

易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	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	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	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的真实、准确和完整发表意见	13
§ 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	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	68
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	68
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	68
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69

7.12 投资组合报告附注	69
§ 8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§ 9 开放式基金份额变动	70
§ 10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
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	72
10.8 其他重大事件	73
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	75
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	75
§ 12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	易方达中证 A500 量化增强	
基金主代码	026093	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 4 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	167,736,223.72 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 A500 量化增强 A	易方达中证 A500 量化增强 C
下属分级基金的交易代码	026093	026094
报告期末下属分级基金的份额总额	112,413,925.40 份	55,322,298.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.5%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。股票投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报，在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优选股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行。债券投资方面,本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资管理。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权，并可参与转融通证券出借业务、融资业务。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交

	易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。
--	----------------------

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 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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 A500 量化增 强 A	易方达中证 A500 量化增 强 C

本期已实现收益	21,798,351.61	6,429,989.94
本期利润	27,581,513.39	8,031,783.73
加权平均基金份额本期利润	0.1578	0.1462
本期加权平均净值利润率	14.81%	13.68%
本期基金份额净值增长率	14.44%	14.21%
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 A500 量化增强 A	易方达中证 A500 量化增强 C
期末可供分配利润	13,104,211.61	6,306,954.78
期末可供分配基金份额利润	0.1166	0.1140
期末基金资产净值	129,916,691.72	63,789,604.70
期末基金份额净值	1.1557	1.1531
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 A500 量化增强 A	易方达中证 A500 量化增强 C
基金份额累计净值增长率	15.57%	15.31%

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 A500 量化增强 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	15.16%	1.26%	13.54%	1.34%	1.62%	-0.08%
过去六个月	14.44%	1.17%	11.34%	1.22%	3.10%	-0.05%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.57%	1.08%	15.28%	1.16%	0.29%	-0.08%

易方达中证 A500 量化增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	15.05%	1.26%	13.54%	1.34%	1.51%	-0.08%
过去六个月	14.21%	1.17%	11.34%	1.22%	2.87%	-0.05%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.31%	1.08%	15.28%	1.16%	0.03%	-0.08%

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 A500 指数量化增强型证券投资基金
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
(2025 年 12 月 4 日至 2026 年 6 月 30 日)

易方达中证 A500 量化增强 A



易方达中证 A500 量化增强 C



注：1.本基金合同于 2025 年 12 月 4 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
官泽帆	本基金的基金经理, 易方达中证 500 量化增强、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证港股通综合量	2025-12-04	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商基金管理有限公司投资开发工程师，摩根士丹利华鑫基金管理有

	化增强的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员				限公司数量化研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司量化研究员、投资经理、基金经理助理，易方达沪深 300 量化增强、易方达量化策略精选混合、易方达易百智能量化策略混合的基金经理。
黄浩东	本基金的基金经理，易方达量化策略精选混合、易方达中证 A500 增强策略 ETF 的基金经理	2025-12-04	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司量化研究员。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

回顾 2026 年上半年，国内宏观经济整体呈现“前高后稳、总量平稳、结构分化”的运行特征。一

季度经济实现开门红，内外需求一度同步改善，政策持续发力托底，人工智能、高端制造等新动能投资保持高增；二季度部分指标环比动能有所放缓，社融与信贷、消费与固定资产投资仍承压，房地产投资持续拖累，但高技术制造业和装备制造业景气相对占优，出口维持较高景气，外需韧性支撑增长。宏观政策上，上半年财政与货币协同托底，下半年财政政策有望加快支出节奏，货币政策在外部约束下更多依赖结构性工具。

从市场表现来看，2026 年上半年宽基指数整体上行、内部分化显著，成长风格大幅占优。其中上证指数收益率约为 3.16%，沪深 300 指数收益率约为 7.55%，中证 2000 指数收益率约为 9.10%，创业板指收益率约为 35.58%，中证 A500 指数收益率约为 11.91%。一季度市场受外部扰动波动加大，小盘相对占优；二季度成长风格显著领涨。

在投资策略上，我们使用多策略的方式来增强中证 A500 指数，致力于创造出相对中证 A500 指数适当稳健的超额收益。上半年，我们持续推动底层策略多元化，兼顾策略波动与超额水平，配置长期预期收益较高、波动适中的策略以实现分散化；二季度对模型进行迭代，纳入部分另类量化策略，使阿尔法来源更加多元。在平衡超额与跟踪误差时，我们力求在跟踪误差适中的前提下创造超额，持续提升长期预期超额与信息比率。展望未来，本基金将继续坚持模型驱动的投资理念，持续迭代投资模型，力争创造出稳健的超额收益。

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 1.1557 元，本报告期份额净值增长率为 14.44%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；C 类基金份额净值为 1.1531 元，本报告期份额净值增长率为 14.21%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。年化跟踪误差 2.21%，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

展望下半年，国内宏观经济有望在总量平稳、结构继续分化的背景下延续“稳中向新、质效优先”的运行特征。上半年经济增量仍具韧性，但季度间动能有所起伏，出口与高技术制造、装备制造等新质生产力相关领域景气相对占优，消费与部分传统投资链条仍承压；价格整体温和、上下游传导并不均匀。宏观政策预计更多以抓落实、重结构为主，增量政策可期但不宜期待强刺激式总量宽松，财政政策有望加快重点项目形成实物工作量，货币政策在内外约束下更倚重结构性工具。综合看，经济有望温和修复，全年目标实现仍具备基础，内生需求斜率与外部环境变化仍是关键跟踪变量。对于证券市场来说，上半年已充分演绎结构强于总量、成长显著占优的特征，资金向硬科技与人工智能等高景气主线集中。展望下半年，市场大概率延续结构性行情，呈现“新兴动能景气兑现与阶段性拥挤再平衡并存”的特征。

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 A500 量化增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 A500 量化增强 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金（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的真实、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：易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

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	17,074,029.71	110,497,153.36
结算备付金		824,176.69	10,000,000.00
存出保证金		198,865.36	-
交易性金融资产	6.4.7.2	175,601,033.96	382,105,187.95
其中：股票投资		175,592,033.57	382,105,187.95
基金投资		-	-
债券投资		9,000.39	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,322,607.66	5,593,516.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		199,020,713.38	508,195,858.04
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		3,903,379.88	27,004,763.33
应付赎回款		1,113,306.61	14,992,822.01
应付管理人报酬		119,511.28	279,530.25
应付托管费		14,938.93	34,941.26
应付销售服务费		17,481.19	24,619.75
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	145,799.07	44,123.88
负债合计		5,314,416.96	42,380,800.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	167,736,223.72	461,267,777.00
未分配利润	6.4.7.8	25,970,072.70	4,547,280.56
净资产合计		193,706,296.42	465,815,057.56
负债和净资产总计		199,020,713.38	508,195,858.04

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 12 月 4 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 12 月 4 日至 2025 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1557 元，C 类基金份额净值 1.1531 元；基金份额总额 167,736,223.72 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 112,413,925.40 份，C 类基金份额总额 55,322,298.32 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

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
一、营业总收入		36,925,460.87
1.利息收入		39,526.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	39,526.32
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）		29,430,600.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	27,780,641.47
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	0.39
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-

贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	1,649,958.86
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	7,384,955.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	70,378.26
减：二、营业总支出		1,312,163.75
1. 管理人报酬		985,413.25
2. 托管费		123,176.65
3. 销售服务费		117,185.83
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	86,388.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,613,297.12
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,613,297.12
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		35,613,297.12

注：本基金合同生效日为 2025 年 12 月 4 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金

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	461,267,777.00	4,547,280.56	465,815,057.56
二、本期期初净资产	461,267,777.00	4,547,280.56	465,815,057.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-293,531,553.28	21,422,792.14	-272,108,761.14

(一)、综合收益总额	-	35,613,297.12	35,613,297.12
(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)	-293,531,553.28	-14,190,504.98	-307,722,058.26
其中: 1.基金申购款	138,949,846.32	10,558,909.52	149,508,755.84
2.基金赎回款	-432,481,399.60	-24,749,414.50	-457,230,814.10
(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	167,736,223.72	25,970,072.70	193,706,296.42

注: 本基金合同生效日为 2025 年 12 月 4 日, 截至报告期末本基金合同生效未满一年, 本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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: 王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]2499 号《关于准予易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》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 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案, 《易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 12 月 4 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 470,534,835.30 份基金份额, 其中认购资金利息折合 102,898.01 份基金份额。本基金为契约型开放式基金, 存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二

阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

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

(4)本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人履行适当程序后，可调整基金收益的分配原则和支付方式；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指

数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种, 根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外), 按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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	17,074,029.71
等于：本金	17,072,606.91
加：应计利息	1,422.80
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	17,074,029.71

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		164,195,217.48	-	175,592,033.57	11,396,816.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,999.98	0.41	9,000.39	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,999.98	0.41	9,000.39	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		164,204,217.46	0.41	175,601,033.96	11,396,816.09

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	46.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	66,409.79
其中：交易所市场	66,409.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	145,799.07

6.4.7.7 实收基金

易方达中证 A500 量化增强 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	377,987,804.25	377,987,804.25
本期申购	73,797,523.43	73,797,523.43
本期赎回（以“-”号填列）	-339,371,402.28	-339,371,402.28
本期末	112,413,925.40	112,413,925.40

易方达中证 A500 量化增强 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	83,279,972.75	83,279,972.75
本期申购	65,152,322.89	65,152,322.89
本期赎回（以“-”号填列）	-93,109,997.32	-93,109,997.32
本期末	55,322,298.32	55,322,298.32

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 A500 量化增强 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	543,779.03	3,202,929.91	3,746,708.94
本期期初	543,779.03	3,202,929.91	3,746,708.94
本期利润	21,798,351.61	5,783,161.78	27,581,513.39
本期基金份额交易产生的变动数	-9,237,919.03	-4,587,536.98	-13,825,456.01
其中：基金申购款	4,480,703.88	754,134.05	5,234,837.93
基金赎回款	-13,718,622.91	-5,341,671.03	-19,060,293.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,104,211.61	4,398,554.71	17,502,766.32

易方达中证 A500 量化增强 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	94,993.70	705,577.92	800,571.62
本期期初	94,993.70	705,577.92	800,571.62
本期利润	6,429,989.94	1,601,793.79	8,031,783.73
本期基金份额交易产生的变动数	-218,028.86	-147,020.11	-365,048.97
其中：基金申购款	4,454,141.22	869,930.37	5,324,071.59
基金赎回款	-4,672,170.08	-1,016,950.48	-5,689,120.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,306,954.78	2,160,351.60	8,467,306.38

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	34,527.00
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	4,626.14
其他	373.18
合计	39,526.32

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	27,780,641.47
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	27,780,641.47

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	830,004,174.68
减：卖出股票成本总额	801,576,030.26
减：交易费用	647,502.95
买卖股票差价收入	27,780,641.47

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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	0.39
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	0.39

6.4.7.11.2 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。

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 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	1,649,958.86
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,649,958.86

6.4.7.15 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	7,384,955.57
——股票投资	7,384,955.57
——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	7,384,955.57

6.4.7.16 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	70,378.26
合计	70,378.26

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 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	19,835.79

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	7,044.86
合计	86,388.02

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
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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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
当期发生的基金应支付的管理费	985,413.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	459,065.68
应支付基金管理人的净管理费	526,347.57

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$

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，逐日累计至每个月月末，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，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。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	123,176.65

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

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，逐日累计至每个月月末，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，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A500量化增强 A	易方达中证A500量化增强 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,820.23	1,820.23
中国银行	-	64,374.03	64,374.03
广发证券	-	1,326.26	1,326.26
易方达财富	-	238.60	238.60
合计	-	67,759.12	67,759.12

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 0.40%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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提，逐日累计至每个月月末，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，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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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 A500 量化增强 A

无。

易方达中证 A500 量化增强 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

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	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	17,074,029.71	34,527.00

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
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56

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

易方达中证 A500 量化增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 A500 量化增强 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

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	流通受限类型	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
001220	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	-
00123	惠康	2026-0	6 个月	新股	53.26	58.74	96	5,112.	5,639.	-

7	科技	5-15		流通受限				96	04	
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,133	8,860.06	23,498.42	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	93	1,709.34	1,560.54	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	242	6,579.98	7,577.02	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	173	5,255.74	6,745.27	-
301513	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	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	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	317	4,409.47	10,292.99	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	375	17,280.00	173,748.75	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	424	3,001.92	12,041.60	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	105	6,090.00	11,776.80	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	255	17,763.30	40,815.30	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	59	4,624.42	7,184.43	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	168	4,146.24	14,582.40	-

601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	354	3,957.72	6,226.86	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	47	1,574.03	1,594.71	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	175	3,097.50	14,756.00	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	96	3,934.08	29,586.24	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,441	25,246.32	51,760.72	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	2,511	56,949.48	105,863.76	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	95	8,757.10	43,999.25	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	75	3,342.00	35,150.25	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	63	5,158.44	99,812.79	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	812	5,204.92	19,593.56	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	204	5,361.12	35,106.36	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通	55.95	57.10	137	7,665.15	7,822.70	-

				受限						
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	997	9,441.59	69,929.58	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	362	7,124.16	51,219.38	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026-06-11	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	90	9,000.00	9,000.39	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	671	314,270.60	590,164.63	-

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。

本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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	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	9,000.39	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	9,000.39	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	17,074,029.71	-	-	-	17,074,029.71
结算备付金	824,176.69	-	-	-	824,176.69
存出保证金	198,865.36	-	-	-	198,865.36
交易性金融资产	-	-	9,000.39	175,592,033.57	175,601,033.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,322,607.66	5,322,607.66
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,097,071.76	-	9,000.39	180,914,641.23	199,020,713.38
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	-	-	-	3,903,379.88	3,903,379.88
应付赎回款	-	-	-	1,113,306.61	1,113,306.61
应付管理人报酬	-	-	-	119,511.28	119,511.28
应付托管费	-	-	-	14,938.93	14,938.93
应付销售服务费	-	-	-	17,481.19	17,481.19
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	-	-	-	145,799.07	145,799.07
负债总计	-	-	-	5,314,416.96	5,314,416.96
利率敏感度缺口	18,097,071.76	-	9,000.39	175,600,224.27	193,706,296.42
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	110,497,153.36	-	-	-	110,497,153.36
结算备付金	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	382,105,187.95	382,105,187.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,593,516.73	5,593,516.73
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	120,497,153.36	-	-	387,698,704.68	508,195,858.04
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	-	-	-	27,004,763.33	27,004,763.33
应付赎回款	-	-	-	14,992,822.01	14,992,822.01
应付管理人报酬	-	-	-	279,530.25	279,530.25
应付托管费	-	-	-	34,941.26	34,941.26
应付销售服务费	-	-	-	24,619.75	24,619.75
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	-	-	-	44,123.88	44,123.88
负债总计	-	-	-	42,380,800.48	42,380,800.48
利率敏感度缺口	120,497,153.36	-	-	345,317,904.20	465,815,057.56

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	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	175,592,033.57	90.65	382,105,187.95	82.03
交易性金融资产—债券投资	9,000.39	0.00	-	-
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	175,601,033.96	90.65	382,105,187.95	82.03

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%	9,080,818.74	19,690,677.17
	2.业绩比较基准下降 5%	-9,080,818.74	-19,690,677.17

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	174,076,040.78
第二层次	604,220.02
第三层次	920,773.16
合计	175,601,033.96

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。

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	175,592,033.57	88.23
	其中：股票	175,592,033.57	88.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,000.39	0.00
	其中：债券	9,000.39	0.00
	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	17,898,206.40	8.99
8	其他各项资产	5,521,473.02	2.77

9	合计	199,020,713.38	100.00
---	----	----------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	661,311.00	0.34
B	采矿业	5,515,104.00	2.85
C	制造业	104,090,904.92	53.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,809,644.00	1.45
E	建筑业	889,447.70	0.46
F	批发和零售业	983,928.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	2,954,631.00	1.53
H	住宿和餐饮业	148,645.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,381,624.70	3.29
J	金融业	15,144,211.36	7.82
K	房地产业	455,646.00	0.24
L	租赁和商务服务业	655,477.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	1,812,977.00	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	509,041.00	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	126,505.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	10,458.00	0.01
S	综合	148,286.00	0.08
	合计	143,297,841.68	73.98

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	234,835.00	0.12

B	采矿业	1,239,768.42	0.64
C	制造业	23,368,034.55	12.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,446,010.00	0.75
E	建筑业	127,187.00	0.07
F	批发和零售业	609,599.00	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	813,630.46	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,156,692.37	1.11
J	金融业	463,716.00	0.24
K	房地产业	447,418.00	0.23
L	租赁和商务服务业	151,530.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	471,685.20	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	557,488.89	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	64,035.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	142,562.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	32,294,191.89	16.67

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	300308	中际旭创	6,400	8,128,000.00	4.20
2	300750	宁德时代	13,072	5,137,426.72	2.65
3	300502	新易盛	7,480	4,540,360.00	2.34
4	603986	兆易创新	3,300	2,689,500.00	1.39
5	600519	贵州茅台	2,200	2,608,078.00	1.35
6	688256	寒武纪	1,550	2,473,102.50	1.28
7	601318	中国平安	50,500	2,410,870.00	1.24
8	000333	美的集团	28,800	2,175,264.00	1.12
9	601899	紫金矿业	79,800	2,006,172.00	1.04

10	688041	海光信息	5,376	1,990,732.80	1.03
11	600036	招商银行	53,700	1,906,350.00	0.98
12	600276	恒瑞医药	36,100	1,878,644.00	0.97
13	002475	立讯精密	26,500	1,865,600.00	0.96
14	600900	长江电力	64,600	1,709,962.00	0.88
15	002384	东山精密	6,500	1,705,275.00	0.88
16	688008	澜起科技	5,392	1,670,980.80	0.86
17	002371	北方华创	1,800	1,592,208.00	0.82
18	002594	比亚迪	19,700	1,570,090.00	0.81
19	300059	东方财富	76,700	1,563,146.00	0.81
20	688981	中芯国际	9,806	1,557,388.92	0.80
21	603259	药明康德	12,500	1,556,375.00	0.80
22	600487	亨通光电	14,200	1,552,628.00	0.80
23	688012	中微公司	3,237	1,516,534.50	0.78
24	600030	中信证券	52,700	1,514,071.00	0.78
25	688498	源杰科技	781	1,472,966.00	0.76
26	300394	天孚通信	4,640	1,404,435.20	0.73
27	300223	北京君正	5,200	1,294,280.00	0.67
28	601398	工商银行	176,000	1,244,320.00	0.64
29	300408	三环集团	7,400	1,235,060.00	0.64
30	600183	生益科技	6,700	1,161,780.00	0.60
31	601166	兴业银行	69,706	1,154,331.36	0.60
32	000725	京东方 A	126,600	1,098,888.00	0.57
33	688235	百济神州	4,144	1,055,103.84	0.54
34	601288	农业银行	172,300	1,045,861.00	0.54
35	600150	中国船舶	29,600	1,000,184.00	0.52
36	300433	蓝思科技	18,100	971,246.00	0.50
37	300476	胜宏科技	2,800	970,004.00	0.50
38	600887	伊利股份	38,400	920,064.00	0.47
39	601211	国泰海通	49,700	904,540.00	0.47
40	002463	沪电股份	5,900	901,520.00	0.47
41	601328	交通银行	134,600	865,478.00	0.45
42	300274	阳光电源	5,400	858,708.00	0.44
43	002851	麦格米特	5,100	852,618.00	0.44
44	600516	方大炭素	134,900	832,333.00	0.43
45	000651	格力电器	21,000	787,500.00	0.41
46	002415	海康威视	23,000	786,600.00	0.41
47	000657	中钨高新	8,200	784,904.00	0.41
48	688525	佰维存储	1,550	766,831.50	0.40
49	300782	卓胜微	6,700	734,186.00	0.38
50	600309	万华化学	10,287	703,733.67	0.36
51	002821	凯莱英	4,340	703,080.00	0.36
52	600111	北方稀土	14,600	701,530.00	0.36
53	688521	芯原股份	1,885	699,598.90	0.36

54	600549	厦门钨业	7,998	681,429.60	0.35
55	002714	牧原股份	18,900	661,311.00	0.34
56	688578	艾力斯	5,977	652,688.40	0.34
57	603993	洛阳钼业	36,900	647,595.00	0.33
58	603019	中科曙光	5,900	632,657.00	0.33
59	000338	潍柴动力	23,100	629,475.00	0.32
60	688506	百利天恒	2,102	618,051.06	0.32
61	688072	拓荆科技	671	590,164.63	0.30
62	601816	京沪高铁	127,000	575,310.00	0.30
63	600418	江淮汽车	22,100	570,843.00	0.29
64	000001	平安银行	55,000	552,750.00	0.29
65	002738	中矿资源	9,300	548,607.00	0.28
66	601021	春秋航空	11,600	528,728.00	0.27
67	601233	桐昆股份	23,900	517,435.00	0.27
68	000100	TCL 科技	87,800	510,996.00	0.26
69	600522	中天科技	8,300	503,644.00	0.26
70	600584	长电科技	4,800	497,040.00	0.26
71	002422	科伦药业	12,900	496,908.00	0.26
72	002601	龙佰集团	29,900	492,752.00	0.25
73	601601	中国太保	17,100	487,692.00	0.25
74	000988	华工科技	2,600	479,986.00	0.25
75	688676	金盘科技	5,652	478,385.28	0.25
76	600000	浦发银行	52,200	449,442.00	0.23
77	300568	星源材质	23,500	439,920.00	0.23
78	002281	光迅科技	1,700	436,798.00	0.23
79	688002	睿创微纳	2,811	434,833.59	0.22
80	301308	江波龙	600	422,280.00	0.22
81	002916	深南电路	900	412,110.00	0.21
82	300604	长川科技	1,200	409,704.00	0.21
83	002602	世纪华通	28,500	401,850.00	0.21
84	000938	紫光股份	13,700	395,382.00	0.20
85	002008	大族激光	2,600	390,286.00	0.20
86	300124	汇川技术	5,700	378,081.00	0.20
87	000063	中兴通讯	10,400	376,376.00	0.19
88	300054	鼎龙股份	3,400	360,298.00	0.19
89	688347	华虹宏力	1,026	345,043.80	0.18
90	600176	中国巨石	4,700	342,536.00	0.18
91	300857	协创数据	1,000	339,900.00	0.18
92	601668	中国建筑	76,500	332,010.00	0.17
93	601766	中国中车	62,200	323,440.00	0.17
94	002353	杰瑞股份	2,100	320,250.00	0.17
95	600031	三一重工	18,500	319,680.00	0.17
96	300033	同花顺	1,280	308,480.00	0.16
97	688390	固德威	2,825	306,540.75	0.16

98	000807	云铝股份	13,800	305,532.00	0.16
99	601857	中国石油	35,100	304,668.00	0.16
100	601658	邮储银行	59,900	295,307.00	0.15
101	000977	浪潮信息	4,200	294,000.00	0.15
102	600406	国电南瑞	12,800	292,480.00	0.15
103	600323	瀚蓝环境	10,600	291,076.00	0.15
104	688331	荣昌生物	2,218	288,916.68	0.15
105	000858	五粮液	3,902	288,748.00	0.15
106	002532	天山铝业	26,900	288,637.00	0.15
107	000831	中国稀土	5,200	288,548.00	0.15
108	601600	中国铝业	35,000	287,700.00	0.15
109	000933	神火股份	13,400	284,080.00	0.15
110	000792	盐湖股份	9,400	283,786.00	0.15
111	002414	高德红外	21,257	281,867.82	0.15
112	002028	思源电气	1,600	276,800.00	0.14
113	300458	全志科技	7,000	276,220.00	0.14
114	605117	德业股份	2,580	273,944.40	0.14
115	601985	中国核电	30,200	272,706.00	0.14
116	603288	海天味业	8,200	271,912.00	0.14
117	300760	迈瑞医疗	2,000	271,660.00	0.14
118	600489	中金黄金	15,000	270,750.00	0.14
119	002050	三花智控	6,000	262,980.00	0.14
120	601225	陕西煤业	12,800	260,480.00	0.13
121	688469	芯联集成	24,347	258,321.67	0.13
122	300661	圣邦股份	1,800	258,264.00	0.13
123	600028	中国石化	57,900	258,234.00	0.13
124	601000	唐山港	61,400	254,810.00	0.13
125	600885	宏发股份	7,300	251,777.00	0.13
126	600499	科达制造	18,200	251,160.00	0.13
127	000426	兴业银锡	7,600	250,496.00	0.13
128	002001	新和成	8,800	250,096.00	0.13
129	000408	藏格矿业	3,600	249,552.00	0.13
130	601088	中国神华	6,300	245,952.00	0.13
131	002156	通富微电	3,200	242,784.00	0.13
132	002600	领益智造	13,900	241,026.00	0.12
133	300475	香农芯创	800	240,000.00	0.12
134	002049	紫光国微	2,700	239,625.00	0.12
135	300083	创世纪	17,200	234,264.00	0.12
136	002128	电投能源	10,100	233,512.00	0.12
137	002938	鹏鼎控股	2,200	231,836.00	0.12
138	002493	荣盛石化	21,400	230,050.00	0.12
139	002436	兴森科技	4,400	224,180.00	0.12
140	002460	赣锋锂业	3,400	222,360.00	0.11
141	603799	华友钴业	4,600	221,996.00	0.11

142	688111	金山办公	1,034	220,293.70	0.11
143	002064	华峰化学	23,200	220,168.00	0.11
144	600938	中国海油	8,100	219,915.00	0.11
145	601168	西部矿业	8,100	219,834.00	0.11
146	601728	中国电信	42,100	218,499.00	0.11
147	603766	隆鑫通用	18,200	217,126.00	0.11
148	600989	宝丰能源	10,600	215,498.00	0.11
149	300014	亿纬锂能	3,300	214,599.00	0.11
150	002179	中航光电	4,600	212,520.00	0.11
151	600089	特变电工	9,400	211,500.00	0.11
152	002230	科大讯飞	5,100	208,284.00	0.11
153	688271	联影医疗	2,037	206,205.51	0.11
154	600690	海尔智家	10,000	204,100.00	0.11
155	002466	天齐锂业	3,300	202,356.00	0.10
156	000683	博源化工	35,100	202,176.00	0.10
157	603501	豪威集团	2,100	199,185.00	0.10
158	600104	上汽集团	20,400	199,104.00	0.10
159	002202	金风科技	8,300	198,370.00	0.10
160	002709	天赐材料	3,800	195,434.00	0.10
161	688120	华海清科	606	195,241.08	0.10
162	002273	水晶光电	5,500	195,140.00	0.10
163	002236	大华股份	11,700	192,933.00	0.10
164	601872	招商轮船	10,800	189,756.00	0.10
165	002497	雅化集团	9,200	187,404.00	0.10
166	000568	泸州老窖	2,400	186,048.00	0.10
167	300919	中伟新材	4,200	183,750.00	0.09
168	600886	国投电力	13,700	182,347.00	0.09
169	601628	中国人寿	5,100	180,285.00	0.09
170	600998	九州通	38,400	180,096.00	0.09
171	600893	航发动力	4,600	176,364.00	0.09
172	000425	徐工机械	21,700	175,553.00	0.09
173	600460	士兰微	3,200	174,912.00	0.09
174	601360	三六零	20,100	174,669.00	0.09
175	301358	湖南裕能	2,300	174,501.00	0.09
176	600482	中国动力	5,300	173,840.00	0.09
177	002271	东方雨虹	14,600	173,302.00	0.09
178	600233	圆通速递	11,000	173,250.00	0.09
179	600941	中国移动	2,000	172,260.00	0.09
180	000301	东方盛虹	15,000	171,750.00	0.09
181	601100	恒立液压	1,576	169,514.56	0.09
182	000415	渤海租赁	41,600	169,312.00	0.09
183	600050	中国联通	42,300	169,200.00	0.09
184	300012	华测检测	12,200	169,092.00	0.09
185	002266	浙富控股	33,100	167,486.00	0.09

186	002812	恩捷股份	2,500	167,275.00	0.09
187	300136	信维通信	1,400	166,950.00	0.09
188	300442	润泽科技	2,000	166,140.00	0.09
189	600741	华域汽车	10,700	166,064.00	0.09
190	002126	银轮股份	3,300	164,340.00	0.08
191	002603	以岭药业	10,800	162,000.00	0.08
192	600352	浙江龙盛	13,300	161,063.00	0.08
193	601018	宁波港	51,100	160,965.00	0.08
194	688396	华润微	1,597	155,787.35	0.08
195	600795	国电电力	33,300	155,511.00	0.08
196	688777	中控技术	1,314	154,395.00	0.08
197	003816	中国广核	38,500	150,535.00	0.08
198	001965	招商公路	16,200	148,392.00	0.08
199	603979	金诚信	2,500	147,575.00	0.08
200	600177	雅戈尔	19,500	146,835.00	0.08
201	002648	卫星化学	6,200	145,638.00	0.08
202	002340	格林美	21,700	143,437.00	0.07
203	688188	柏楚电子	1,334	142,337.80	0.07
204	300390	天华新能	1,500	140,265.00	0.07
205	600988	赤峰黄金	5,300	139,496.00	0.07
206	300803	指南针	1,500	137,505.00	0.07
207	603659	璞泰来	4,700	135,971.00	0.07
208	002555	三七互娱	7,200	135,864.00	0.07
209	600875	东方电气	4,700	135,219.00	0.07
210	600426	华鲁恒升	5,600	133,952.00	0.07
211	300395	菲利华	1,000	133,730.00	0.07
212	601111	中国国航	21,900	132,495.00	0.07
213	000887	中鼎股份	7,400	132,386.00	0.07
214	600660	福耀玻璃	2,600	131,144.00	0.07
215	300073	当升科技	2,700	129,708.00	0.07
216	600258	首旅酒店	11,800	128,856.00	0.07
217	002241	歌尔股份	5,700	128,421.00	0.07
218	600372	中航机载	11,700	126,945.00	0.07
219	603939	益丰药房	7,000	125,860.00	0.06
220	600166	福田汽车	43,000	125,130.00	0.06
221	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.06
222	688036	传音控股	2,084	122,851.80	0.06
223	600008	首创环保	45,100	122,672.00	0.06
224	002465	海格通信	9,600	122,592.00	0.06
225	300972	万辰集团	700	121,387.00	0.06
226	601058	赛轮轮胎	10,500	121,065.00	0.06
227	600026	中远海能	6,600	118,404.00	0.06
228	002027	分众传媒	24,100	116,644.00	0.06
229	600096	云天化	3,700	112,480.00	0.06

230	002444	巨星科技	3,600	111,960.00	0.06
231	600673	东阳光	3,300	110,814.00	0.06
232	600066	宇通客车	4,100	109,921.00	0.06
233	002138	顺络电子	1,500	109,650.00	0.06
234	000630	铜陵有色	17,100	108,756.00	0.06
235	600362	江西铜业	2,500	108,250.00	0.06
236	601888	中国中免	2,000	107,420.00	0.06
237	300450	先导智能	2,600	105,872.00	0.05
238	600153	建发股份	13,200	104,676.00	0.05
239	600010	包钢股份	46,700	104,141.00	0.05
240	600115	中国东航	27,300	104,013.00	0.05
241	300573	兴齐眼药	2,530	103,122.80	0.05
242	600019	宝钢股份	18,900	102,627.00	0.05
243	603129	春风动力	400	102,320.00	0.05
244	600585	海螺水泥	6,000	101,700.00	0.05
245	300207	欣旺达	5,300	100,647.00	0.05
246	600879	航天电子	4,700	100,063.00	0.05
247	000975	山金国际	5,700	96,900.00	0.05
248	300567	精测电子	300	95,280.00	0.05
249	002558	巨人网络	3,400	93,704.00	0.05
250	688099	晶晨股份	902	92,815.80	0.05
251	600312	平高电气	5,200	91,832.00	0.05
252	605499	东鹏饮料	740	91,338.20	0.05
253	600048	保利发展	19,700	91,211.00	0.05
254	002352	顺丰控股	2,900	90,654.00	0.05
255	600346	恒力石化	5,100	90,321.00	0.05
256	601868	中国能建	33,700	89,979.00	0.05
257	002831	裕同科技	2,500	88,900.00	0.05
258	601390	中国中铁	21,000	87,570.00	0.05
259	601800	中国交建	15,000	85,650.00	0.04
260	601877	正泰电器	3,400	85,238.00	0.04
261	300751	迈为股份	300	84,738.00	0.04
262	600141	兴发集团	1,800	84,546.00	0.04
263	600064	南京高科	11,800	84,134.00	0.04
264	601919	中远海控	6,300	83,538.00	0.04
265	600547	山东黄金	3,600	83,124.00	0.04
266	002472	双环传动	2,000	83,020.00	0.04
267	601880	辽港股份	60,000	82,800.00	0.04
268	600011	华能国际	10,900	82,731.00	0.04
269	300049	福瑞医科	2,100	81,648.00	0.04
270	600029	南方航空	15,700	81,326.00	0.04
271	002131	利欧股份	17,100	81,225.00	0.04
272	600497	驰宏锌锗	6,700	81,137.00	0.04
273	002080	中材科技	900	81,000.00	0.04

274	002195	岩山科技	12,300	80,442.00	0.04
275	002407	多氟多	1,600	80,368.00	0.04
276	300496	中科创达	1,300	80,327.00	0.04
277	300342	天银机电	1,700	79,900.00	0.04
278	002091	江苏国泰	11,000	79,530.00	0.04
279	600196	复星医药	3,500	78,645.00	0.04
280	300142	沃森生物	6,000	77,940.00	0.04
281	600711	盛屯矿业	7,100	77,887.00	0.04
282	601866	中远海发	35,200	77,792.00	0.04
283	002432	九安医疗	1,100	77,748.00	0.04
284	600535	天士力	5,800	76,734.00	0.04
285	600415	小商品城	7,500	76,200.00	0.04
286	300677	英科医疗	1,900	74,423.00	0.04
287	300037	新宙邦	800	74,280.00	0.04
288	601012	隆基绿能	5,500	72,160.00	0.04
289	600221	海航控股	53,400	72,090.00	0.04
290	300558	贝达药业	1,100	71,577.00	0.04
291	001979	招商蛇口	11,100	71,373.00	0.04
292	601117	中国化学	9,700	71,295.00	0.04
293	000157	中联重科	10,200	71,094.00	0.04
294	600143	金发科技	4,600	71,070.00	0.04
295	300017	网宿科技	5,400	70,254.00	0.04
296	002044	美年健康	13,900	69,917.00	0.04
297	601618	中国中冶	28,600	69,784.00	0.04
298	000400	许继电气	3,200	69,440.00	0.04
299	688472	阿特斯	6,347	68,674.54	0.04
300	300418	昆仑万维	1,700	68,612.00	0.04
301	002130	沃尔核材	3,600	68,256.00	0.04
302	002078	太阳纸业	5,400	67,446.00	0.03
303	603606	东方电缆	1,620	67,246.20	0.03
304	002185	华天科技	3,000	66,930.00	0.03
305	000039	中集集团	8,200	66,502.00	0.03
306	002065	东华软件	9,300	66,402.00	0.03
307	300438	鹏辉能源	800	66,280.00	0.03
308	603486	科沃斯	1,300	65,975.00	0.03
309	600511	国药股份	2,500	65,100.00	0.03
310	302132	中航成飞	1,100	64,152.00	0.03
311	002294	信立泰	2,000	63,780.00	0.03
312	600160	巨化股份	1,200	63,612.00	0.03
313	000423	东阿阿胶	1,400	63,504.00	0.03
314	300866	安克创新	600	62,700.00	0.03
315	600332	白云山	3,100	62,124.00	0.03
316	300118	东方日升	4,900	61,005.00	0.03
317	688599	天合光能	4,288	60,546.56	0.03

318	300316	晶盛机电	1,000	60,400.00	0.03
319	601607	上海医药	3,900	60,060.00	0.03
320	601179	中国西电	4,000	59,680.00	0.03
321	601319	中国人保	8,800	59,488.00	0.03
322	600316	洪都航空	2,100	58,674.00	0.03
323	688180	君实生物	1,731	58,542.42	0.03
324	688047	龙芯中科	374	57,846.58	0.03
325	300454	深信服	600	57,720.00	0.03
326	688169	石头科技	602	57,171.94	0.03
327	600219	南山铝业	14,300	57,057.00	0.03
328	002405	四维图新	8,800	56,936.00	0.03
329	000538	云南白药	1,200	56,844.00	0.03
330	300115	长盈精密	2,000	55,880.00	0.03
331	002595	豪迈科技	1,185	55,221.00	0.03
332	688122	西部超导	854	53,639.74	0.03
333	601727	上海电气	7,600	53,200.00	0.03
334	601677	明泰铝业	3,200	53,120.00	0.03
335	600580	卧龙电驱	1,600	52,960.00	0.03
336	002155	湖南黄金	2,200	52,514.00	0.03
337	000786	北新建材	2,900	52,461.00	0.03
338	600674	川投能源	3,700	52,429.00	0.03
339	600905	三峡能源	14,100	52,311.00	0.03
340	300759	康龙化成	1,800	52,074.00	0.03
341	002120	韵达股份	8,100	51,516.00	0.03
342	002756	永兴材料	900	50,976.00	0.03
343	000032	深桑达 A	1,966	49,051.70	0.03
344	600038	中直股份	1,900	48,051.00	0.02
345	000878	云南铜业	3,000	47,640.00	0.02
346	000617	中油资本	7,000	46,130.00	0.02
347	600699	均胜电子	2,100	45,381.00	0.02
348	300024	机器人	2,300	44,459.00	0.02
349	000519	中兵红箭	2,100	44,247.00	0.02
350	300432	富临精工	2,200	44,198.00	0.02
351	600515	海南机场	15,900	43,566.00	0.02
352	601615	明阳智能	3,700	42,809.00	0.02
353	000035	中国天楹	8,800	42,504.00	0.02
354	300724	捷佳伟创	600	42,360.00	0.02
355	300474	景嘉微	700	42,336.00	0.02
356	600655	豫园股份	10,300	42,333.00	0.02
357	600039	四川路桥	5,300	41,446.00	0.02
358	002252	上海莱士	9,500	41,230.00	0.02
359	600895	张江高科	1,100	40,975.00	0.02
360	688223	晶科能源	8,480	40,280.00	0.02
361	600170	上海建工	17,900	39,738.00	0.02

362	300015	爱尔眼科	4,800	39,648.00	0.02
363	600588	用友网络	4,300	39,474.00	0.02
364	688608	恒玄科技	225	37,617.75	0.02
365	000833	粤桂股份	1,600	37,472.00	0.02
366	300748	金力永磁	1,200	37,020.00	0.02
367	300409	道氏技术	1,800	35,874.00	0.02
368	603806	福斯特	2,100	35,259.00	0.02
369	600208	衢州发展	12,400	35,092.00	0.02
370	300896	爱美客	400	34,880.00	0.02
371	600085	同仁堂	1,500	34,665.00	0.02
372	300699	光威复材	1,200	34,380.00	0.02
373	688005	容百科技	1,115	34,119.00	0.02
374	300601	康泰生物	3,000	34,020.00	0.02
375	300832	新产业	800	33,600.00	0.02
376	002318	久立特材	1,400	33,460.00	0.02
377	002223	鱼跃医疗	1,300	33,358.00	0.02
378	000661	长春高新	500	33,300.00	0.02
379	002292	奥飞娱乐	4,900	32,144.00	0.02
380	601216	君正集团	7,200	32,112.00	0.02
381	600521	华海药业	2,200	31,680.00	0.02
382	300122	智飞生物	2,700	31,563.00	0.02
383	688116	天奈科技	824	31,476.80	0.02
384	688126	沪硅产业	782	31,193.98	0.02
385	300003	乐普医疗	2,600	30,810.00	0.02
386	603596	伯特利	1,236	30,702.24	0.02
387	600704	物产中大	6,500	30,680.00	0.02
388	600862	中航高科	1,700	30,651.00	0.02
389	600765	中航重机	2,300	29,716.00	0.02
390	600018	上港集团	6,100	28,792.00	0.01
391	600839	四川长虹	4,100	28,618.00	0.01
392	600803	新奥股份	1,800	28,440.00	0.01
393	002007	华兰生物	2,300	28,037.00	0.01
394	002410	广联达	3,400	27,744.00	0.01
395	000830	鲁西化工	2,300	27,600.00	0.01
396	301550	斯菱智驱	300	27,429.00	0.01
397	002389	航天彩虹	1,500	26,655.00	0.01
398	002244	滨江集团	3,500	26,600.00	0.01
399	688114	华大智造	506	25,846.48	0.01
400	688166	博瑞医药	736	25,767.36	0.01
401	600486	扬农化工	500	25,350.00	0.01
402	600760	中航沈飞	600	24,660.00	0.01
403	688009	中国通号	5,171	24,613.96	0.01
404	000932	华菱钢铁	6,900	23,943.00	0.01
405	000738	航发控制	1,300	23,777.00	0.01

406	601238	广汽集团	4,600	23,368.00	0.01
407	600820	隧道股份	4,400	22,924.00	0.01
408	600436	片仔癀	200	21,856.00	0.01
409	000002	万科 A	7,300	21,608.00	0.01
410	300676	华大基因	600	21,036.00	0.01
411	601567	三星电气	1,400	20,916.00	0.01
412	600161	天坛生物	1,800	20,844.00	0.01
413	600859	王府井	2,200	20,196.00	0.01
414	688063	派能科技	372	19,816.44	0.01
415	600754	锦江酒店	1,100	19,789.00	0.01
416	002544	普天科技	1,000	18,220.00	0.01
417	000069	华侨城 A	11,100	18,204.00	0.01
418	600864	哈投股份	3,500	18,165.00	0.01
419	603605	珀莱雅	300	17,976.00	0.01
420	301078	孩子王	2,600	17,576.00	0.01
421	600763	通策医疗	500	16,940.00	0.01
422	300457	赢合科技	800	16,864.00	0.01
423	603833	欧派家居	500	15,055.00	0.01
424	300347	泰格医药	300	14,400.00	0.01
425	600398	海澜之家	2,700	14,121.00	0.01
426	600325	华发股份	6,100	14,091.00	0.01
427	300144	宋城演艺	1,800	10,458.00	0.01
428	603899	晨光股份	500	10,315.00	0.01
429	600663	陆家嘴	1,400	8,792.00	0.00
430	002891	中宠股份	300	8,016.00	0.00
431	300070	碧水源	2,500	7,975.00	0.00
432	000034	神州数码	40	1,110.00	0.00

7.3.2 期末积极投资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	688630	芯碁微装	1,638	899,900.82	0.46
2	002993	奥海科技	12,100	866,481.00	0.45
3	603876	鼎胜新材	31,800	827,118.00	0.43
4	300489	光智科技	2,600	811,070.00	0.42
5	600483	福能股份	78,500	799,915.00	0.41
6	301165	锐捷网络	9,600	772,320.00	0.40
7	601898	中煤能源	62,100	756,378.00	0.39
8	605198	安德利	11,800	747,648.00	0.39
9	301638	南网数字	30,300	728,715.00	0.38
10	003018	金富科技	6,500	495,495.00	0.26
11	002484	江海股份	4,300	451,500.00	0.23

12	600298	安琪酵母	12,200	441,640.00	0.23
13	301377	鼎泰高科	800	440,720.00	0.23
14	002518	科士达	8,000	428,720.00	0.22
15	603678	火炬电子	5,000	415,000.00	0.21
16	688387	信科移动	20,435	405,430.40	0.21
17	688807	优迅股份	989	398,003.27	0.21
18	002428	云南锗业	3,300	396,594.00	0.20
19	002488	金固股份	44,500	396,495.00	0.20
20	600007	中国国贸	20,300	385,294.00	0.20
21	002636	金安国纪	3,200	383,904.00	0.20
22	601126	四方股份	5,900	372,880.00	0.19
23	603308	应流股份	5,200	314,080.00	0.16
24	301196	唯科科技	2,200	275,924.00	0.14
25	600259	中稀有色	2,700	274,347.00	0.14
26	002975	博杰股份	1,700	241,400.00	0.12
27	300671	富满微	2,800	241,248.00	0.12
28	688026	洁特生物	15,053	236,482.63	0.12
29	300776	帝尔激光	1,100	236,456.00	0.12
30	002245	蔚蓝锂芯	12,600	235,746.00	0.12
31	688361	中科飞测	524	225,320.00	0.12
32	600458	时代新材	11,800	195,290.00	0.10
33	603236	移远通信	3,800	194,446.00	0.10
34	000581	威孚高科	11,200	190,624.00	0.10
35	603186	华正新材	800	180,240.00	0.09
36	301666	大普微	375	173,748.75	0.09
37	603663	三祥新材	1,800	173,340.00	0.09
38	603713	密尔克卫	2,400	170,808.00	0.09
39	688275	万润新能	1,277	162,881.35	0.08
40	605376	博迁新材	600	162,780.00	0.08
41	000708	中信特钢	11,600	146,392.00	0.08
42	000962	东方铝业	1,600	144,960.00	0.07
43	600500	中化国际	18,400	144,072.00	0.07
44	300851	交大思诺	6,300	140,175.00	0.07
45	688662	富信科技	813	136,584.00	0.07
46	300401	花园生物	5,900	129,151.00	0.07
47	688510	航亚科技	5,311	126,826.68	0.07
48	688328	深科达	1,278	122,304.60	0.06
49	002972	科安达	6,200	121,272.00	0.06
50	000050	深天马 A	12,100	119,911.00	0.06
51	688536	思瑞浦	323	117,601.07	0.06
52	603025	大豪科技	8,300	113,212.00	0.06
53	002111	威海广泰	12,300	110,700.00	0.06
54	300397	天和防务	7,300	110,522.00	0.06
55	688015	交控科技	7,133	109,705.54	0.06

56	000957	中通客车	11,600	108,576.00	0.06
56	603390	通达电气	10,400	108,576.00	0.06
58	002452	长高电气	8,400	107,268.00	0.06
59	688025	杰普特	228	107,160.00	0.06
60	688090	瑞松科技	998	106,237.10	0.05
61	688781	视涯科技	2,511	105,863.76	0.05
62	688708	佳驰科技	2,048	104,038.40	0.05
63	300814	中富电路	500	102,250.00	0.05
64	688808	联讯仪器	63	99,812.79	0.05
65	601156	东航物流	5,900	95,108.00	0.05
66	601827	三峰环境	12,200	88,694.00	0.05
67	600060	海信视像	3,000	83,610.00	0.04
68	600350	山东高速	7,500	83,475.00	0.04
69	002416	爱施德	9,000	80,640.00	0.04
70	600295	鄂尔多斯	7,500	80,400.00	0.04
71	002249	大洋电机	10,700	80,250.00	0.04
72	000951	中国重汽	4,100	79,991.00	0.04
73	301109	军信股份	6,400	79,744.00	0.04
74	000429	粤高速 A	5,800	79,170.00	0.04
75	000598	兴蓉环境	12,300	78,966.00	0.04
76	300236	上海新阳	600	78,900.00	0.04
76	600023	浙能电力	15,000	78,900.00	0.04
78	000690	宝新能源	16,700	78,490.00	0.04
79	002832	比音勒芬	3,800	78,432.00	0.04
80	002216	三全食品	6,800	78,404.00	0.04
81	601801	皖新传媒	15,900	78,387.00	0.04
82	600600	青岛啤酒	1,500	78,345.00	0.04
83	000739	普洛药业	4,700	78,302.00	0.04
84	603195	公牛集团	2,000	78,300.00	0.04
85	002170	芭田股份	7,200	78,192.00	0.04
86	601330	绿色动力	11,200	78,064.00	0.04
87	600057	厦门象屿	14,400	78,048.00	0.04
88	600863	华能蒙电	16,600	78,020.00	0.04
89	000543	皖能电力	10,300	77,971.00	0.04
90	002491	通鼎互联	2,400	77,760.00	0.04
91	601033	永兴股份	5,800	77,720.00	0.04
92	601998	中信银行	11,200	77,616.00	0.04
93	002043	兔宝宝	7,000	77,560.00	0.04
94	603565	中谷物流	7,900	77,499.00	0.04
95	601598	中国外运	15,600	77,376.00	0.04
96	600575	淮河能源	24,200	77,198.00	0.04
97	001286	陕西能源	7,600	77,064.00	0.04
98	601939	建设银行	8,000	77,040.00	0.04
99	000600	建投能源	8,800	77,000.00	0.04

100	600598	北大荒	7,100	76,964.00	0.04
101	600761	安徽合力	4,700	76,892.00	0.04
102	603317	天味食品	5,900	76,759.00	0.04
103	603233	大参林	5,100	76,653.00	0.04
104	600919	江苏银行	7,100	76,538.00	0.04
105	601339	百隆东方	11,300	76,501.00	0.04
106	000895	双汇发展	3,400	76,160.00	0.04
107	002032	苏泊尔	1,900	75,240.00	0.04
108	000983	山西焦煤	12,800	74,240.00	0.04
109	002152	广电运通	7,900	74,102.00	0.04
110	603444	吉比特	200	71,684.00	0.04
111	300322	硕贝德	2,800	70,560.00	0.04
112	601699	潞安环能	4,900	69,972.00	0.04
113	688818	电科蓝天	997	69,929.58	0.04
114	688110	东芯股份	341	69,461.70	0.04
115	600801	华新建材	4,300	67,080.00	0.03
116	688046	药康生物	2,656	64,275.20	0.03
117	603345	安井食品	800	64,152.00	0.03
118	600016	民生银行	18,200	58,604.00	0.03
119	600015	华夏银行	9,100	58,149.00	0.03
120	601997	贵阳银行	11,300	57,969.00	0.03
121	600926	杭州银行	4,000	57,800.00	0.03
122	300382	斯莱克	2,400	55,464.00	0.03
123	300002	神州泰岳	6,800	53,108.00	0.03
124	002876	三利谱	1,500	52,815.00	0.03
125	688279	峰岬科技	233	52,294.52	0.03
126	688712	北芯生命	1,441	51,760.72	0.03
127	688820	盛合晶微	362	51,219.38	0.03
128	300428	立中集团	2,500	45,450.00	0.02
129	688785	恒运昌	95	43,999.25	0.02
130	301382	蜂助手	900	41,400.00	0.02
131	301682	宏明电子	255	40,815.30	0.02
132	688775	影石创新	288	39,931.20	0.02
133	600894	广日股份	5,200	39,624.00	0.02
134	688355	明志科技	1,994	38,384.50	0.02
135	002850	科达利	200	37,860.00	0.02
136	688670	金迪克	2,233	37,827.02	0.02
137	600623	华谊集团	4,500	36,315.00	0.02
138	300923	研奥股份	1,600	35,648.00	0.02
139	301390	经纬股份	1,100	35,486.00	0.02
140	688797	臻宝科技	75	35,150.25	0.02
141	688813	泰金新能	204	35,106.36	0.02
142	300838	浙江力诺	2,600	34,710.00	0.02
143	002180	奔图科技	2,100	34,356.00	0.02

144	301355	南王科技	3,500	34,230.00	0.02
145	002250	联化科技	2,500	34,175.00	0.02
146	603860	中公高科	1,400	33,866.00	0.02
147	301505	苏州规划	2,100	33,810.00	0.02
148	300640	德艺文创	6,000	33,780.00	0.02
149	300694	蠡湖股份	3,500	33,600.00	0.02
150	301359	东南电子	2,100	33,348.00	0.02
151	603023	威帝股份	8,900	33,197.00	0.02
152	688132	邦彦技术	2,518	33,111.70	0.02
153	001337	四川黄金	900	32,994.00	0.02
154	300958	建工修复	3,100	32,984.00	0.02
155	688701	卓锦股份	4,378	32,966.34	0.02
156	600455	博通股份	1,500	32,940.00	0.02
157	301429	森泰股份	2,100	32,907.00	0.02
158	001260	坤泰股份	2,100	32,865.00	0.02
159	301098	金埔园林	4,000	32,800.00	0.02
160	002780	三夫户外	2,700	32,778.00	0.02
161	002820	桂发祥	3,900	32,760.00	0.02
162	000985	大庆华科	2,300	32,729.00	0.02
163	300535	达威股份	2,400	32,712.00	0.02
164	603214	爱婴室	2,700	32,697.00	0.02
165	603818	曲美家居	11,000	32,670.00	0.02
166	688681	科汇股份	2,335	32,643.30	0.02
167	688616	西力科技	3,226	32,582.60	0.02
168	001366	播恩集团	3,000	32,520.00	0.02
169	688528	秦川物联	3,557	32,510.98	0.02
170	605177	东亚药业	1,900	32,509.00	0.02
171	603709	中源家居	2,400	32,496.00	0.02
172	300169	天晟新材	6,500	32,435.00	0.02
173	300564	筑博设计	2,700	32,427.00	0.02
174	603982	泉峰汽车	5,800	32,422.00	0.02
175	688244	永信至诚	2,273	32,412.98	0.02
176	603968	醋化股份	3,500	32,410.00	0.02
177	000757	浩物股份	9,500	32,395.00	0.02
178	300126	锐奇股份	5,600	32,368.00	0.02
179	300074	华平股份	9,500	32,300.00	0.02
180	001278	一彬科技	2,100	32,298.00	0.02
181	688038	中科通达	1,918	32,260.76	0.02
182	301167	建研设计	2,600	32,214.00	0.02
183	300220	金运激光	3,100	32,209.00	0.02
184	600883	博闻科技	4,600	32,200.00	0.02
185	688021	奥福科技	1,661	32,156.96	0.02
186	603041	美思德	3,100	32,147.00	0.02
187	600802	福建水泥	7,800	32,136.00	0.02

188	301131	聚赛龙	1,000	32,130.00	0.02
189	600303	曙光股份	12,900	32,121.00	0.02
190	300405	科隆股份	6,200	32,116.00	0.02
191	688659	元琛科技	3,076	32,113.44	0.02
192	300823	建科智能	2,200	32,076.00	0.02
193	603908	牧高笛	1,900	32,072.00	0.02
194	300517	海波重科	3,400	32,028.00	0.02
195	600037	歌华有线	5,100	31,977.00	0.02
196	301336	趣睡科技	800	31,960.00	0.02
196	603022	新通联	4,000	31,960.00	0.02
198	603183	建研院	9,000	31,950.00	0.02
199	688203	海正生材	3,200	31,936.00	0.02
200	600148	长春一东	2,200	31,922.00	0.02
201	600097	开创国际	4,100	31,898.00	0.02
202	688466	金科环境	2,485	31,882.55	0.02
203	600149	廊坊发展	7,100	31,879.00	0.02
204	300642	透景生命	2,700	31,860.00	0.02
205	000637	茂化实华	9,100	31,850.00	0.02
205	300713	英可瑞	2,500	31,850.00	0.02
207	003003	天元股份	3,200	31,840.00	0.02
207	300886	华业香料	1,600	31,840.00	0.02
209	002343	慈文传媒	7,300	31,828.00	0.02
210	002591	恒大高新	5,200	31,824.00	0.02
211	600235	民丰特纸	6,400	31,808.00	0.02
212	300417	南华仪器	3,100	31,806.00	0.02
213	301065	本立科技	1,800	31,770.00	0.02
214	600448	华纺股份	12,600	31,752.00	0.02
215	300612	宣亚国际	2,900	31,697.00	0.02
216	002949	华阳国际	3,200	31,648.00	0.02
217	002858	力盛体育	2,900	31,639.00	0.02
218	600706	曲江文旅	4,700	31,631.00	0.02
219	300929	华骐环保	3,000	31,620.00	0.02
220	002495	佳隆股份	15,400	31,570.00	0.02
220	603102	百合股份	1,000	31,570.00	0.02
222	300112	万讯自控	5,100	31,569.00	0.02
223	000605	渤海股份	5,900	31,565.00	0.02
224	002802	洪汇新材	3,000	31,560.00	0.02
225	600051	宁波联合	5,600	31,528.00	0.02
226	300459	汤姆猫	9,300	31,527.00	0.02
227	002494	华斯股份	7,100	31,524.00	0.02
228	301156	美农生物	2,900	31,523.00	0.02
229	002815	崇达技术	1,900	31,521.00	0.02
230	002144	宏达高科	3,200	31,520.00	0.02
230	002679	福建金森	4,000	31,520.00	0.02

232	300778	新城市	3,300	31,515.00	0.02
233	688078	龙软科技	1,495	31,469.75	0.02
234	000856	冀东装备	4,400	31,460.00	0.02
234	002799	环球印务	5,200	31,460.00	0.02
234	603321	梅轮电梯	5,500	31,460.00	0.02
237	002486	嘉麟杰	14,700	31,458.00	0.02
237	600768	宁波富邦	2,100	31,458.00	0.02
239	301539	宏鑫科技	2,400	31,440.00	0.02
239	600493	凤竹纺织	6,000	31,440.00	0.02
241	300240	飞力达	6,300	31,437.00	0.02
242	000633	合金投资	6,600	31,416.00	0.02
243	002566	益盛药业	5,200	31,408.00	0.02
244	603282	亚光股份	2,200	31,394.00	0.02
245	301006	迈拓股份	2,500	31,375.00	0.02
246	300030	阳普医疗	5,400	31,374.00	0.02
247	301300	远翔新材	1,000	31,370.00	0.02
248	002696	百洋股份	6,300	31,311.00	0.02
248	301113	雅艺科技	2,100	31,311.00	0.02
248	603073	彩蝶实业	2,100	31,311.00	0.02
251	300707	威唐工业	2,800	31,304.00	0.02
252	002968	新大正	3,700	31,302.00	0.02
253	300371	汇中股份	3,200	31,296.00	0.02
254	600793	宜宾纸业	2,600	31,278.00	0.02
255	600371	万向德农	5,000	31,250.00	0.02
256	300549	优德精密	2,400	31,248.00	0.02
257	603176	汇通集团	7,300	31,244.00	0.02
258	000619	海螺新材	7,100	31,240.00	0.02
259	301298	东利机械	2,700	31,239.00	0.02
260	300387	富邦科技	4,600	31,234.00	0.02
261	603385	惠达卫浴	6,400	31,232.00	0.02
262	301037	保立佳	2,600	31,200.00	0.02
263	002760	凤形股份	1,900	31,198.00	0.02
264	603689	皖天然气	4,500	31,185.00	0.02
265	301130	西点药业	1,300	31,174.00	0.02
266	603810	丰山集团	2,800	31,164.00	0.02
267	605567	春雪食品	3,900	31,161.00	0.02
268	603117	万林物流	9,300	31,155.00	0.02
269	300597	吉大通信	4,400	31,152.00	0.02
269	600444	国机通用	2,400	31,152.00	0.02
271	002105	信隆健康	6,300	31,122.00	0.02
271	600099	林海股份	3,900	31,122.00	0.02
273	600128	苏豪弘业	4,100	31,119.00	0.02
274	300621	维业股份	4,900	31,115.00	0.02
275	003023	彩虹集团	1,600	31,104.00	0.02

275	600697	欧亚集团	3,200	31,104.00	0.02
277	600661	昂立教育	4,500	31,095.00	0.02
278	000548	湖南投资	7,600	31,084.00	0.02
279	688565	力源科技	3,289	31,081.05	0.02
280	002817	黄山胶囊	5,300	31,058.00	0.02
281	688089	嘉必优	2,927	31,055.47	0.02
282	301163	宏德股份	1,400	31,052.00	0.02
283	600689	上海三毛	3,200	31,040.00	0.02
284	603208	江山欧派	2,900	31,030.00	0.02
285	001231	农心科技	1,700	31,008.00	0.02
286	002732	燕塘乳业	2,500	31,000.00	0.02
287	300614	百川畅银	3,200	30,976.00	0.02
288	603900	莱绅通灵	5,500	30,965.00	0.02
289	300285	国瓷材料	300	30,954.00	0.02
290	301010	晶雪节能	1,900	30,951.00	0.02
291	603029	天鹅股份	2,200	30,932.00	0.02
292	003011	海象新材	1,700	30,889.00	0.02
293	002999	天禾股份	5,800	30,856.00	0.02
294	300514	友讯达	3,300	30,855.00	0.02
295	600137	浪莎股份	1,900	30,837.00	0.02
296	001336	楚环科技	1,400	30,828.00	0.02
297	603506	南都物业	3,300	30,822.00	0.02
298	300519	新光药业	2,600	30,810.00	0.02
298	300675	建科院	2,600	30,810.00	0.02
298	605180	华生科技	2,600	30,810.00	0.02
301	603238	诺邦股份	2,800	30,800.00	0.02
301	603326	我乐家居	5,000	30,800.00	0.02
303	301126	达嘉维康	3,600	30,780.00	0.02
303	603182	嘉华股份	2,700	30,780.00	0.02
305	603151	邦基科技	2,800	30,772.00	0.02
306	002873	新天药业	4,200	30,744.00	0.02
307	003008	开普检测	1,800	30,726.00	0.02
308	600561	江西长运	6,200	30,690.00	0.02
309	603717	天域生物	5,300	30,687.00	0.02
310	603826	坤彩科技	1,200	30,672.00	0.02
311	688638	誉辰智能	984	30,671.28	0.02
312	600833	第一医药	3,400	30,668.00	0.02
313	300645	正元智慧	2,600	30,602.00	0.02
314	300947	德必集团	2,400	30,600.00	0.02
315	300254	仟源医药	3,800	30,438.00	0.02
316	300635	中达安	2,500	30,425.00	0.02
317	000705	浙江震元	5,200	30,420.00	0.02
318	002778	中晟高科	2,000	30,400.00	0.02
319	603536	惠发食品	3,900	30,381.00	0.02

320	301519	舜禹股份	2,800	30,380.00	0.02
321	003042	中农联合	2,500	30,375.00	0.02
322	301001	凯淳股份	1,400	30,338.00	0.02
323	301192	泰祥股份	1,600	30,240.00	0.02
324	301063	海锅股份	1,800	30,168.00	0.02
325	688067	爱威科技	1,494	30,104.10	0.02
326	300892	品渥食品	1,600	30,048.00	0.02
327	688004	博汇科技	1,649	30,011.80	0.02
328	300906	日月明	1,200	29,916.00	0.02
329	688118	普元信息	1,484	29,858.08	0.02
330	301515	港通医疗	1,700	29,801.00	0.02
331	688613	奥精医疗	2,111	29,786.21	0.02
332	688092	爱科科技	1,402	29,778.48	0.02
333	688695	中创股份	1,589	29,714.30	0.02
334	301272	英华特	900	29,646.00	0.02
335	301258	富士莱	1,300	29,601.00	0.02
336	688395	正弦电气	1,339	29,591.90	0.02
337	688635	长进光子	96	29,586.24	0.02
338	688060	云涌科技	895	29,436.55	0.02
339	688393	安必平	1,655	29,425.90	0.02
340	688217	睿昂基因	1,422	29,378.52	0.02
341	688058	宝兰德	1,397	29,225.24	0.02
342	688329	艾隆科技	1,442	29,142.82	0.02
343	300844	山水比德	1,300	28,873.00	0.01
344	300219	鸿利智汇	2,700	28,161.00	0.01
345	002458	益生股份	3,600	27,972.00	0.01
346	688327	云从科技	2,242	27,935.32	0.01
347	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.01
348	600884	杉杉股份	1,900	25,745.00	0.01
349	301536	星宸科技	200	25,742.00	0.01
350	300315	掌趣科技	6,400	24,960.00	0.01
351	600845	宝信软件	1,500	24,945.00	0.01
352	001257	盛龙股份	1,133	23,498.42	0.01
353	000703	恒逸石化	1,700	23,069.00	0.01
354	300491	通合科技	600	22,914.00	0.01
355	600366	宁波韵升	1,500	22,020.00	0.01
356	002838	道恩股份	700	21,434.00	0.01
357	300456	赛微电子	500	21,235.00	0.01
358	002635	安洁科技	1,000	20,450.00	0.01
359	300284	苏交科	4,000	20,000.00	0.01
360	603010	万盛股份	1,100	19,932.00	0.01
361	688811	有研新材	812	19,593.56	0.01
362	002468	申通快递	1,300	18,928.00	0.01
363	300999	金龙鱼	800	18,608.00	0.01

364	300406	九强生物	1,700	18,581.00	0.01
365	688549	中巨芯	493	18,147.33	0.01
366	002545	东方铁塔	1,100	17,842.00	0.01
367	688580	伟思医疗	332	17,685.64	0.01
368	688410	山外山	1,231	17,677.16	0.01
369	300085	银之杰	500	17,485.00	0.01
370	300324	旋极信息	4,600	17,112.00	0.01
371	002584	西陇科学	1,800	17,064.00	0.01
372	300188	国投智能	1,800	16,830.00	0.01
373	300674	宇信科技	1,100	16,555.00	0.01
374	300613	富瀚微	200	16,016.00	0.01
375	300079	数码视讯	3,600	15,120.00	0.01
376	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
377	002810	山东赫达	600	14,820.00	0.01
378	603459	红板科技	175	14,756.00	0.01
379	301696	三瑞智能	168	14,582.40	0.01
380	688689	银河微电	225	14,562.00	0.01
381	300047	天源迪科	1,600	14,208.00	0.01
382	688321	微芯生物	520	13,691.60	0.01
383	300253	卫宁健康	2,000	13,460.00	0.01
384	002606	大连电瓷	1,000	13,410.00	0.01
385	300481	濮阳惠成	700	13,314.00	0.01
386	002653	海思科	200	13,268.00	0.01
387	002017	东信和平	900	13,167.00	0.01
388	300050	世纪鼎利	2,200	13,024.00	0.01
389	300360	炬华科技	1,100	12,925.00	0.01
390	688548	广钢气体	247	12,868.70	0.01
391	301580	爱迪特	200	12,866.00	0.01
392	300098	高新兴	2,800	12,852.00	0.01
393	000682	东方电子	1,000	12,630.00	0.01
394	300206	理邦仪器	1,000	12,230.00	0.01
395	301669	高特电子	424	12,041.60	0.01
396	301316	慧博云通	300	11,814.00	0.01
397	301680	固德电材	105	11,776.80	0.01
398	002980	华盛昌	100	11,654.00	0.01
399	300031	宝通科技	400	11,428.00	0.01
400	002439	启明星辰	900	11,385.00	0.01
401	603489	八方股份	400	11,184.00	0.01
402	000885	城发环境	900	10,827.00	0.01
403	603396	金辰股份	400	10,600.00	0.01
404	300168	万达信息	2,300	10,557.00	0.01
405	600528	中铁工业	1,600	10,544.00	0.01
406	002643	万润股份	500	10,475.00	0.01
407	301599	理奇智能	317	10,292.99	0.01

408	603507	振江股份	300	9,867.00	0.01
409	300737	科顺股份	1,500	9,855.00	0.01
410	600335	国机汽车	2,100	9,828.00	0.01
411	603125	常青科技	300	9,822.00	0.01
412	300827	上能电气	300	9,237.00	0.00
413	301216	万凯新材	400	9,196.00	0.00
414	688106	金宏气体	209	8,669.32	0.00
415	300468	四方精创	400	8,404.00	0.00
416	688816	易思维	137	7,822.70	0.00
417	000989	九芝堂	1,000	7,770.00	0.00
418	000676	智度股份	1,500	7,665.00	0.00
419	688050	爱博医疗	208	7,581.60	0.00
420	001365	天海电子	242	7,577.02	0.00
421	301307	美利信	100	7,529.00	0.00
422	601138	工业富联	100	7,215.00	0.00
423	301683	慧谷新材	59	7,184.43	0.00
424	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
425	300357	我武生物	300	6,996.00	0.00
426	001393	维通利	173	6,745.27	0.00
427	300414	中光防雷	600	6,612.00	0.00
428	601069	西部黄金	300	6,600.00	0.00
429	601112	振石股份	354	6,226.86	0.00
430	301339	通行宝	600	6,138.00	0.00
431	002135	东南网架	900	6,111.00	0.00
432	300531	优博讯	400	6,060.00	0.00
433	300277	汽轮科技	400	6,016.00	0.00
434	603225	新凤鸣	300	5,895.00	0.00
435	002390	信邦制药	2,200	5,742.00	0.00
436	000915	华特达因	200	5,662.00	0.00
437	001237	惠康科技	96	5,639.04	0.00
438	002382	蓝帆医疗	1,100	5,588.00	0.00
439	300026	红日药业	1,900	5,510.00	0.00
440	002734	利民股份	300	5,151.00	0.00
441	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00
442	603156	养元饮品	100	4,907.00	0.00
443	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
444	300439	美康生物	600	4,818.00	0.00
445	600201	生物股份	400	4,660.00	0.00
446	002772	众兴菌业	400	4,544.00	0.00
447	002320	海峡股份	700	4,389.00	0.00
448	300579	数字认证	200	4,140.00	0.00
449	600285	羚锐制药	200	3,876.00	0.00
450	601975	招商南油	1,000	3,730.00	0.00
451	300725	药石科技	100	3,660.00	0.00

452	000877	天山股份	1,000	3,630.00	0.00
453	300682	朗新科技	300	2,970.00	0.00
454	000973	佛塑科技	200	2,870.00	0.00
455	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
456	002712	思美传媒	600	2,490.00	0.00
457	300213	佳讯飞鸿	400	2,424.00	0.00
458	600808	马钢股份	900	2,250.00	0.00
459	300287	飞利信	700	2,247.00	0.00
460	300353	东土科技	100	2,078.00	0.00
461	600775	南京熊猫	200	1,912.00	0.00
462	601001	晋控煤业	100	1,739.00	0.00
463	600728	佳都科技	400	1,704.00	0.00
464	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
465	603293	埃泰克	47	1,594.71	0.00
466	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
467	001312	福恩股份	93	1,560.54	0.00
468	300925	法本信息	100	1,479.00	0.00
469	002123	梦网科技	200	1,438.00	0.00
470	300590	移为通信	100	1,435.00	0.00
471	301090	华润材料	200	1,254.00	0.00
472	002376	新北洋	200	1,150.00	0.00
473	000553	安道麦 A	200	1,070.00	0.00
474	002115	三维通信	100	1,030.00	0.00
475	003017	大洋生物	40	920.00	0.00
476	300133	华策影视	100	708.00	0.00
477	002467	二六三	100	467.00	0.00
478	300451	创业慧康	100	320.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	3,510,968.41	0.75
2	300308	中际旭创	3,462,833.00	0.74
3	300750	宁德时代	2,988,294.16	0.64
4	600276	恒瑞医药	2,937,277.00	0.63
5	600010	宝钢股份	2,746,872.00	0.59
6	600487	亨通光电	2,635,576.00	0.57
7	600309	万华化学	2,603,121.34	0.56
8	603876	鼎胜新材	2,502,403.00	0.54
9	300408	三环集团	2,468,982.00	0.53
10	002384	东山精密	2,421,611.00	0.52

11	601899	紫金矿业	2,385,691.00	0.51
12	600111	北方稀土	2,381,269.00	0.51
13	002714	牧原股份	2,290,784.00	0.49
14	300274	阳光电源	2,280,543.00	0.49
15	601919	中远海控	2,243,450.00	0.48
16	300394	天孚通信	2,183,197.20	0.47
17	002851	麦格米特	2,137,928.00	0.46
18	601600	中国铝业	2,134,513.00	0.46
19	000001	平安银行	2,112,911.00	0.45
20	601233	桐昆股份	2,100,015.00	0.45

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	11,918,033.00	2.56
2	600519	贵州茅台	9,910,880.00	2.13
3	300308	中际旭创	8,909,895.00	1.91
4	601318	中国平安	7,211,952.00	1.55
5	601899	紫金矿业	6,895,625.00	1.48
6	600036	招商银行	5,885,352.29	1.26
7	300502	新易盛	5,483,831.08	1.18
8	601166	兴业银行	5,353,454.00	1.15
9	000333	美的集团	4,630,214.00	0.99
10	002475	立讯精密	4,443,884.00	0.95
11	300274	阳光电源	4,177,270.00	0.90
12	603259	药明康德	4,154,180.00	0.89
13	601600	中国铝业	3,883,947.00	0.83
14	600150	中国船舶	3,855,533.00	0.83
15	600031	三一重工	3,838,627.00	0.82
16	600900	长江电力	3,801,487.00	0.82
17	600276	恒瑞医药	3,799,666.72	0.82
18	601398	工商银行	3,666,597.72	0.79
19	688256	寒武纪	3,551,696.45	0.76
20	002594	比亚迪	3,496,780.00	0.75

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	587,677,920.31
卖出股票收入（成交）总额	830,004,174.68

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	9,000.39	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,000.39	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	113704	春风转债	90	9,000.39	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	198,865.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,322,607.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,521,473.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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 A500 量化增强 A	2,240	50,184.79	0.00	0.00%	112,413,925.40	100.00%
易方达中证 A500 量化增强 C	1,970	28,082.38	5,376,300.39	9.72%	49,945,997.93	90.28%
合计	4,210	39,842.33	5,376,300.39	3.21%	162,359,923.33	96.79%

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 A500 量化增强 A	29,983.69	0.0267%
	易方达中证 A500 量化增强 C	0.00	0.0000%
	合计	29,983.69	0.0179%

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 A500 量化增强 A	0
	易方达中证 A500 量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证 A500 量化增强 A	0
	易方达中证 A500 量化增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 A500 量化增强 A	易方达中证 A500 量化增强 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 4 日）基金份额总额	387,639,940.17	82,894,895.13
本报告期期初基金份额总额	377,987,804.25	83,279,972.75
本报告期基金总申购份额	73,797,523.43	65,152,322.89
减：本报告期基金总赎回份额	339,371,402.28	93,109,997.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	112,413,925.40	55,322,298.32

§ 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	
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	660,340,234.86	46.62%	66,040.03	46.63%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	755,944,180.15	53.38%	75,594.80	53.37%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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财通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国联民生证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华福证券股份有限公司、摩根大通证券（中国）有限公司、平安证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司。

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

- c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：
- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
 - 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	证券时报、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	证券时报、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关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-15

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	证券时报、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公司旗下部分基金估值调整情况的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-21
6	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
7	关于易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金 2026 年因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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
8	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
9	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
10	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	证券时报	2026-04-22
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
12	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
13	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
14	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
15	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23
17	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26

§ 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 A500 指数量化增强型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 A500 指数量化增强型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

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