

易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基 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：国泰海通证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰海通证券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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末投资目标基金明细	40
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	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股票投资明细	41
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.7 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	54
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	54
7.9 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贵金属投资明细	54
7.10 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	55
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	55

7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.13	投资组合报告附注	55
§ 8	基金份额持有人信息	56
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9	开放式基金份额变动	57
§ 10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
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	58
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
§ 12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录	60
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	易方达中证 1000ETF 联接	
基金主代码	016630	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 1 月 18 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	379,859,457.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 1000ETF 联接 A	易方达中证 1000ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	016630	016631
报告期末下属分级基金的份额总额	178,265,262.47 份	201,594,195.29 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159633
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 28 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 8 月 4 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	国泰海通证券股份有限公司

2.2 基金产品说明

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	本基金为易方达中证 1000ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证 1000ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，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、股指期货和股票期权投资策略、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	中证 1000 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中证 1000ETF

	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中证 1000 指数的表现密切相关。
--	---

2.2.1 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 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，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。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，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	中证 1000 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。

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	国泰海通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	帅芳
	联系电话	020-85102688	021-38677947
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgrxp@tg.gtht.com
客户服务电话		400 881 8088	021-38917599-5
传真		020-38798812	021-50872603
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层	中国（上海）自由贸易试验区 商城路 618 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	上海市静安区新闸路 669 号博 华广场 19 楼
邮政编码		510627；510623；519031	200041

法定代表人	吴欣荣	朱健
-------	-----	----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广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）	
	易方达中证 1000ETF 联接 A	易方达中证 1000ETF 联接 C
本期已实现收益	22,807,894.79	27,995,370.50
本期利润	32,873,815.80	37,906,833.92
加权平均基金份额本期利润	0.1883	0.1652
本期加权平均净值利润率	15.98%	14.17%
本期基金份额净值增长率	16.37%	16.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 1000ETF 联接 A	易方达中证 1000ETF 联接 C
期末可供分配利润	33,175,820.44	35,194,699.44
期末可供分配基金份额利润	0.1861	0.1746
期末基金资产净值	224,171,450.18	250,930,364.39
期末基金份额净值	1.2575	1.2447
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 1000ETF 联接 A	易方达中证 1000ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	25.75%	24.47%

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

易方达中证 1000ETF 联接 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	15.76%	1.51%	14.83%	1.53%	0.93%	-0.02%
过去六个月	16.37%	1.53%	15.23%	1.54%	1.14%	-0.01%
过去一年	39.49%	1.30%	36.53%	1.31%	2.96%	-0.01%
过去三年	33.37%	1.53%	32.22%	1.57%	1.15%	-0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	25.75%	1.45%	32.35%	1.50%	-6.60%	-0.05%

易方达中证 1000ETF 联接 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	15.67%	1.51%	14.83%	1.53%	0.84%	-0.02%
过去六个月	16.20%	1.53%	15.23%	1.54%	0.97%	-0.01%
过去一年	39.07%	1.30%	36.53%	1.31%	2.54%	-0.01%
过去三年	32.18%	1.53%	32.22%	1.57%	-0.04%	-0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	24.47%	1.45%	32.35%	1.50%	-7.88%	-0.05%

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

易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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

（2023 年 1 月 18 日至 2026 年 6 月 30 日）

易方达中证 1000ETF 联接 A



易方达中证 1000ETF 联接 C



§ 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		
刘树荣	本基金的基金经理，易方达深证 100ETF 联接、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	2023-01-18	-	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。
庞亚平	本基金的基金经理，易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF 联接、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 A100ETF（自 2023 年 07 月 11 日至 2026 年 02 月 10 日）、易方达上证科创板成长 ETF（自 2023 年 08 月 23 日至 2026 年 02 月 10	2023-02-15	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管，华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量投资部总监，易方达基金管理有限公司易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达中证光伏产业指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证家电龙头 ETF

日)、易方达上证科创板 100ETF(自 2023 年 11 月 08 日至 2026 年 02 月 10 日)、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达中证 A500ETF 联接、易方达中证 A500ETF、易方达上证科创板综合 ETF 联接、易方达中证数字经济主题 ETF 的基金经理,指数研究发展部总经理、指数投资决策委员会委员				联接发起式、易方达中证港股通互联网 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/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 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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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

本基金为易方达中证 1000ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资于易方达中证 1000ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达中证 1000ETF 跟踪中证 1000 指数，该指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后，规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。

2026 年上半年，全球地缘局势反复扰动能源与大宗商品价格，主要发达经济体货币政策维持偏紧基调，全球复苏节奏分化。国内经济内生修复动力持续积累，上半年国内生产总值同比增长 4.7%，新质生产力相关扶持政策落地见效；中国人民银行实施降准操作，释放长期流动性，推动实体经济综合融资成本稳中有降，信贷资源持续向先进制造、科技创新、普惠小微领域倾斜。产业层面，人工智能、半导体、高端装备等符合产业升级方向的领域持续受到市场关注，细分领域景气度有所提升；假期消费带动服务消费、线下零售修复，中小消费企业盈利边际改善。

2026 年上半年，A 股市场整体维持结构性行情，资金围绕产业升级主线持续轮动，中小盘板块内部分化明显。中证 1000 指数覆盖的专精特新、细分制造、新兴成长标的，整体呈现结构性行情：具备技术壁垒、订单确定性较强的相关产业链标的走势相对稳健；下游需求偏弱的传统细分领域波动幅度相对更大。指数整体波动高于大中盘宽基，一定程度上体现了中小市值企业的成长属性与波动特征。2026 年上半年，中证 800 指数上涨 11.12%，中证 1000 指数上涨 15.99%。

中证 1000 指数具有成份股平均市值较小、行业分布均衡、成份股权重分散、指数波动较大等特点。投资者在进行指数基金投资时应充分了解指数的特点，并选择与自身风险承受能力相匹配的产品。

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。

4.4.2 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 1.2575 元，本报告期份额净值增长率为 16.37%，同期业绩比较基准收益率为 15.23%；C 类基金份额净值为 1.2447 元，本报告期份额净值增长率为 16.20%，同期业绩比较基准收益率为 15.23%。年化跟踪误差 0.75%，在合同约定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，国内经济有望在稳中求进的工作总基调下，延续平稳运行与结构优化的态势。随着宏观政策效应的进一步显现，工业生产特别是装备制造业和高技术产业预计将继续发挥支

撑作用，新质生产力相关产业对经济增长的拉动作用持续增强。消费和投资结构有望继续优化，内需潜力在政策引导和居民收入稳步修复的带动下逐步释放。面对外部环境的不确定性，宏观政策将继续保持灵活性和针对性，财政政策精准发力，稳健的货币政策保持灵活适度、精准有效，为经济运行营造适宜的金融环境。深化供给侧结构性改革、推动科技创新和传统产业转型升级，仍将是推动经济高质量发展的关键动力。

资本市场方面，市场运行的稳定性有望在政策支持和经济基本面改善的共同作用下继续提升。中国人民银行将继续通过灵活适度的货币政策操作维持流动性合理充裕，监管层面持续推进资本市场制度优化，助力提升市场运行效率和投资者信心。在此背景下，市场可能继续呈现结构性行情与板块轮动特征。同时，海外货币政策变化、地缘政治等因素仍可能带来阶段性波动，需持续关注相关风险因素对市场情绪的影响。总体来看，资本市场将更多反映经济结构转型方向，市场参与者需更加注重结构性机会与风险控制的平衡。

行业层面，中小市值企业集中的高端制造、科技创新、细分消费等赛道将持续受益于产业升级与内需修复政策。具备技术壁垒、订单兑现能力较强的专精特新企业盈利增速有望保持领先，而传统周期类细分领域仍需关注下游需求修复节奏。中小盘标的整体弹性较强，需同时关注业绩不及预期与市场风格切换带来的波动风险。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对业绩比较基准的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值程序和技术，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达中证 1000ETF 联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 1000ETF 联接 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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，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、利润分配等情况进行了复核，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的真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为其真实、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：易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	13,147,452.54	22,073,265.01
结算备付金		1,287,238.36	115,321.24

存出保证金		620,731.35	203,138.38
交易性金融资产	6.4.7.2	458,847,464.41	386,851,828.34
其中：股票投资		2,077,578.00	-
基金投资		444,889,790.41	386,851,828.34
债券投资		11,880,096.00	-
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		10,000,000.00	8,415.60
应收股利		-	-
应收申购款		3,619,242.01	3,213,344.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	947,800.62	424,142.60
资产总计		488,469,929.29	412,889,455.28
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		10,000,000.00	-
应付清算款		678,219.14	245,067.35
应付赎回款		2,401,058.87	3,426,635.08
应付管理人报酬		3,331.53	2,913.23
应付托管费		1,110.52	971.06
应付销售服务费		62,143.35	53,201.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		148,319.95	67,319.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	73,931.36	135,832.63
负债合计		13,368,114.72	3,931,940.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	379,859,457.76	380,136,559.10
未分配利润	6.4.7.8	95,242,356.81	28,820,955.71
净资产合计		475,101,814.57	408,957,514.81
负债和净资产总计		488,469,929.29	412,889,455.28

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.2575 元，C 类基金份额净值 1.2447 元；基金份额总额 379,859,457.76 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 178,265,262.47 份，C 类基金份额总额 201,594,195.29 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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		71,311,788.14	45,679,770.90
1.利息收入		167,730.45	248,573.46
其中：存款利息收入	6.4.7.9	167,730.45	248,573.46
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）		51,073,537.96	23,813,538.32
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-12,265.78	-866,727.12
基金投资收益	6.4.7.11	51,073,091.44	24,680,003.92
债券投资收益	6.4.7.12	12,591.65	-
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	-77.75	-
股利收益	6.4.7.15	198.40	261.52
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	19,977,384.43	21,582,873.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	93,135.30	34,786.01
减：二、营业总支出		531,138.42	644,046.63
1. 管理人报酬		19,748.17	23,942.24
2. 托管费		6,582.73	7,980.73
3. 销售服务费		398,118.27	482,387.97
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,400.00	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,400.00	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		42,302.18	67,748.62
8. 其他费用	6.4.7.19	61,987.07	61,987.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,780,649.72	45,035,724.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,780,649.72	45,035,724.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		70,780,649.72	45,035,724.27
----------	--	---------------	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	380,136,559.10	28,820,955.71	408,957,514.81
二、本期期初净资产	380,136,559.10	28,820,955.71	408,957,514.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-277,101.34	66,421,401.10	66,144,299.76
（一）、综合收益总额	-	70,780,649.72	70,780,649.72
（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）	-277,101.34	-4,359,248.62	-4,636,349.96
其中：1.基金申购款	670,953,855.58	109,468,085.51	780,421,941.09
2.基金赎回款	-671,230,956.92	-113,827,334.13	-785,058,291.05
（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	379,859,457.76	95,242,356.81	475,101,814.57
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	753,590,623.18	-121,395,853.01	632,194,770.17
二、本期期初净资产	753,590,623.18	-121,395,853.01	632,194,770.17
三、本期增减变动额（减少以“-”	-226,210,260.97	67,732,221.38	-158,478,039.59

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	45,035,724.27	45,035,724.27
(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)	-226,210,260.97	22,696,497.11	-203,513,763.86
其中: 1.基金申购款	669,859,400.14	-95,233,585.41	574,625,814.73
2.基金赎回款	-896,069,661.11	117,930,082.52	-778,139,578.59
(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	527,380,362.21	-53,663,631.63	473,716,730.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铨

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2022]1898 号《关于准予易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》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《易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2023 年 1 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,109,050,899.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 151,032.69 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，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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 2021 年第 33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。2027 年 12 月 31 日前，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% 的征收率缴纳增值税。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。

2027 年 12 月 31 日前,对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,对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对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,股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司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,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	13,147,452.54
等于：本金	13,141,202.05
加：应计利息	6,250.49
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	13,147,452.54

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		2,027,958.41	-	2,077,578.00	49,619.59
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	11,809,897.00	69,656.00	11,880,096.00	543.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,809,897.00	69,656.00	11,880,096.00	543.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		356,322,205.13	-	444,889,790.41	88,567,585.28
其他		-	-	-	-
合计		370,160,060.54	69,656.00	458,847,464.41	88,617,747.87

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,294,520.00	-	-	-
IM2609	1,670,960.00	-	-	-

IM2612	1,623,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,294,520.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2609	IM2609	1	1,697,000.00	26,040.00
IM2612	IM2612	1	1,643,920.00	20,360.00
合计	-	-	-	46,400.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	46,400.00
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	947,800.62
待摊费用	-
合计	947,800.62

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	193.21
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,751.08
其中：交易所市场	11,751.08

银行间市场	
应付利息	
预提费用	61,987.07
合计	73,931.36

6.4.7.7 实收基金

易方达中证 1000ETF 联接 A

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	185,526,822.49	185,526,822.49
本期申购	140,373,020.67	140,373,020.67
本期赎回（以“-”号填列）	-147,634,580.69	-147,634,580.69
本期末	178,265,262.47	178,265,262.47

易方达中证 1000ETF 联接 C

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	194,609,736.61	194,609,736.61
本期申购	530,580,834.91	530,580,834.91
本期赎回（以“-”号填列）	-523,596,376.23	-523,596,376.23
本期末	201,594,195.29	201,594,195.29

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

易方达中证 1000ETF 联接 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	10,372,172.05	4,586,677.38	14,958,849.43
本期期初	10,372,172.05	4,586,677.38	14,958,849.43
本期利润	22,807,894.79	10,065,921.01	32,873,815.80
本期基金份额交易产生的变动数	-4,246.40	-1,922,231.12	-1,926,477.52

其中：基金申购款	16,886,299.80	8,461,010.85	25,347,310.65
基金赎回款	-16,890,546.20	-10,383,241.97	-27,273,788.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,175,820.44	12,730,367.27	45,906,187.71

易方达中证 1000ETF 联接 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	9,213,366.72	4,648,739.56	13,862,106.28
本期期初	9,213,366.72	4,648,739.56	13,862,106.28
本期利润	27,995,370.50	9,911,463.42	37,906,833.92
本期基金份额交易产生的变动数	-2,014,037.78	-418,733.32	-2,432,771.10
其中：基金申购款	55,432,747.58	28,688,027.28	84,120,774.86
基金赎回款	-57,446,785.36	-29,106,760.60	-86,553,545.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,194,699.44	14,141,469.66	49,336,169.10

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	165,699.83
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	1,580.03
其他	450.59
合计	167,730.45

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	89,534.94
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-101,800.72
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-12,265.78

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	121,314,590.77
减：卖出股票成本总额	121,124,384.11
减：交易费用	100,671.72
买卖股票差价收入	89,534.94

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	215,761,900.00
减：现金支付申购款总额	93,305,279.26
减：申购股票成本总额	122,558,421.46
减：交易费用	-
申购差价收入	-101,800.72

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	286,268,083.61
减：卖出/赎回基金成本总额	234,833,212.04
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	352,140.34
减：交易费用	9,639.79
基金投资收益	51,073,091.44

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	12,591.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	12,591.65

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

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

6.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	-77.75

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	198.40
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	198.40

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	19,930,984.43
——股票投资	49,619.59
——债券投资	543.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	19,880,821.84
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	46,400.00
——权证投资	-
——期货投资	46,400.00
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	19,977,384.43

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	93,135.30
合计	93,135.30

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	2,479.70
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	61,987.07

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
国泰海通证券股份有限公司	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
易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
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

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
国泰海通证券	243,749,111.25	100.00%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰海通证券	11,809,897.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰海通证券	20,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
国泰海通证券	127,780,186.02	100.00%	-	-

6.4.10.1.6 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
国泰海通证券	24,377.99	100.00%	11,751.08	100.00%
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	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
-	-	-	-	-

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.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

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	19,748.17	23,942.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	146,740.59	159,511.62
应支付基金管理人的净管理费	-126,992.42	-135,569.38

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值=前一日基金资产净值-前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计。

基金管理费每日计算，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，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2.对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年1月1日至2026年6月 30日	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	6,582.73	7,980.73

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计。

基金托管费每日计算，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，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证1000ETF联接A	易方达中证1000ETF联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	7,753.77	7,753.77
国泰海通证券	-	231.38	231.38
广发证券	-	3,866.59	3,866.59
易方达财富	-	1,626.78	1,626.78
合计	-	13,478.52	13,478.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证1000ETF联接A	易方达中证1000ETF联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	30,855.89	30,855.89
国泰海通证券	-	2,415.97	2,415.97
广发证券	-	4,734.53	4,734.53
合计	-	38,006.39	38,006.39

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 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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

易方达中证 1000ETF 联接 A

无。

易方达中证 1000ETF 联接 C

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

无。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 118,763,959 份和 121,399,557 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 23.65%和 25.07%。

6.4.11 利润分配情况

易方达中证 1000ETF 联接 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 1000ETF 联接 C

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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 10,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 3 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 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中证 1000ETF 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中证 1000 指数的表现密切相关。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 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	11,880,096.00	0.00
合计	11,880,096.00	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。

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	13,147,452.54	-	-	-	13,147,452.54
结算备付金	1,287,238.36	-	-	-	1,287,238.36
存出保证金	620,731.35	-	-	-	620,731.35
交易性金融资产	11,880,096.00	-	-	446,967,368.41	458,847,464.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	10,000,000.00	10,000,000.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,619,242.01	3,619,242.01
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	947,800.62	947,800.62
资产总计	26,935,518.25	-	-	461,534,411.04	488,469,929.29
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	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应付清算款	-	-	-	678,219.14	678,219.14
应付赎回款	-	-	-	2,401,058.87	2,401,058.87
应付管理人报酬	-	-	-	3,331.53	3,331.53
应付托管费	-	-	-	1,110.52	1,110.52
应付销售服务费	-	-	-	62,143.35	62,143.35
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	148,319.95	148,319.95
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	73,931.36	73,931.36
负债总计	10,000,000.00	-	-	3,368,114.72	13,368,114.72
利率敏感度缺口	16,935,518.25	-	-	458,166,296.32	475,101,814.57
上年度末 2025 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	22,073,265.01	-	-	-	22,073,265.01
结算备付金	115,321.24	-	-	-	115,321.24
存出保证金	203,138.38	-	-	-	203,138.38
交易性金融资产	-	-	-	386,851,828.34	386,851,828.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	8,415.60	8,415.60
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,213,344.11	3,213,344.11
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	424,142.60	424,142.60
资产总计	22,391,724.63	-	-	390,497,730.65	412,889,455.28
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	-	-	-	245,067.35	245,067.35
应付赎回款	-	-	-	3,426,635.08	3,426,635.08
应付管理人报酬	-	-	-	2,913.23	2,913.23
应付托管费	-	-	-	971.06	971.06
应付销售服务费	-	-	-	53,201.63	53,201.63
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	67,319.49	67,319.49
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	135,832.63	135,832.63
负债总计	-	-	-	3,931,940.47	3,931,940.47
利率敏感度缺口	22,391,724.63	-	-	386,565,790.18	408,957,514.81

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

假设	除市场利率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
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	15,384.65	-
	2.市场利率上升 25 个基点	-15,355.48	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于跟踪的目标 ETF、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	2,077,578.00	0.44	-	-
交易性金融资产—基金投资	444,889,790.41	93.64	386,851,828.34	94.59
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	446,967,368.41	94.08	386,851,828.34	94.59

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	23,523,919.10	19,768,986.76
	2.业绩比较基准下降 5%	-23,523,919.10	-19,768,986.76

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	446,967,368.41
第二层次	11,880,096.00
第三层次	-
合计	458,847,464.41

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

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	2,077,578.00	0.43
	其中：股票	2,077,578.00	0.43
2	基金投资	444,889,790.41	91.08
3	固定收益投资	11,880,096.00	2.43
	其中：债券	11,880,096.00	2.43
	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	14,434,690.90	2.96
8	其他各项资产	15,187,773.98	3.11
9	合计	488,469,929.29	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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	易方达中证 1000 交易	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	444,889,790.41	93.64

	型开放式指 数证券投资 基金					
--	----------------------	--	--	--	--	--

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 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	13,943.00	0.00
B	采矿业	39,535.00	0.01
C	制造业	1,481,096.00	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,307.00	0.01
E	建筑业	23,320.00	0.00
F	批发和零售业	64,134.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	16,145.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	247,114.00	0.05
J	金融业	41,250.00	0.01
K	房地产业	11,642.00	0.00
L	租赁和商务服务业	30,249.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	19,753.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,715.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,025.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	9,666.00	0.00
S	综合	4,684.00	0.00
	合计	2,077,578.00	0.44

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	002484	江海股份	300	31,500.00	0.01
2	300672	国科微	100	29,500.00	0.01
3	002428	云南锗业	200	24,036.00	0.01

4	300776	帝尔激光	100	21,496.00	0.00
5	002222	福晶科技	200	18,456.00	0.00
6	000811	冰轮环境	300	16,866.00	0.00
7	300438	鹏辉能源	200	16,570.00	0.00
8	301217	铜冠铜箔	100	16,507.00	0.00
9	002245	蔚蓝锂芯	800	14,968.00	0.00
10	301511	德福科技	100	14,385.00	0.00
11	002456	欧菲光	1,500	14,190.00	0.00
12	300762	上海瀚讯	300	13,695.00	0.00
13	300236	上海新阳	100	13,150.00	0.00
14	300088	长信科技	1,100	12,760.00	0.00
15	300456	赛微电子	300	12,741.00	0.00
16	300398	飞凯材料	200	12,350.00	0.00
17	002636	金安国纪	100	11,997.00	0.00
18	301095	广立微	100	11,805.00	0.00
19	301018	申菱环境	100	11,561.00	0.00
20	300568	星源材质	600	11,232.00	0.00
21	300806	斯迪克	100	11,200.00	0.00
22	002859	洁美科技	100	10,951.00	0.00
23	002149	西部材料	200	10,802.00	0.00
24	002364	中恒电气	200	10,760.00	0.00
25	300655	晶瑞电材	500	10,710.00	0.00
26	001267	汇绿生态	200	10,700.00	0.00
27	300747	锐科激光	200	10,618.00	0.00
28	300602	飞荣达	200	10,240.00	0.00
29	001339	智微智能	100	10,228.00	0.00
30	002497	雅化集团	500	10,185.00	0.00
31	300260	新莱应材	100	10,046.00	0.00
32	002378	章源钨业	300	10,044.00	0.00
33	300083	创世纪	700	9,534.00	0.00
34	300131	英唐智控	500	9,515.00	0.00
35	300811	铂科新材	100	9,489.00	0.00
36	002536	飞龙股份	200	9,436.00	0.00
37	300077	国民技术	300	9,405.00	0.00
38	300342	天银机电	200	9,400.00	0.00
39	001301	尚太科技	100	9,351.00	0.00
40	002617	露笑科技	900	9,261.00	0.00
41	301071	力量钻石	100	9,250.00	0.00
42	300503	昊志机电	100	9,230.00	0.00
43	002290	禾盛新材	100	9,187.00	0.00
44	301550	斯菱智驱	100	9,143.00	0.00
45	000962	东方钨业	100	9,060.00	0.00
46	002192	融捷股份	100	8,940.00	0.00
47	300319	麦捷科技	300	8,889.00	0.00

48	300657	弘信电子	200	8,804.00	0.00
49	002897	意华股份	100	8,798.00	0.00
50	300184	力源信息	500	8,775.00	0.00
51	300726	宏达电子	100	8,457.00	0.00
52	300323	华灿光电	400	8,160.00	0.00
53	002171	楚江新材	600	8,142.00	0.00
54	002716	湖南白银	1,000	8,090.00	0.00
55	300738	奥飞数据	400	8,088.00	0.00
56	002176	江特电机	800	8,008.00	0.00
56	300613	富瀚微	100	8,008.00	0.00
58	300102	乾照光电	300	7,812.00	0.00
59	000766	通化金马	400	7,760.00	0.00
60	002896	中大力德	100	7,638.00	0.00
61	300170	汉得信息	500	7,620.00	0.00
62	002947	恒铭达	100	7,605.00	0.00
63	002747	埃斯顿	200	7,466.00	0.00
64	002317	众生药业	300	7,371.00	0.00
65	002046	国机精工	100	7,365.00	0.00
66	000969	安泰科技	300	7,362.00	0.00
67	002993	奥海科技	100	7,161.00	0.00
68	002405	四维图新	1,100	7,117.00	0.00
69	002326	永太科技	300	7,095.00	0.00
70	300166	东方国信	400	7,084.00	0.00
71	002611	东方精工	400	7,064.00	0.00
72	300085	银之杰	200	6,994.00	0.00
73	000688	国城矿业	200	6,846.00	0.00
74	301171	易点天下	200	6,792.00	0.00
75	300065	海兰信	300	6,693.00	0.00
76	002929	润建股份	100	6,688.00	0.00
77	002506	协鑫集成	2,100	6,678.00	0.00
77	002654	万润科技	300	6,678.00	0.00
79	300303	聚飞光电	600	6,636.00	0.00
80	300199	翰宇药业	300	6,624.00	0.00
81	002015	协鑫能科	400	6,528.00	0.00
82	002354	天娱数科	700	6,510.00	0.00
83	002913	奥士康	100	6,394.00	0.00
84	002151	北斗星通	200	6,350.00	0.00
85	002745	木林森	500	6,275.00	0.00
86	300353	东土科技	300	6,234.00	0.00
87	001287	中电港	200	6,230.00	0.00
88	300821	东岳硅材	300	6,168.00	0.00
89	301297	富乐德	100	6,124.00	0.00
90	300684	中石科技	100	6,100.00	0.00
91	000970	中科三环	400	6,076.00	0.00

92	300593	新雷能	200	6,012.00	0.00
93	002249	大洋电机	800	6,000.00	0.00
94	000681	视觉中国	300	5,982.00	0.00
95	300409	道氏技术	300	5,979.00	0.00
96	002237	恒邦股份	400	5,876.00	0.00
97	002895	川恒股份	200	5,840.00	0.00
98	002396	星网锐捷	300	5,751.00	0.00
99	300257	开山股份	200	5,736.00	0.00
100	002338	奥普光电	100	5,720.00	0.00
101	002139	拓邦股份	600	5,712.00	0.00
102	000875	电投绿能	1,100	5,665.00	0.00
103	002145	钛能化学	1,200	5,652.00	0.00
104	000422	湖北宜化	400	5,620.00	0.00
105	000620	盈新发展	1,600	5,600.00	0.00
105	300296	利亚德	1,000	5,600.00	0.00
107	002979	雷赛智能	100	5,578.00	0.00
108	002958	青农商行	2,000	5,480.00	0.00
108	301219	腾远钴业	100	5,480.00	0.00
110	000534	万泽股份	200	5,472.00	0.00
111	002254	泰和新材	300	5,457.00	0.00
112	300459	汤姆猫	1,600	5,424.00	0.00
113	301029	怡合达	200	5,402.00	0.00
114	300253	卫宁健康	800	5,384.00	0.00
115	002518	科士达	100	5,359.00	0.00
116	000762	西藏矿业	200	5,340.00	0.00
117	002389	航天彩虹	300	5,331.00	0.00
118	300777	中简科技	200	5,256.00	0.00
119	002768	国恩股份	100	5,206.00	0.00
120	300624	万兴科技	100	5,187.00	0.00
121	300576	容大感光	100	5,122.00	0.00
122	002965	祥鑫科技	100	5,095.00	0.00
123	000682	东方电子	400	5,052.00	0.00
124	002400	省广集团	800	5,048.00	0.00
125	002174	游族网络	400	5,044.00	0.00
126	000686	东北证券	600	5,040.00	0.00
126	300322	硕贝德	200	5,040.00	0.00
128	300779	惠城环保	100	5,020.00	0.00
129	001896	豫能控股	300	4,983.00	0.00
130	002815	崇达技术	300	4,977.00	0.00
131	300693	盛弘股份	100	4,875.00	0.00
132	002545	东方铁塔	300	4,866.00	0.00
133	300008	天海防务	800	4,848.00	0.00
134	301293	三博脑科	100	4,818.00	0.00
135	000628	高新发展	100	4,740.00	0.00

136	000672	上峰材料	200	4,736.00	0.00
137	000690	宝新能源	1,000	4,700.00	0.00
138	000833	粤桂股份	200	4,684.00	0.00
139	300315	掌趣科技	1,200	4,680.00	0.00
140	002182	宝武镁业	300	4,671.00	0.00
141	301035	润丰股份	100	4,640.00	0.00
142	002048	宁波华翔	200	4,600.00	0.00
143	301216	万凯新材	200	4,598.00	0.00
144	300773	拉卡拉	300	4,590.00	0.00
145	002948	青岛银行	900	4,572.00	0.00
146	002539	云图控股	400	4,528.00	0.00
147	300674	宇信科技	300	4,515.00	0.00
148	301275	汉朔科技	100	4,490.00	0.00
149	002807	江阴银行	1,200	4,452.00	0.00
150	000029	深深房 A	200	4,410.00	0.00
151	300775	三角防务	200	4,408.00	0.00
152	002468	申通快递	300	4,368.00	0.00
153	002706	良信股份	400	4,364.00	0.00
154	300035	中科电气	300	4,326.00	0.00
155	002507	涪陵榨菜	400	4,320.00	0.00
156	300455	航天智装	200	4,308.00	0.00
157	000973	佛塑科技	300	4,305.00	0.00
158	300182	捷成股份	900	4,275.00	0.00
159	002183	怡亚通	800	4,264.00	0.00
160	300133	华策影视	600	4,248.00	0.00
161	000612	焦作万方	400	4,236.00	0.00
162	300181	佐力药业	300	4,230.00	0.00
163	300457	赢合科技	200	4,216.00	0.00
164	002549	凯美特气	200	4,210.00	0.00
165	300130	新国都	200	4,208.00	0.00
166	300468	四方精创	200	4,202.00	0.00
167	002643	万润股份	200	4,190.00	0.00
168	002639	雪人集团	300	4,173.00	0.00
169	300229	拓尔思	300	4,146.00	0.00
170	301127	武汉天源	200	4,144.00	0.00
171	002832	比音勒芬	200	4,128.00	0.00
172	300607	拓斯达	100	4,123.00	0.00
173	002250	联化科技	300	4,101.00	0.00
174	301263	泰恩康	200	4,098.00	0.00
175	002498	汉缆股份	600	4,092.00	0.00
176	000778	新兴铸管	1,100	4,081.00	0.00
177	300416	苏试试验	200	4,076.00	0.00
177	300573	兴齐眼药	100	4,076.00	0.00
179	002276	万马股份	400	4,044.00	0.00

180	000680	山推股份	400	4,020.00	0.00
181	000917	电广传媒	600	4,014.00	0.00
182	000810	创维数字	300	3,975.00	0.00
183	000758	中色股份	600	3,942.00	0.00
184	301316	慧博云通	100	3,938.00	0.00
185	300009	安科生物	500	3,925.00	0.00
186	002597	金禾实业	200	3,920.00	0.00
187	002023	海特高新	300	3,888.00	0.00
187	300049	福瑞医科	100	3,888.00	0.00
189	000801	四川九洲	300	3,882.00	0.00
190	002268	电科网安	300	3,870.00	0.00
191	000563	陕国投 A	1,400	3,864.00	0.00
192	002077	大港股份	200	3,858.00	0.00
193	000767	晋控电力	1,000	3,830.00	0.00
194	300185	通裕重工	1,400	3,822.00	0.00
195	300007	汉威科技	100	3,820.00	0.00
196	000543	皖能电力	500	3,785.00	0.00
196	002036	联创电子	500	3,785.00	0.00
198	000998	隆平高科	500	3,770.00	0.00
198	002270	华明装备	200	3,770.00	0.00
200	002675	东诚药业	300	3,765.00	0.00
201	300244	迪安诊断	200	3,748.00	0.00
202	002020	京新药业	300	3,747.00	0.00
203	300723	一品红	100	3,728.00	0.00
204	002158	汉钟精机	100	3,708.00	0.00
205	300638	广和通	200	3,702.00	0.00
206	300098	高新兴	800	3,672.00	0.00
207	001337	四川黄金	100	3,666.00	0.00
208	300725	药石科技	100	3,660.00	0.00
209	000420	吉林化纤	900	3,645.00	0.00
210	002544	普天科技	200	3,644.00	0.00
210	002881	美格智能	100	3,644.00	0.00
212	300113	顺网科技	200	3,642.00	0.00
213	002936	郑州银行	2,200	3,630.00	0.00
214	002324	普利特	300	3,621.00	0.00
214	002698	博实股份	300	3,621.00	0.00
216	300378	鼎捷数智	100	3,610.00	0.00
217	001227	兰州银行	1,800	3,600.00	0.00
218	301291	明阳电气	100	3,599.00	0.00
219	002373	千方科技	500	3,590.00	0.00
220	002681	奋达科技	800	3,576.00	0.00
221	002063	远光软件	700	3,570.00	0.00
221	300618	寒锐钴业	100	3,570.00	0.00
223	002488	金固股份	400	3,564.00	0.00

224	000901	航天科技	200	3,558.00	0.00
225	300348	长亮科技	400	3,520.00	0.00
226	000506	招金黄金	300	3,516.00	0.00
227	002839	张家港行	900	3,510.00	0.00
228	000902	新洋丰	300	3,468.00	0.00
229	002541	鸿路钢构	200	3,464.00	0.00
230	300045	华力创通	200	3,448.00	0.00
231	300034	钢研高纳	200	3,428.00	0.00
232	002701	奥瑞金	800	3,408.00	0.00
233	000581	威孚高科	200	3,404.00	0.00
234	300601	康泰生物	300	3,402.00	0.00
235	000035	中国天楹	700	3,381.00	0.00
236	002531	天顺风能	400	3,372.00	0.00
237	300446	航天智造	200	3,366.00	0.00
238	000685	中山公用	300	3,348.00	0.00
239	301050	雷电微力	100	3,344.00	0.00
240	000837	秦川机床	300	3,333.00	0.00
241	300761	立华股份	200	3,282.00	0.00
242	002922	伊戈尔	100	3,280.00	0.00
243	000727	冠捷科技	1,200	3,276.00	0.00
244	002170	芭田股份	300	3,258.00	0.00
245	300101	振芯科技	200	3,234.00	0.00
246	002332	仙琚制药	400	3,224.00	0.00
247	002239	奥特佳	1,300	3,211.00	0.00
248	300327	中颖电子	100	3,205.00	0.00
249	301510	固高科技	100	3,193.00	0.00
250	300070	碧水源	1,000	3,190.00	0.00
251	002011	盾安环境	300	3,183.00	0.00
252	300872	天阳科技	200	3,160.00	0.00
253	002100	天康生物	500	3,155.00	0.00
254	300770	新媒股份	100	3,149.00	0.00
255	300855	图南股份	100	3,126.00	0.00
256	000829	天音控股	400	3,120.00	0.00
257	002458	益生股份	400	3,108.00	0.00
258	300687	赛意信息	100	3,100.00	0.00
259	000012	南玻 A	600	3,096.00	0.00
260	002104	恒宝股份	300	3,093.00	0.00
261	000555	神州信息	300	3,090.00	0.00
262	300529	健帆生物	200	3,080.00	0.00
263	300827	上能电气	100	3,079.00	0.00
264	002838	道恩股份	100	3,062.00	0.00
265	000791	甘肃能源	400	3,040.00	0.00
266	002081	金螳螂	700	3,031.00	0.00
267	000089	深圳机场	500	3,015.00	0.00

268	002212	天融信	500	2,990.00	0.00
269	300493	润欣科技	200	2,982.00	0.00
270	300682	朗新科技	300	2,970.00	0.00
271	300925	法本信息	200	2,958.00	0.00
272	000065	北方国际	300	2,949.00	0.00
273	002006	精工科技	200	2,942.00	0.00
274	002017	东信和平	200	2,926.00	0.00
275	000099	中信海直	200	2,912.00	0.00
276	002091	江苏国泰	400	2,892.00	0.00
277	002123	梦网科技	400	2,876.00	0.00
278	300276	三丰智能	400	2,868.00	0.00
279	002690	美亚光电	200	2,866.00	0.00
280	300031	宝通科技	100	2,857.00	0.00
281	300598	诚迈科技	100	2,840.00	0.00
282	002408	齐翔腾达	600	2,814.00	0.00
283	002019	亿帆医药	300	2,805.00	0.00
284	300910	瑞丰新材	100	2,804.00	0.00
285	002368	太极股份	200	2,798.00	0.00
286	300127	银河磁体	100	2,795.00	0.00
287	002233	塔牌集团	400	2,788.00	0.00
288	300660	江苏雷利	100	2,786.00	0.00
289	002985	北摩高科	100	2,770.00	0.00
290	002004	华邦健康	700	2,751.00	0.00
290	002345	潮宏基	300	2,751.00	0.00
292	002125	湘潭电化	200	2,732.00	0.00
293	002121	科陆电子	500	2,725.00	0.00
294	002755	奥赛康	200	2,724.00	0.00
295	002075	沙钢股份	800	2,720.00	0.00
296	300809	华辰装备	100	2,705.00	0.00
297	002251	步步高	800	2,704.00	0.00
297	301078	孩子王	400	2,704.00	0.00
299	002226	江南化工	600	2,694.00	0.00
300	002416	爱施德	300	2,688.00	0.00
301	002010	传化智联	600	2,682.00	0.00
302	300850	新强联	100	2,680.00	0.00
303	002891	中宠股份	100	2,672.00	0.00
304	300224	正海磁材	200	2,666.00	0.00
305	300047	天源迪科	300	2,664.00	0.00
306	000712	锦龙股份	300	2,658.00	0.00
307	002099	海翔药业	500	2,640.00	0.00
308	000403	派林生物	300	2,637.00	0.00
309	000600	建投能源	300	2,625.00	0.00
310	002292	奥飞娱乐	400	2,624.00	0.00
311	301522	上大股份	100	2,617.00	0.00

312	300026	红日药业	900	2,610.00	0.00
313	000935	四川双马	100	2,609.00	0.00
314	301500	飞南资源	100	2,605.00	0.00
315	000795	英洛华	300	2,595.00	0.00
316	002073	软控股份	500	2,570.00	0.00
317	002978	安宁股份	100	2,563.00	0.00
318	300376	易事特	500	2,560.00	0.00
319	000650	仁和药业	500	2,545.00	0.00
320	002258	利尔化学	200	2,542.00	0.00
321	002960	青鸟智控	300	2,541.00	0.00
322	002003	伟星股份	300	2,526.00	0.00
323	000156	华数传媒	400	2,524.00	0.00
324	300861	美畅股份	100	2,519.00	0.00
325	002163	海南发展	300	2,502.00	0.00
326	000927	中国铁物	1,100	2,497.00	0.00
327	002906	华阳集团	100	2,496.00	0.00
328	002550	千红制药	400	2,484.00	0.00
329	000923	河钢资源	200	2,482.00	0.00
330	002215	诺普信	300	2,469.00	0.00
331	002925	盈趣科技	100	2,466.00	0.00
332	300772	运达股份	200	2,460.00	0.00
333	002372	伟星新材	300	2,457.00	0.00
334	000990	诚志股份	300	2,454.00	0.00
335	301238	瑞泰新材	100	2,440.00	0.00
336	003010	若羽臣	100	2,430.00	0.00
337	002827	高争民爆	100	2,414.00	0.00
338	002588	史丹利	300	2,370.00	0.00
339	000966	长源电力	600	2,352.00	0.00
340	300360	炬华科技	200	2,350.00	0.00
341	000049	德赛电池	100	2,337.00	0.00
342	300337	银邦股份	200	2,332.00	0.00
342	300357	我武生物	100	2,332.00	0.00
344	002315	焦点科技	100	2,328.00	0.00
345	002216	三全食品	200	2,306.00	0.00
346	000880	潍柴重机	100	2,301.00	0.00
347	301565	中仑新材	100	2,279.00	0.00
348	300680	隆盛科技	100	2,272.00	0.00
349	002051	中工国际	200	2,264.00	0.00
350	300153	科泰电源	100	2,262.00	0.00
351	300036	超图软件	200	2,254.00	0.00
352	000061	农产品	400	2,240.00	0.00
352	000552	甘肃能化	1,000	2,240.00	0.00
352	300678	中科信息	100	2,240.00	0.00
355	300525	博思软件	300	2,232.00	0.00

356	002867	周大生	200	2,230.00	0.00
357	000848	承德露露	300	2,220.00	0.00
358	002043	兔宝宝	200	2,216.00	0.00
358	002668	TCL 智家	200	2,216.00	0.00
360	300171	东富龙	200	2,212.00	0.00
361	000048	京基智农	100	2,209.00	0.00
362	002127	南极电商	800	2,192.00	0.00
363	002572	索菲亚	300	2,190.00	0.00
364	002097	山河智能	300	2,169.00	0.00
365	300443	金雷股份	100	2,158.00	0.00
366	002537	海联金汇	400	2,116.00	0.00
367	301039	中集车辆	300	2,115.00	0.00
368	002204	大连重工	400	2,112.00	0.00
369	300595	欧普康视	200	2,106.00	0.00
370	002221	东华能源	400	2,104.00	0.00
371	002928	华夏航空	300	2,097.00	0.00
372	300579	数字认证	100	2,070.00	0.00
373	002635	安洁科技	100	2,045.00	0.00
374	000676	智度股份	400	2,044.00	0.00
374	300075	数字政通	200	2,044.00	0.00
376	002563	森马服饰	400	2,016.00	0.00
376	300702	天宇股份	100	2,016.00	0.00
378	300580	贝斯特	100	2,011.00	0.00
379	000950	重药控股	400	2,004.00	0.00
380	002511	中顺洁柔	300	1,995.00	0.00
381	000928	中钢国际	400	1,992.00	0.00
382	300415	伊之密	100	1,991.00	0.00
383	002181	粤传媒	200	1,990.00	0.00
384	002761	浙江建投	300	1,989.00	0.00
385	002061	浙江交科	600	1,980.00	0.00
386	301551	无线传媒	100	1,973.00	0.00
387	002243	力合科创	300	1,971.00	0.00
388	300180	华峰超纤	500	1,970.00	0.00
389	000860	顺鑫农业	200	1,960.00	0.00
389	002194	武汉凡谷	200	1,960.00	0.00
391	002961	瑞达期货	100	1,958.00	0.00
392	300634	彩讯股份	100	1,957.00	0.00
393	002987	京北方	200	1,946.00	0.00
394	002727	一心堂	200	1,918.00	0.00
395	301487	盟固利	100	1,915.00	0.00
396	301015	百洋医药	100	1,906.00	0.00
397	000028	国药一致	100	1,891.00	0.00
398	002882	金龙羽	100	1,889.00	0.00
399	002941	新疆交建	200	1,888.00	0.00

400	002287	奇正藏药	100	1,884.00	0.00
401	002320	海峡股份	300	1,881.00	0.00
402	002246	北化股份	100	1,880.00	0.00
403	000828	东莞控股	200	1,872.00	0.00
404	300188	国投智能	200	1,870.00	0.00
405	002534	西子洁能	100	1,855.00	0.00
406	000503	国新健康	300	1,845.00	0.00
407	301381	赛维时代	100	1,844.00	0.00
408	300633	开立医疗	100	1,839.00	0.00
409	301363	美好医疗	100	1,833.00	0.00
410	002605	姚记科技	100	1,827.00	0.00
411	000813	德展健康	600	1,818.00	0.00
411	002351	漫步者	200	1,818.00	0.00
411	300428	立中集团	100	1,818.00	0.00
414	002892	科力尔	200	1,816.00	0.00
415	002434	万里扬	300	1,815.00	0.00
416	002967	广电计量	100	1,805.00	0.00
417	301262	海看股份	100	1,797.00	0.00
418	002557	洽洽食品	100	1,796.00	0.00
419	000567	海德股份	300	1,791.00	0.00
420	300926	博俊科技	100	1,775.00	0.00
421	002096	易普力	200	1,756.00	0.00
422	300134	大富科技	200	1,710.00	0.00
423	000930	中粮科技	400	1,700.00	0.00
424	300685	艾德生物	100	1,684.00	0.00
425	002516	旷达科技	300	1,674.00	0.00
426	300482	万孚生物	100	1,661.00	0.00
427	001914	招商积余	200	1,632.00	0.00
428	301153	中科江南	100	1,629.00	0.00
428	301207	华兰疫苗	100	1,629.00	0.00
430	300363	博腾股份	100	1,624.00	0.00
431	000550	江铃汽车	100	1,622.00	0.00
432	300783	三只松鼠	100	1,580.00	0.00
433	002041	登海种业	200	1,574.00	0.00
434	002045	国光电器	200	1,570.00	0.00
435	301091	深城交	100	1,550.00	0.00
436	300641	正丹股份	100	1,538.00	0.00
437	002060	广东建工	500	1,515.00	0.00
438	300080	易成新能	400	1,504.00	0.00
439	000059	华锦股份	400	1,500.00	0.00
439	300284	苏交科	300	1,500.00	0.00
441	301175	中科环保	300	1,485.00	0.00
442	301267	华夏眼科	100	1,459.00	0.00
443	002840	华统股份	200	1,458.00	0.00

444	003006	百亚股份	100	1,451.00	0.00
445	300119	瑞普生物	100	1,443.00	0.00
446	002110	三钢闽光	500	1,440.00	0.00
447	300294	博雅生物	100	1,424.00	0.00
448	000498	山东路桥	300	1,419.00	0.00
449	002946	新乳业	100	1,408.00	0.00
450	301268	铭利达	100	1,398.00	0.00
451	300298	三诺生物	100	1,395.00	0.00
452	300768	迪普科技	100	1,377.00	0.00
453	001369	双欣材料	100	1,352.00	0.00
454	300341	麦克奥迪	100	1,325.00	0.00
455	002626	金达威	100	1,318.00	0.00
456	002267	陕天然气	200	1,308.00	0.00
457	002093	国脉科技	200	1,260.00	0.00
458	301109	军信股份	100	1,246.00	0.00
459	000885	城发环境	100	1,203.00	0.00
460	000719	中原传媒	100	1,143.00	0.00
461	002737	葵花药业	100	1,121.00	0.00
462	002705	新宝股份	100	1,108.00	0.00
463	003039	顺控发展	100	1,101.00	0.00
464	301215	中汽股份	200	1,038.00	0.00
465	000913	钱江摩托	100	1,025.00	0.00
466	301339	通行宝	100	1,023.00	0.00
467	002053	云南能投	100	983.00	0.00
468	000899	赣能股份	100	966.00	0.00
469	002101	广东鸿图	100	954.00	0.00
470	002911	佛燃能源	100	949.00	0.00
471	000030	富奥股份	200	774.00	0.00
472	002651	利君股份	100	731.00	0.00
473	001236	弘业期货	100	695.00	0.00
474	000058	深赛格	100	614.00	0.00

7.5 报告期内股票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	001309	德明利	2,199,757.00	0.54
2	300620	光库科技	1,183,144.00	0.29
3	300548	长芯博创	1,125,967.00	0.28
4	300672	国科微	1,035,012.22	0.25
5	300475	香农芯创	967,362.00	0.24
6	002222	福晶科技	958,061.00	0.23

7	002456	欧菲光	852,039.00	0.21
8	002487	大金重工	841,390.00	0.21
9	300666	江丰电子	800,827.00	0.20
10	002497	雅化集团	780,059.00	0.19
11	300762	上海瀚讯	779,562.00	0.19
12	300456	赛微电子	636,600.00	0.16
13	002428	云南锗业	634,163.00	0.16
14	300102	乾照光电	633,427.00	0.15
15	002405	四维图新	617,618.00	0.15
16	002245	蔚蓝锂芯	613,461.00	0.15
17	300779	惠城环保	597,572.00	0.15
18	000766	通化金马	592,663.00	0.14
19	300776	帝尔激光	592,145.00	0.14
20	300568	星源材质	572,142.00	0.14

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

7.5.2 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	001309	德明利	2,384,772.00	0.58
2	300620	光库科技	1,179,611.00	0.29
3	300672	国科微	1,164,996.00	0.28
4	300548	长芯博创	1,115,067.00	0.27
5	002222	福晶科技	997,547.00	0.24
6	300475	香农芯创	947,041.00	0.23
7	300666	江丰电子	843,858.00	0.21
8	002456	欧菲光	819,278.00	0.20
9	002487	大金重工	801,462.00	0.20
10	002497	雅化集团	769,738.00	0.19
11	002428	云南锗业	746,615.00	0.18
12	300762	上海瀚讯	731,190.00	0.18
13	002245	蔚蓝锂芯	657,732.00	0.16
14	300776	帝尔激光	642,086.00	0.16
15	300456	赛微电子	627,565.00	0.15
16	002484	江海股份	590,015.00	0.14
17	002716	湖南白银	585,422.00	0.14
18	002405	四维图新	585,122.00	0.14
19	000766	通化金马	573,770.00	0.14
20	300568	星源材质	571,574.00	0.14

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

7.5.3 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	122,446,625.98
卖出股票收入（成交）总额	121,314,590.77

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

7.6 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	11,880,096.00	2.50
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	11,880,096.00	2.50

7.7 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	019827	26 国债 01	109,000	10,970,652.90	2.31
2	102317	国债 2519	9,000	909,443.10	0.19

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。本基金在出现大额净申赎等需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，上海剑桥科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国龙吴海关的处罚。

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。

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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	620,731.35
2	应收清算款	10,000,000.00
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	3,619,242.01
6	其他应收款	947,800.62
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,187,773.98

7.13.4 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。

7.13.5 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

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
易方达中证 1000ETF 联接 A	7,772	22,936.86	11,522,813.27	6.46%	166,742,449.20	93.54%
易方达中证 1000ETF 联接 C	16,111	12,512.83	21,549,368.82	10.69%	180,044,826.47	89.31%
合计	23,883	15,905.01	33,072,182.09	8.71%	346,787,275.67	91.29%

8.2 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	易方达中证 1000ETF 联接 A	131,478.74	0.0738%
	易方达中证 1000ETF 联接 C	12,628.34	0.0063%
	合计	144,107.08	0.0379%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	易方达中证 1000ETF 联接 A	10~50
	易方达中证 1000ETF 联接 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证 1000ETF 联接 A	10~50
	易方达中证 1000ETF 联接 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 1000ETF 联接 A	易方达中证 1000ETF 联接 C
基金合同生效日（2023 年 1 月 18 日）基金份额总额	416,909,851.98	692,141,047.83
本报告期期初基金份额总额	185,526,822.49	194,609,736.61
本报告期基金总申购份额	140,373,020.67	530,580,834.91
减：本报告期基金总赎回份额	147,634,580.69	523,596,376.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	178,265,262.47	201,594,195.29

§ 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，本基金托管人无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无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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	3	243,749,111.25	100.00%	24,377.99	100.00%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为中信证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

- 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
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	11,809,897.00	100.00%	20,000,000.00	100.00%	-	-	127,780,186.02	100.00%
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、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	证券日报、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	证券日报	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	证券日报、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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
6	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
7	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	证券日报	2026-03-31
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第	证券日报	2026-04-22

	1 季度报告提示性公告		
9	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
10	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
11	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
12	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29
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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23

§ 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证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 1000 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。

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