易 所	中国内地	200	1,628.00	0.00
71	Anhui Linping Circular Developm ent Co., Ltd.	安徽林平 循环发展 股份有限 公司	603284 CH	上海证 券交易 所	中国内地	46	1,604.02	0.00
72	Shimeng Supply Chain Managem ent Co., Ltd.	世盟供应 链管理股 份有限公 司	001220 CH	深圳证 券交易 所	中国内地	57	1,583.46	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例
----	----------	------	----------	-----------------

				(%)
1	CNOOC Limited	883 HK	645,602,596.73	5.67
2	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	324,883,241.86	2.85
3	Tencent Holdings Limited	700 HK	167,755,162.81	1.47
4	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	136,734,210.45	1.20
5	NAURA Technology Group Co.,Ltd.	002371 CH	129,977,835.75	1.14
6	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co.,Ltd.	600809 CH	100,812,265.86	0.89
7	Petrochina Company Limited	857 HK	96,645,754.65	0.85
8	Eoptolink Technology Inc.,Ltd.	300502 CH	79,842,531.02	0.70
9	Luzhou Laojiao Co.,Ltd	000568 CH	66,995,767.88	0.59
10	Foxconn Industrial Internet Co.,Ltd.	601138 CH	66,833,602.00	0.59
11	Konfoong Materials International Co., Ltd.	300666 CH	53,948,538.00	0.47
12	Sinoma Science & Technology Co.,Ltd.	002080 CH	40,126,788.70	0.35
13	China Jushi Co.,Ltd	600176 CH	32,047,775.76	0.28
14	Gigadevice Semiconductor Inc.	603986 CH	26,939,151.00	0.24
		3986 HK	1,413,615.73	0.01
15	Anji Microelectronics Technology (Shanghai) Co., Ltd.	688019 CH	27,138,406.35	0.24
16	Shannon Semiconductor Technology Co., Ltd.	300475 CH	26,611,385.00	0.23
17	Shengyi Technology Co.,Ltd.	600183 CH	26,454,879.17	0.23
18	Netease, Inc.	9999 HK	26,051,043.46	0.23
19	Nanya New Material Technology Co.,Ltd	688519 CH	24,377,102.21	0.21
20	Busy Ming Group Co., Ltd.	1768 HK	21,961,066.25	0.19

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例
----	----------	------	----------	-------------

				(%)
1	Trip.com Group Limited	9961 HK	779,327,649.17	6.85
2	Tencent Holdings Limited	700 HK	510,042,566.94	4.48
3	Jd Health International Inc.	6618 HK	506,225,439.10	4.45
4	Kweichow Moutai Co.,Ltd.	600519 CH	407,016,771.78	3.58
5	Alibaba Group Holding Limited	9988 HK	406,316,283.18	3.57
6	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd.	388 HK	377,076,819.83	3.31
7	Luzhou Laojiao Co.,Ltd	000568 CH	340,049,858.30	2.99
8	Wuliangye Yibin Co.,Ltd.	000858 CH	317,486,627.93	2.79
9	Shanxi Xinghuacun Fen Wine Factory Co.,Ltd.	600809 CH	312,491,826.80	2.74
10	H World Group Limited	1179 HK	253,713,674.93	2.23
11	Focus Media Information Technology Co., Ltd.	002027 CH	234,849,784.45	2.06
12	PRADA S.p.A.	1913 HK	181,711,393.96	1.60
13	Apt Medical Inc.	688617 CH	160,365,966.78	1.41
14	Shenzhen New Industries Biomedical Engineering Co.,Ltd.	300832 CH	154,724,809.50	1.36
15	Yum China Holdings, Inc.	9987 HK	55,115,517.41	0.48
16	CNOOC Limited	883 HK	18,502,232.81	0.16
17	Tencent Music Entertainment Group	1698 HK	11,757,309.31	0.10
18	SG Micro Corp	3661 HK	3,618,491.27	0.03
19	FS.COM Limited	3355 HK	2,259,947.87	0.02
20	Sj Semiconductor Corporation	688820 CH	2,136,745.56	0.02

注：1.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。

2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	2,261,503,524.84
卖出收入（成交）总额	5,054,261,953.39

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

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

7.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.11.3 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	861,684.76
2	应收清算款	560,015,317.06
3	应收股利	20,695,047.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,809,227.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	588,381,276.79

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,341,053	1,271.00	7,378,020.58	0.43%	1,697,103,626.43	99.57%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	18.91%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,942,978.10	0.1727%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 9 月 10 日）基金份额总额	3,043,094,297.36
本报告期期初基金份额总额	2,144,400,699.04
本报告期基金总申购份额	133,334,441.19
减：本报告期基金总赎回份额	573,253,493.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,704,481,647.01

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2026 年 1 月 5 日发布公告，自 2026 年 1 月 3 日起高松凡先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
CLSA Limited	1	326,017,880.76	4.46%	120,693.19	3.55%	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	57,812,403.35	0.79%	23,124.96	0.68%	-
China Securities (International)	1	347,452.90	0.00%	3,474.53	0.10%	-

Brokerage Company Limited						
国泰海通	2	1,150,303,786.93	15.73%	501,533.99	14.77%	-
Huatai Financial Holding(Hong Kong) Limited	1	29,114,628.33	0.40%	221,041.37	6.51%	-
东吴证券	2	347,208,891.09	4.75%	151,383.18	4.46%	-
Sanford C. Bernstein (H.K.) Limited	1	82,094,109.93	1.12%	65,675.27	1.93%	-
广发证券	1	882,258.95	0.01%	322.03	0.01%	-
汇丰前海	1	599,571,393.93	8.20%	261,413.51	7.70%	-
Jefferies International Limited	1	501,807,718.83	6.86%	501,032.36	14.76%	-
长江证券	2	2,529,116,029.96	34.59%	1,102,695.78	32.48%	-
China Intl Capital Corp HK Secs Ltd	1	507,984,508.47	6.95%	116,404.20	3.43%	-
UBS Securities Asia Limited	1	69,019,919.59	0.94%	44,910.38	1.32%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	1,676,760.72	0.02%	16,767.61	0.49%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	137,077,286.12	1.87%	27,415.46	0.81%	-
Citigroup Global Markets Limited	1	45,942,847.21	0.63%	22,971.43	0.68%	-
Goldman Sachs	1	331,743,057.63	4.54%	66,348.61	1.95%	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	1	420,923.68	0.01%	4,209.24	0.12%	-
JP Morgan Securities Limited	1	578,454,375.22	7.91%	128,162.14	3.77%	-
Morgan Stanley	1	12,424,282.36	0.17%	14,909.14	0.44%	-

& Co. International PLC						
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	1	3,583,500.74	0.05%	716.70	0.02%	-
Bank of America Securities Inc	1	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
China Galaxy International Securities (Hong Kong) Co. Ltd	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易账户，新增交易账户的证券经营机构为 China Galaxy International Securities (Hong Kong) Co. Ltd、China Merchants Securities (HK) Co Ltd、The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，并在该机构开立交易账户。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

1) 交易执行能力。主要指证券经营机构能否对投资指令进行有效地执行，以及能否取得较高质量的成交结果；

2) 研究报告质量。主要指证券经营机构能否提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专题研究报告等；

3) 提供研究服务的质量。主要包括协助安排上市公司调研、研究资料共享、路演服务、日常沟

通交流、接受委托研究的服务质量等方面；

4) 法规监管资讯服务。主要包括境外投资法律规定、交易监管规则、信息披露、个人利益冲突、税收等资讯的提供与培训；

5) 价值贡献。主要是指证券经营机构对公司研究团队、投资团队在业务能力提升上所做的培训服务、对公司投资提升所作出的贡献；

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无重大违规行为等。

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账户的证券经营机构。
- 2) 基金管理人与所选定的证券经营机构办理开立交易账户事宜。

10.7.2 基金租用或者通过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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
CLS A Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China Securities (International)	-	-	-	-	-	-	-	-

Brok erage Com pany Limit ed								
国泰 海通	-	-	-	-	-	-	-	-
Huat ai Finan cial Holdi ng(H ong Kong) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Sanfo rd C. Berns tein (H.K.) Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰 前海	-	-	-	-	-	-	-	-
Jeffer ies Inter natio nal Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Intl Capit	-	-	-	-	-	-	-	-

al Corp HK Secs Ltd								
UBS Secur ities Asia Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Chin a Merc hants Secur ities (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Haito ng Inter natio nal Secur ities Com pany Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigr oup Glob al Mark ets Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Gold man Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-
Guot ai Junan	-	-	-	-	-	-	-	-

Secur ities (Hon g Kong) Limit ed								
JP Morg an Secur ities Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Morg an Stanl ey & Co. Inter natio nal PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
The Hong kong and Shan ghai Bank ing Corp oratio n Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Bank of Amer ica Secur ities Inc	-	-	-	-	-	-	-	-
Credi	-	-	-	-	-	-	-	-

t Suisse (Hong Kong) Limited								
诚通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-
China Galaxy International Securities (Hong Kong) Co. Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-01-22
4	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
5	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-20
6	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-21
7	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
8	关于易方达优质精选混合型证券投资基金 2026 年因香港证券交易所休市及港股通不提供服务暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
9	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 7 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	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（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报	2026-03-31
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-04-22
13	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16

15	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
16	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
17	易方达基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29
18	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23
19	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
20	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26
21	易方达优质精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达中小盘混合型证券投资基金变更注册为易方达优质精选混合型证券投资基金的文件；

2.《易方达优质精选混合型证券投资基金基金合同》；

3.《易方达优质精选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和营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日