

易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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：二〇二五年八月三十日

§ 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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51

§ 8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动.....	53
§ 10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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	58
§ 12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	易方达易百智能量化策略混合	
基金主代码	005437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 1 月 24 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	159,380,468.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
下属分级基金的交易代码	005437	005438
报告期末下属分级基金的份额总额	117,693,121.33 份	41,687,347.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要依托于百度提供的特色数据及其数据处理能力，通过大数据挖掘和分析技术，结合基金管理人自主研发的量化策略进行投资组合管理，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要借助百度在人工智能技术和算法方面的优势，同时结合其特有的互联网大数据，对证券市场相关数据进行深度分析，在海外成熟的多因子量化选股框架下扩充因子维度，对股票超额收益进行预测，并据此筛选具有投资价值的股票构建投资组合。同时，本基金也可应用定向增发套利与大宗交易套利等多种量化套利策略，根据各策略的预期收益、风险及其所使用的市场环境，发现和捕捉因市场波动及无效定价带来的价差机会，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+中债新综合指数（财富）收益率×35%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼； 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	510620； 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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 40-43 楼；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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
本期已实现收益	14,224,579.98	4,028,738.86
本期利润	20,620,838.21	5,555,536.36
加权平均基金份额本期利润	0.2367	0.2332
本期加权平均净值利润率	20.33%	20.44%
本期基金份额净值增长率	22.35%	22.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
期末可供分配利润	32,820,168.80	10,496,175.30

期末可供分配基金份额利润	0.2789	0.2518
期末基金资产净值	152,615,599.23	52,869,002.80
期末基金份额净值	1.2967	1.2682
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
	基金份额累计净值增长率	29.67% 26.82%

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

易方达易百智能量化策略混合 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
过去一个月	8.00%	0.97%	1.80%	0.37%	6.20%	0.60%
过去三个月	11.87%	1.85%	1.50%	0.69%	10.37%	1.16%
过去六个月	22.35%	1.60%	0.54%	0.65%	21.81%	0.95%
过去一年	57.94%	1.86%	11.12%	0.89%	46.82%	0.97%
过去三年	-7.03%	1.82%	-2.34%	0.71%	-4.69%	1.11%
自基金合同生效起至今	29.67%	1.61%	9.45%	0.80%	20.22%	0.81%

易方达易百智能量化策略混合 C

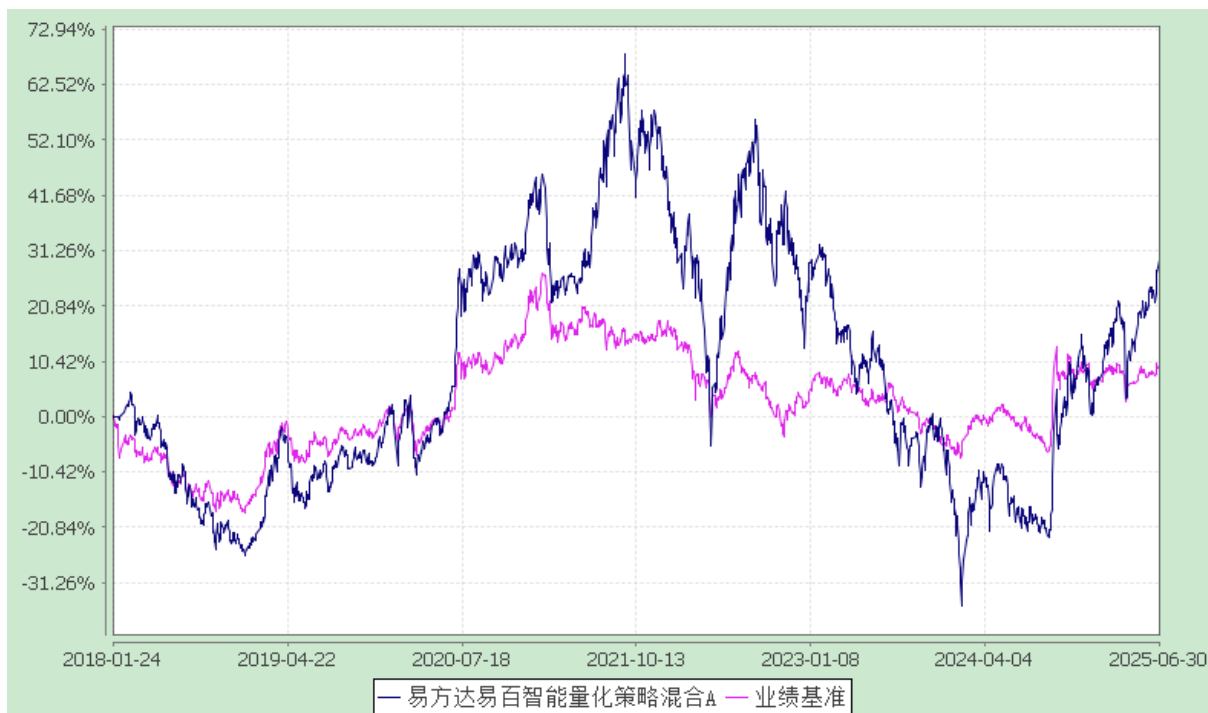
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	7.98%	0.97%	1.80%	0.37%	6.18%	0.60%
过去三个月	11.79%	1.85%	1.50%	0.69%	10.29%	1.16%
过去六个月	22.18%	1.60%	0.54%	0.65%	21.64%	0.95%
过去一年	57.48%	1.86%	11.12%	0.89%	46.36%	0.97%
过去三年	-7.85%	1.82%	-2.34%	0.71%	-5.51%	1.11%
自基金合同生效起至今	26.82%	1.61%	9.45%	0.80%	17.37%	0.81%

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

易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 1 月 24 日至 2025 年 6 月 30 日)

易方达易百智能量化策略混合 A



易方达易百智能量化策略混合 C



注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 29.67%，同期业绩比较基准收益

率为 9.45%；C 类基金份额净值增长率为 26.82%，同期业绩比较基准收益率为 9.45%。

§ 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、投资顾问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		
殷明	本基金的基金经理，易方达中证 1000 量化增强、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达上证科创板综合增强的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员	2021-03-20	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，国盛证券有限责任公司研究所金融工程分析师，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。

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

4.3 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 38 次，其中 31 次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，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

2025 年市场先抑后扬。从行业表现看，上半年新能源产业链受全球能源转型加速推动，光伏、储能板块因技术迭代和海外需求爆发表现亮眼；人工智能领域在通用大模型商业化落地带动下，算力基础设施、AI 应用端涨幅显著。传统制造业受原材料价格波动影响，钢铁、纺织行业表现承压；房地产板块因库存去化缓慢持续低迷。

在量化因子领域，上半年动量因子和低波动因子表现突出，受益于市场趋势延续性增强和资金避险情绪升温，前期涨幅居前且波动率低的标的持续获得资金青睐。随着二季度经济复苏预期强化，盈利因子和杠杆因子权重上升，营收增速超预期、资产周转效率高的企业更受关注，反映市场风险偏好逐步回升。

2025 年，面对市场结构分化加剧的环境，我们进一步升级投资策略：通过深度学习算法优化因子组合权重，提升模型对行业轮动的捕捉能力；融合产业链、舆情等多模态数据，构建动态风险预警模型，在控制回撤的同时提升组合进攻性，进一步增强策略收益稳定性。

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 1.2967 元，本报告期份额净值增长率为 22.35%，同期业绩比较基准收益率为 0.54%；C 类基金份额净值为 1.2682 元，本报告期份额净值增长率为 22.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.54%。

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 2025 年下半年，我们从宏观经济与证券市场两个维度进行分析。宏观层面，国内经济在政

策协同发力与结构性改革深化的双重驱动下，将呈现稳中有进、质效提升的发展格局。适度宽松的货币政策将保持流动性合理充裕，预计下半年仍有降准降息空间，同时新型结构性工具将精准滴灌实体经济；财政政策通过扩大超长期特别国债发行和专项债投向领域，重点支持“两重两新”的建设，加速传统基建与新基建融合发展。中美经贸关系阶段性缓和背景下，外部不确定性边际下降，叠加双循环战略纵深推进，内需对经济增长的贡献率预计将继续提升，消费升级与服务消费如文旅、康养等成为核心驱动力。

证券市场方面，政策红利释放与资金面改善将支撑市场结构性行情。资本市场改革深化推动市场韧性提升，行业配置需紧扣消费、科技、产业、红利四大主线：一是内需驱动的消费板块，重点关注智能家居、国货潮品等新型消费场景，以及文旅、康养等服务消费扩容机遇；二是自主可控的科技板块，聚焦半导体设备、工业软件、创新药等“卡脖子”领域，叠加人工智能应用场景拓展带来的估值重塑机会；三是制造业升级的产业板块，智能机器人、军工、低空经济等新应用场景有望催生技术迭代红利；四是具备防御属性的红利板块，高股息国企与公用事业在波动市中提供安全边际。

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

易方达易百智能量化策略混合 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达易百智能量化策略混合 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”）在易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	15,583,016.03	5,122,016.37
结算备付金		2,291,122.00	835,466.86
存出保证金		65,785.96	30,607.54
交易性金融资产	6.4.7.2	188,265,098.58	73,835,016.93
其中：股票投资		188,265,098.58	73,835,016.93
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	158,218.91
应收股利		-	-
应收申购款		3,827,173.31	261,564.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		210,032,195.88	80,242,891.02
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		3,599,578.33	12,302.16
应付赎回款		676,537.30	577,930.01
应付管理人报酬		179,157.05	82,038.83
应付托管费		29,859.54	13,673.15
应付销售服务费		10,021.57	4,087.42
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	52,440.06	105,312.72
负债合计		4,547,593.85	795,344.29
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	159,380,468.65	75,292,277.51
未分配利润	6.4.7.8	46,104,133.38	4,155,269.22
净资产合计		205,484,602.03	79,447,546.73
负债和净资产总计		210,032,195.88	80,242,891.02

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.2967 元，C 类基金份额净值 1.2682 元；基金份额总额 159,380,468.65 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 117,693,121.33 份，C 类基金份额总额 41,687,347.32 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		27,174,640.78	-7,677,364.86
1.利息收入		17,727.70	10,462.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,727.70	10,462.77
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）		19,137,759.52	-8,941,118.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	17,932,213.93	-9,484,897.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	1,205,545.59	543,778.76
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	7,923,055.73	1,219,863.85
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	96,097.83	33,427.15
减：二、营业总支出		998,266.21	497,447.32
1. 管理人报酬		756,295.59	349,022.81
2. 托管费		126,049.29	58,170.40
3. 销售服务费		39,794.79	14,783.30
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	76,126.54	75,470.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,176,374.57	-8,174,812.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,176,374.57	-8,174,812.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		26,176,374.57	-8,174,812.18

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	75,292,277.51	4,155,269.22	79,447,546.73
二、本期期初净资产	75,292,277.51	4,155,269.22	79,447,546.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	84,088,191.14	41,948,864.16	126,037,055.30
（一）、综合收益总额	-	26,176,374.57	26,176,374.57
（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）	84,088,191.14	15,772,489.59	99,860,680.73
其中：1.基金申购款	125,198,578.83	21,937,180.68	147,135,759.51
2.基金赎回款	-41,110,387.69	-6,164,691.09	-47,275,078.78
（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	159,380,468.65	46,104,133.38	205,484,602.03
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	71,441,740.99	-4,807,459.62	66,634,281.37
二、本期期初净资产	71,441,740.99	-4,807,459.62	66,634,281.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,392,289.01	-7,555,660.80	-10,947,949.81
（一）、综合收益总额	-	-8,174,812.18	-8,174,812.18

（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）	-3,392,289.01	619,151.38	-2,773,137.63
其中：1.基金申购款	9,985,102.38	-1,695,564.44	8,289,537.94
2.基金赎回款	-13,377,391.39	2,314,715.82	-11,062,675.57
（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	68,049,451.98	-12,363,120.42	55,686,331.56

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

易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金(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[2017]2163 号《关于准予易方达易百智能量化策略灵活配置混合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《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 794,754,696.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 449,820.67 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

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

《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增

值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	15,583,016.03
等于：本金	15,581,898.46
加：应计利息	1,117.57
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	15,583,016.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		184,469,214.21	-	188,265,098.58	3,795,884.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		184,469,214.21	-	188,265,098.58	3,795,884.37

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	371.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	52,068.27
合计	52,440.06

6.4.7.7 实收基金

易方达易百智能量化策略混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,263,650.21	59,263,650.21
本期申购	73,696,748.98	73,696,748.98
本期赎回（以“-”号填列）	-15,267,277.86	-15,267,277.86
本期末	117,693,121.33	117,693,121.33

易方达易百智能量化策略混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,028,627.30	16,028,627.30
本期申购	51,501,829.85	51,501,829.85
本期赎回（以“-”号填列）	-25,843,109.83	-25,843,109.83
本期末	41,687,347.32	41,687,347.32

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

易方达易百智能量化策略混合 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	7,972,800.27	-4,427,310.93	3,545,489.34
本期期初	7,972,800.27	-4,427,310.93	3,545,489.34
本期利润	14,224,579.98	6,396,258.23	20,620,838.21
本期基金份额交易产生的变动数	10,622,788.55	133,361.80	10,756,150.35
其中：基金申购款	13,515,499.52	-92,523.64	13,422,975.88
基金赎回款	-2,892,710.97	225,885.44	-2,666,825.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,820,168.80	2,102,309.10	34,922,477.90

易方达易百智能量化策略混合 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	1,798,506.22	-1,188,726.34	609,779.88
本期期初	1,798,506.22	-1,188,726.34	609,779.88
本期利润	4,028,738.86	1,526,797.50	5,555,536.36
本期基金份额交易产生的变动数	4,668,930.22	347,409.02	5,016,339.24
其中：基金申购款	8,870,585.37	-356,380.57	8,514,204.80
基金赎回款	-4,201,655.15	703,789.59	-3,497,865.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,496,175.30	685,480.18	11,181,655.48

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,817.64
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	2,621.19
其他	288.87
合计	17,727.70

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	17,932,213.93
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	17,932,213.93

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,370,920,440.79
减：卖出股票成本总额	1,352,121,280.17
减：交易费用	866,946.69
买卖股票差价收入	17,932,213.93

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,205,545.59
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	1,205,545.59
----	--------------

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	7,923,055.73
——股票投资	7,923,055.73
——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	7,923,055.73

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	96,097.83
合计	96,097.83

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,458.27
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	76,126.54

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	756,295.59	349,022.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	202,746.99	81,272.17

应支付基金管理人的净管理费	553,548.60	267,750.64
---------------	------------	------------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	126,049.29	58,170.40

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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 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		
	易方达易百智能量化策略 混合A	易方达易百智能量化策略 混合C	合计
易方达基金管理有限公司	-	12,151.82	12,151.82
中国银行	-	3,583.75	3,583.75
广发证券	-	208.22	208.22
合计	-	15,943.79	15,943.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达易百智能量化策略	易方达易百智能量化策略	合计

	混合A	混合C	
易方达基金管理有限公司	-	5,765.39	5,765.39
中国银行	-	1,233.35	1,233.35
广发证券	-	18.23	18.23
合计	-	7,016.97	7,016.97

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

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付。

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

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	易方达易百智能量化策略混合A	易方达易百智能量化策略混合C	易方达易百智能量化策略混合A	易方达易百智能量化策略混合C
报告期初持有的基金份额	23,782,305.37	-	23,782,305.37	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	23,782,305.37	-	23,782,305.37	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	20.2070%	-	42.1515%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

易方达易百智能量化策略混合 A

无。

易方达易百智能量化策略混合 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		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	15,583,016.03	14,817.64	3,605,637.65	6,741.98

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

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

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达易百智能量化策略混合 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达易百智能量化策略混合 C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2025 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
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月以内	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	37	3,315.20	5,160.76	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	250	3,200.00	11,135.00	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	77	2,040.50	2,516.36	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	23	2,150.50	2,085.18	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	196	4,462.92	7,708.68	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	137	6,475.99	17,009.92	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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 2025 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。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 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、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%(2024 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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025 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，组合变现比例能力较好。

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 2025 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	15,583,016.03	-	-	-	15,583,016.03
结算备付金	2,291,122.00	-	-	-	2,291,122.00
存出保证金	65,785.96	-	-	-	65,785.96
交易性金融资产	-	-	-	188,265,098.58	188,265,098.58
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	-	-	-	3,827,173.31	3,827,173.31

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,939,923.99	-	-	192,092,271.89	210,032,195.88
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	-	-	-	3,599,578.33	3,599,578.33
应付赎回款	-	-	-	676,537.30	676,537.30
应付管理人报酬	-	-	-	179,157.05	179,157.05
应付托管费	-	-	-	29,859.54	29,859.54
应付销售服务费	-	-	-	10,021.57	10,021.57
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	-	-	-	52,440.06	52,440.06
负债总计	-	-	-	4,547,593.85	4,547,593.85
利率敏感度缺口	17,939,923.99	-	-	187,544,678.04	205,484,602.03
上年度末 2024 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	5,122,016.37	-	-	-	5,122,016.37
结算备付金	835,466.86	-	-	-	835,466.86
存出保证金	30,607.54	-	-	-	30,607.54
交易性金融资产	-	-	-	73,835,016.93	73,835,016.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	158,218.91	158,218.91
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	261,564.41	261,564.41

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,988,090.77	-	-	74,254,800.25	80,242,891.02
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	-	-	-	12,302.16	12,302.16
应付赎回款	-	-	-	577,930.01	577,930.01
应付管理人报酬	-	-	-	82,038.83	82,038.83
应付托管费	-	-	-	13,673.15	13,673.15
应付销售服务费	-	-	-	4,087.42	4,087.42
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	-	-	-	105,312.72	105,312.72
负债总计	-	-	-	795,344.29	795,344.29
利率敏感度缺口	5,988,090.77	-	-	73,459,455.96	79,447,546.73

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	188,265,098.58	91.62	73,835,016.93	92.94
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	188,265,098.58	91.62	73,835,016.93	92.94

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	17,265,916.43	6,637,974.97
	2.业绩比较基准下降 5%	-17,265,916.43	-6,637,974.97

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
---------------	-----

	2025 年 6 月 30 日
第一层次	188,199,249.02
第二层次	15,385.54
第三层次	50,464.02
合计	188,265,098.58

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	188,265,098.58	89.64
	其中：股票	188,265,098.58	89.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	17,874,138.03	8.51
8	其他各项资产	3,892,959.27	1.85
9	合计	210,032,195.88	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

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	856,492.00	0.42
B	采矿业	1,695,411.00	0.83
C	制造业	137,403,137.62	66.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,279,480.00	2.08
E	建筑业	850,498.00	0.41
F	批发和零售业	6,019,800.00	2.93
G	交通运输、仓储和邮政业	2,574,481.00	1.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,160,989.85	8.84
J	金融业	2,532,397.00	1.23
K	房地产业	2,573,157.81	1.25
L	租赁和商务服务业	2,583,506.00	1.26
M	科学研究和技术服务业	5,235,953.30	2.55
N	水利、环境和公共设施管理业	888,272.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,611,523.00	1.27
S	综合	-	-
	合计	188,265,098.58	91.62

7.3 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	601218	吉鑫科技	227,800	936,258.00	0.46
2	300885	海昌新材	66,700	934,467.00	0.45
3	688233	神工股份	29,341	932,163.57	0.45
4	603859	能科科技	28,700	927,584.00	0.45
5	688273	麦澜德	30,650	925,936.50	0.45
6	002725	跃岭股份	70,100	923,918.00	0.45
7	600862	中航高科	34,800	907,584.00	0.44
8	603456	九洲药业	59,200	900,432.00	0.44
9	301036	双乐股份	24,000	898,080.00	0.44
10	603938	三孚股份	62,200	894,436.00	0.44
11	605068	明新旭腾	49,600	891,312.00	0.43
12	688708	佳驰科技	16,069	888,455.01	0.43
13	600343	航天动力	71,700	888,363.00	0.43
14	000803	山高环能	144,200	888,272.00	0.43
15	688580	伟思医疗	19,096	887,773.04	0.43
16	603636	南威软件	70,200	887,328.00	0.43
17	002727	一心堂	54,300	887,262.00	0.43
18	603969	银龙股份	120,900	886,197.00	0.43
19	301333	诺思格	18,500	884,485.00	0.43
20	603458	勘设股份	111,700	883,547.00	0.43
21	603466	风语筑	87,500	882,875.00	0.43
22	300286	安科瑞	39,100	882,487.00	0.43
23	688270	臻镭科技	18,946	882,125.76	0.43
24	301298	东利机械	53,300	880,516.00	0.43
25	301505	苏州规划	40,298	880,511.30	0.43
26	688722	同益中	41,348	879,471.96	0.43
27	688251	井松智能	40,754	878,656.24	0.43
28	605080	浙江自然	31,500	875,700.00	0.43
29	688571	杭华股份	113,566	875,593.86	0.43
30	600216	浙江医药	59,200	875,568.00	0.43
31	603326	我乐家居	105,700	875,196.00	0.43
32	002933	新兴装备	24,500	875,140.00	0.43
33	002209	达意隆	69,700	874,735.00	0.43
34	000657	中钨高新	73,700	874,082.00	0.43
35	605168	三人行	29,700	874,071.00	0.43
36	600105	永鼎股份	108,000	873,720.00	0.43
37	002111	威海广泰	81,400	873,422.00	0.43
38	002297	博云新材	109,100	872,800.00	0.42
39	002760	凤形股份	45,100	872,685.00	0.42
40	603311	金海高科	78,900	872,634.00	0.42
41	300160	秀强股份	155,200	872,224.00	0.42

42	603086	先达股份	89,000	872,200.00	0.42
43	002174	游族网络	71,900	872,147.00	0.42
44	688280	精进电动	119,963	872,131.01	0.42
45	688550	瑞联新材	20,276	872,070.76	0.42
46	603189	网达软件	50,200	871,974.00	0.42
47	603109	神驰机电	31,200	871,728.00	0.42
48	605567	春雪食品	85,200	871,596.00	0.42
49	300826	测绘股份	50,900	871,408.00	0.42
50	688685	迈信林	15,601	871,315.85	0.42
51	300739	明阳电路	58,700	871,108.00	0.42
52	301220	亚香股份	19,400	871,060.00	0.42
53	002632	道明光学	93,600	870,480.00	0.42
54	300105	龙源技术	112,900	870,459.00	0.42
55	300206	理邦仪器	72,400	870,248.00	0.42
56	002885	京泉华	61,500	870,225.00	0.42
57	603926	铁流股份	76,600	870,176.00	0.42
58	688711	宏微科技	49,463	870,054.17	0.42
59	001316	润贝航科	19,100	869,241.00	0.42
60	688161	威高骨科	32,436	868,960.44	0.42
61	300019	硅宝科技	44,000	868,560.00	0.42
62	300182	捷成股份	157,500	867,825.00	0.42
63	688106	金宏气体	48,505	867,754.45	0.42
64	600203	福日电子	92,700	867,672.00	0.42
65	603090	宏盛股份	35,600	867,572.00	0.42
66	300727	润禾材料	33,000	867,570.00	0.42
67	600685	中船防务	31,900	867,361.00	0.42
68	300017	网宿科技	80,900	867,248.00	0.42
69	300543	朗科智能	80,600	866,450.00	0.42
70	688400	凌云光	31,419	866,221.83	0.42
71	301069	凯盛新材	53,769	866,218.59	0.42
72	300053	航宇微	65,600	865,920.00	0.42
73	688661	和林微纳	21,772	865,872.44	0.42
74	601567	三星医疗	38,600	865,412.00	0.42
75	300519	新光药业	58,300	865,172.00	0.42
76	002363	隆基机械	113,600	864,496.00	0.42
77	002587	奥拓电子	134,000	864,300.00	0.42
78	300154	瑞凌股份	96,000	864,000.00	0.42
79	300365	恒华科技	131,100	863,949.00	0.42
80	001319	铭科精技	33,000	863,940.00	0.42
81	300382	斯莱克	56,800	863,928.00	0.42
82	002395	双象股份	48,800	863,760.00	0.42
83	300724	捷佳伟创	15,900	863,370.00	0.42
84	300871	回盛生物	41,300	863,170.00	0.42

85	301329	信音电子	44,300	862,964.00	0.42
86	002355	兴民智通	108,400	862,864.00	0.42
87	688667	菱电电控	16,216	862,853.36	0.42
88	600476	湘邮科技	45,700	862,816.00	0.42
89	003025	思进智能	63,720	862,768.80	0.42
90	002893	京能热力	80,700	862,683.00	0.42
91	301065	本立科技	39,100	862,546.00	0.42
92	002692	远程股份	174,600	862,524.00	0.42
93	301226	祥明智能	31,500	862,470.00	0.42
94	300658	延江股份	133,300	862,451.00	0.42
95	600996	贵广网络	103,400	862,356.00	0.42
96	301228	实朴检测	30,600	862,002.00	0.42
97	600106	重庆路桥	140,600	861,878.00	0.42
98	002782	可立克	66,400	861,872.00	0.42
99	002009	天奇股份	56,000	861,840.00	0.42
100	301337	亚华电子	29,500	861,695.00	0.42
101	000757	浩物股份	190,200	861,606.00	0.42
102	000421	南京公用	131,100	861,327.00	0.42
103	002931	锋龙股份	54,000	861,300.00	0.42
103	600237	铜峰电子	118,800	861,300.00	0.42
105	300241	瑞丰光电	151,100	861,270.00	0.42
106	301526	国际复材	236,600	861,224.00	0.42
107	601019	山东出版	90,900	860,823.00	0.42
108	300279	和晶科技	124,200	860,706.00	0.42
109	601126	四方股份	52,900	860,683.00	0.42
110	000573	粤宏远 A	214,100	860,682.00	0.42
111	300088	长信科技	144,400	860,624.00	0.42
112	003033	征和工业	20,300	860,517.00	0.42
113	300916	朗特智能	29,600	860,472.00	0.42
114	002198	嘉应制药	139,900	860,385.00	0.42
115	603985	恒润股份	55,200	860,016.00	0.42
116	002600	领益智造	100,100	859,859.00	0.42
117	603919	金徽酒	47,500	859,750.00	0.42
118	600579	中化装备	107,600	859,724.00	0.42
119	300573	兴齐眼药	16,600	859,714.00	0.42
120	300448	浩云科技	126,800	859,704.00	0.42
121	300666	江丰电子	11,600	859,560.00	0.42
122	300768	迪普科技	50,100	859,215.00	0.42
123	300306	远方信息	66,500	859,180.00	0.42
124	605116	奥锐特	41,100	858,990.00	0.42
125	688508	芯朋微	15,386	858,846.52	0.42
126	603066	音飞储存	71,800	858,728.00	0.42
127	600736	苏州高新	160,500	858,675.00	0.42

128	002611	东方精工	71,200	858,672.00	0.42
129	600558	大西洋	165,100	858,520.00	0.42
130	000708	中信特钢	73,000	858,480.00	0.42
131	688289	圣湘生物	41,917	858,460.16	0.42
132	002215	诺普信	83,100	858,423.00	0.42
133	603231	索宝蛋白	52,400	858,312.00	0.42
134	600410	华胜天成	89,500	858,305.00	0.42
135	002380	科远智慧	35,100	858,195.00	0.42
136	300656	民德电子	32,100	858,033.00	0.42
137	605369	拱东医疗	45,180	857,968.20	0.42
138	603500	祥和实业	93,620	857,559.20	0.42
139	002646	天佑德酒	92,400	857,472.00	0.42
140	688328	深科达	37,856	857,438.40	0.42
141	300074	华平股份	175,700	857,416.00	0.42
142	300141	和顺电气	93,500	857,395.00	0.42
143	688625	呈和科技	28,037	857,371.46	0.42
144	002890	弘宇股份	65,000	857,350.00	0.42
145	600050	中国联通	160,500	857,070.00	0.42
146	603330	天洋新材	126,400	856,992.00	0.42
147	600771	广誉远	42,500	856,800.00	0.42
148	600728	佳都科技	157,200	856,740.00	0.42
149	300249	依米康	62,800	856,592.00	0.42
150	600359	新农开发	118,300	856,492.00	0.42
151	301486	致尚科技	12,400	856,468.00	0.42
152	000725	京东方 A	214,600	856,254.00	0.42
153	300864	南大环境	42,900	855,855.00	0.42
154	002793	罗欣药业	184,400	855,616.00	0.42
155	000717	中南股份	350,600	855,464.00	0.42
156	688339	亿华通	40,064	855,366.40	0.42
157	603053	成都燃气	89,000	855,290.00	0.42
158	688588	凌志软件	58,701	855,273.57	0.42
159	002382	蓝帆医疗	152,700	855,120.00	0.42
160	300534	陇神戎发	88,500	854,910.00	0.42
161	600707	彩虹股份	132,300	854,658.00	0.42
162	300259	新天科技	240,700	854,485.00	0.42
163	300231	银信科技	69,400	854,314.00	0.42
164	002491	通鼎互联	150,400	854,272.00	0.42
165	300146	汤臣倍健	76,000	854,240.00	0.42
166	301289	国缆检测	17,500	854,000.00	0.42
167	605050	福然德	62,100	853,875.00	0.42
168	002419	天虹股份	159,300	853,848.00	0.42
169	000514	渝开发	188,477	853,800.81	0.42
170	000906	浙商中拓	134,000	853,580.00	0.42

171	002695	煌上煌	90,800	853,520.00	0.42
172	603703	盛洋科技	82,300	853,451.00	0.42
173	000869	张裕 A	40,200	853,446.00	0.42
174	600682	南京新百	127,000	853,440.00	0.42
175	688009	中国通号	166,031	853,399.34	0.42
176	605162	新中港	113,600	853,136.00	0.42
177	605228	神通科技	77,600	852,824.00	0.42
178	600785	新华百货	72,700	852,771.00	0.42
179	000815	美利云	66,100	852,690.00	0.41
180	603429	集友股份	91,000	852,670.00	0.41
181	603351	威尔药业	32,200	852,656.00	0.41
182	003036	泰坦股份	61,900	852,363.00	0.41
183	688228	开普云	14,352	852,221.76	0.41
184	301119	正强股份	24,100	852,176.00	0.41
185	603216	梦天家居	67,300	852,018.00	0.41
186	601096	宏盛华源	205,800	852,012.00	0.41
187	000709	河钢股份	394,400	851,904.00	0.41
188	001215	千味央厨	29,900	851,851.00	0.41
189	002996	顺博合金	115,700	851,552.00	0.41
190	601668	中国建筑	147,400	850,498.00	0.41
191	000100	TCL 科技	196,300	849,979.00	0.41
192	600348	华阳股份	127,600	849,816.00	0.41
193	600336	澳柯玛	124,600	849,772.00	0.41
194	001283	豪鹏科技	15,600	849,420.00	0.41
195	002728	特一药业	101,000	849,410.00	0.41
196	002239	奥特佳	292,700	848,830.00	0.41
197	601211	国泰海通	44,300	848,788.00	0.41
198	300022	吉峰科技	95,900	847,756.00	0.41
199	603612	索通发展	46,100	847,318.00	0.41
200	600653	申华控股	450,700	847,316.00	0.41
201	300435	中泰股份	55,800	847,044.00	0.41
202	600429	三元股份	187,700	846,527.00	0.41
203	600668	尖峰集团	59,800	846,170.00	0.41
204	601857	中国石油	98,900	845,595.00	0.41
205	301183	东田微	16,500	845,295.00	0.41
206	600219	南山铝业	220,700	845,281.00	0.41
207	000001	平安银行	69,900	843,693.00	0.41
208	601600	中国铝业	119,700	842,688.00	0.41
209	301489	思泉新材	14,640	841,653.60	0.41
210	000999	华润三九	26,900	841,432.00	0.41
211	688076	诺泰生物	22,582	840,502.04	0.41
212	000783	长江证券	121,200	839,916.00	0.41
213	003041	真爱美家	30,400	839,344.00	0.41

214	600884	杉杉股份	88,500	837,210.00	0.41
215	688096	京源环保	54,321	826,765.62	0.40
216	002778	中晟高科	44,300	825,752.00	0.40
217	300489	光智科技	18,000	794,880.00	0.39
218	002785	万里石	26,500	779,895.00	0.38
219	688775	影石创新	137	17,009.92	0.01
220	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
221	301678	新恒汇	250	11,135.00	0.01
222	688755	汉邦科技	196	7,708.68	0.00
223	301590	优优绿能	37	5,160.76	0.00
224	603014	威高血净	77	2,516.36	0.00
225	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
226	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
227	603202	天有为	23	2,085.18	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	603993	洛阳钼业	3,916,931.00	4.93
2	600835	上海机电	3,464,050.00	4.36
3	603883	老百姓	3,432,173.00	4.32
4	300382	斯莱克	3,425,220.42	4.31
5	688562	航天软件	3,424,686.10	4.31
6	001283	豪鹏科技	3,398,156.00	4.28
7	600458	时代新材	3,356,241.00	4.22
8	300219	鸿利智汇	3,355,190.00	4.22
9	300133	华策影视	3,309,092.00	4.17
10	603037	凯众股份	3,198,197.00	4.03
11	301183	东田微	3,061,330.00	3.85
12	603989	艾华集团	2,880,660.00	3.63
13	300098	高新兴	2,793,259.00	3.52
14	688280	精进电动	2,769,991.58	3.49
15	600299	安迪苏	2,762,849.00	3.48
16	300864	南大环境	2,754,151.00	3.47
17	605577	龙版传媒	2,738,799.00	3.45
18	688228	开普云	2,734,900.27	3.44
19	301031	中熔电气	2,665,269.44	3.35
20	300295	三六五网	2,629,371.00	3.31
21	600662	外服控股	2,620,132.00	3.30
22	301221	光庭信息	2,613,049.00	3.29
23	300739	明阳电路	2,581,305.00	3.25

24	603500	祥和实业	2,562,414.00	3.23
25	002414	高德红外	2,553,972.44	3.21
26	603223	恒通股份	2,528,209.00	3.18
27	300088	长信科技	2,521,301.00	3.17
28	300979	华利集团	2,521,017.00	3.17
29	000757	浩物股份	2,499,694.00	3.15
30	002355	兴民智通	2,496,201.00	3.14
31	600050	中国联通	2,469,402.00	3.11
32	688257	新锐股份	2,457,732.59	3.09
33	002782	可立克	2,453,483.00	3.09
34	603086	先达股份	2,448,388.00	3.08
35	688661	和林微纳	2,440,203.73	3.07
36	600176	中国巨石	2,417,095.00	3.04
37	002546	新联电子	2,401,126.00	3.02
38	603316	诚邦股份	2,397,895.00	3.02
39	300019	硅宝科技	2,390,691.00	3.01
40	603458	勘设股份	2,390,080.00	3.01
41	688251	井松智能	2,374,585.37	2.99
42	603339	四方科技	2,365,425.00	2.98
43	002778	中晟高科	2,357,002.00	2.97
44	301090	华润材料	2,339,193.00	2.94
45	600337	美克家居	2,336,302.00	2.94
46	600862	中航高科	2,334,394.00	2.94
47	300143	盈康生命	2,316,124.00	2.92
48	002302	西部建设	2,314,680.00	2.91
49	601098	中南传媒	2,312,544.00	2.91
50	002297	博云新材	2,300,266.00	2.90
51	300632	光莆股份	2,294,343.00	2.89
52	301489	思泉新材	2,264,402.80	2.85
53	688076	诺泰生物	2,250,837.64	2.83
54	601766	中国中车	2,247,235.00	2.83
55	003041	真爱美家	2,239,445.00	2.82
56	688378	奥来德	2,223,394.92	2.80
57	600237	铜峰电子	2,217,017.00	2.79
58	001206	依依股份	2,210,218.00	2.78
59	002823	凯中精密	2,200,379.00	2.77
60	002745	木林森	2,191,022.00	2.76
61	300808	久量股份	2,190,526.00	2.76
62	301328	维峰电子	2,180,923.00	2.75
63	600336	澳柯玛	2,161,851.00	2.72
64	601019	山东出版	2,149,262.00	2.71
65	000530	冰山冷热	2,148,283.00	2.70
66	600097	开创国际	2,132,643.00	2.68

67	603985	恒润股份	2,127,721.00	2.68
68	600403	大有能源	2,105,139.00	2.65
69	002346	柘中股份	2,096,413.00	2.64
70	600834	申通地铁	2,092,349.00	2.63
71	603612	索通发展	2,090,803.00	2.63
72	002491	通鼎互联	2,089,083.00	2.63
73	603036	如通股份	2,072,812.00	2.61
74	002209	达意隆	2,058,981.00	2.59
75	300160	秀强股份	2,056,437.00	2.59
76	605567	春雪食品	2,052,603.00	2.58
77	300682	朗新集团	2,048,998.00	2.58
78	002950	奥美医疗	2,047,272.00	2.58
79	603090	宏盛股份	2,042,232.00	2.57
80	300215	电科院	2,038,062.00	2.57
81	603186	华正新材	2,036,799.00	2.56
82	300650	太龙股份	2,035,919.00	2.56
83	688238	和元生物	2,028,029.59	2.55
84	002931	锋龙股份	2,021,490.00	2.54
85	300232	洲明科技	2,017,808.00	2.54
86	603328	依顿电子	2,013,392.00	2.53
87	688161	威高骨科	2,009,638.60	2.53
88	002626	金达威	2,005,535.00	2.52
89	300554	三超新材	2,003,785.00	2.52
90	688588	凌志软件	1,994,942.29	2.51
91	688711	宏微科技	1,982,146.91	2.49
92	300241	瑞丰光电	1,975,710.00	2.49
93	603919	金徽酒	1,974,014.76	2.48
94	003036	泰坦股份	1,952,168.00	2.46
95	688388	嘉元科技	1,944,985.97	2.45
96	002380	科远智慧	1,940,647.00	2.44
97	688302	海创药业	1,931,281.42	2.43
98	301312	智立方	1,929,912.00	2.43
99	605050	福然德	1,918,428.00	2.41
100	600785	新华百货	1,915,961.00	2.41
101	002206	海利得	1,905,590.00	2.40
102	000803	山高环能	1,901,852.00	2.39
103	688722	同益中	1,899,838.22	2.39
104	300306	远方信息	1,880,385.00	2.37
105	301248	杰创智能	1,877,718.00	2.36
106	000725	京东方 A	1,863,403.00	2.35
107	002723	小崧股份	1,858,897.00	2.34
108	603628	清源股份	1,855,104.00	2.34
109	300447	全信股份	1,854,461.00	2.33

110	600758	辽宁能源	1,853,036.11	2.33
111	600558	大西洋	1,849,581.00	2.33
112	688289	圣湘生物	1,848,016.49	2.33
113	605589	圣泉集团	1,833,420.00	2.31
114	688600	皖仪科技	1,817,468.66	2.29
115	300560	中富通	1,809,261.00	2.28
116	300400	劲拓股份	1,794,358.00	2.26
117	300727	润禾材料	1,790,878.00	2.25
118	603408	建霖家居	1,788,740.00	2.25
119	601118	海南橡胶	1,788,653.00	2.25
120	300586	美联新材	1,783,782.00	2.25
121	002632	道明光学	1,779,403.00	2.24
122	002287	奇正藏药	1,776,987.00	2.24
123	301511	德福科技	1,768,633.00	2.23
124	300006	莱美药业	1,767,801.60	2.23
125	603386	骏亚科技	1,764,099.00	2.22
126	300363	博腾股份	1,761,032.00	2.22
127	603122	合富中国	1,753,869.00	2.21
128	600841	动力新科	1,748,033.00	2.20
129	301128	强瑞技术	1,740,535.00	2.19
130	000657	中钨高新	1,722,528.00	2.17
131	300105	龙源技术	1,714,724.00	2.16
132	000573	粤宏远 A	1,714,137.00	2.16
133	688009	中国通号	1,712,501.47	2.16
134	688685	迈信林	1,709,853.81	2.15
135	000709	河钢股份	1,706,738.00	2.15
136	301408	华人健康	1,695,322.00	2.13
137	002692	远程股份	1,693,056.00	2.13
138	300715	凯伦股份	1,689,046.00	2.13
139	002358	森源电气	1,689,022.00	2.13
140	002434	万里扬	1,687,352.00	2.12
141	300534	陇神戎发	1,684,033.00	2.12
142	688708	佳驰科技	1,683,364.45	2.12
143	300022	吉峰科技	1,676,516.00	2.11
144	002495	佳隆股份	1,672,514.00	2.11
145	300609	汇纳科技	1,667,651.00	2.10
146	002741	光华科技	1,665,857.00	2.10
147	603109	神驰机电	1,663,500.00	2.09
148	600771	广誉远	1,662,627.00	2.09
149	688625	呈和科技	1,661,279.33	2.09
150	688410	山外山	1,660,293.86	2.09
151	601818	光大银行	1,656,588.00	2.09
152	000514	渝开发	1,653,239.64	2.08

153	605006	山东玻纤	1,648,276.00	2.07
154	300017	网宿科技	1,646,796.00	2.07
155	688550	瑞联新材	1,642,185.79	2.07
156	300420	五洋自控	1,640,376.00	2.06
157	002793	罗欣药业	1,638,188.00	2.06
158	600722	金牛化工	1,638,152.00	2.06
159	300509	新美星	1,629,822.00	2.05
160	300166	东方国信	1,627,351.00	2.05
161	002600	领益智造	1,624,992.00	2.05
162	002842	翔鹭钨业	1,620,265.00	2.04
163	300885	海昌新材	1,619,127.00	2.04
164	603079	圣达生物	1,616,953.00	2.04
165	603456	九洲药业	1,616,948.00	2.04
166	600490	鹏欣资源	1,615,049.00	2.03
167	001215	千味央厨	1,614,523.00	2.03
168	600105	永鼎股份	1,613,113.00	2.03
169	688508	芯朋微	1,611,690.78	2.03
170	300572	安车检测	1,610,923.00	2.03
171	603160	汇顶科技	1,606,316.00	2.02
172	603216	梦天家居	1,605,592.00	2.02
173	603600	永艺股份	1,604,577.00	2.02
174	002589	瑞康医药	1,602,885.00	2.02
175	002198	嘉应制药	1,602,246.00	2.02
176	600359	新农开发	1,600,097.99	2.01
177	300039	上海凯宝	1,599,749.00	2.01
178	605305	中际联合	1,598,083.20	2.01

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	603993	洛阳钼业	3,915,110.00	4.93
2	688562	航天软件	3,473,830.16	4.37
3	603883	老百姓	3,457,316.00	4.35
4	600835	上海机电	3,437,845.00	4.33
5	300133	华策影视	3,411,862.00	4.29
6	600458	时代新材	3,386,096.00	4.26
7	300219	鸿利智汇	3,338,013.00	4.20
8	603037	凯众股份	3,217,363.00	4.05
9	605577	龙版传媒	2,928,288.00	3.69
10	301221	光庭信息	2,893,490.00	3.64
11	603989	艾华集团	2,855,045.00	3.59

12	002546	新联电子	2,840,856.00	3.58
13	300098	高新兴	2,779,538.00	3.50
14	301031	中熔电气	2,763,273.92	3.48
15	600299	安迪苏	2,713,782.00	3.42
16	001283	豪鹏科技	2,698,880.00	3.40
17	300382	斯莱克	2,679,016.92	3.37
18	300295	三六五网	2,662,910.00	3.35
19	002414	高德红外	2,656,880.77	3.34
20	600662	外服控股	2,603,745.00	3.28
21	603316	诚邦股份	2,575,295.00	3.24
22	603223	恒通股份	2,567,611.00	3.23
23	688378	奥来德	2,470,379.68	3.11
24	300979	华利集团	2,456,162.00	3.09
25	600337	美克家居	2,432,835.00	3.06
26	688257	新锐股份	2,419,939.67	3.05
27	600176	中国巨石	2,365,473.95	2.98
28	300632	光莆股份	2,363,141.00	2.97
29	603339	四方科技	2,356,103.20	2.97
30	002745	木林森	2,346,320.00	2.95
31	300143	盈康生命	2,341,116.28	2.95
32	001206	依依股份	2,338,213.00	2.94
33	002626	金达威	2,323,511.00	2.92
34	301090	华润材料	2,322,802.00	2.92
35	601098	中南传媒	2,321,701.00	2.92
36	300808	久量股份	2,309,726.00	2.91
37	002302	西部建设	2,304,065.00	2.90
38	300682	朗新集团	2,298,337.00	2.89
39	301183	东田微	2,267,639.00	2.85
40	601766	中国中车	2,228,967.00	2.81
41	000530	冰山冷热	2,224,100.00	2.80
42	300650	太龙股份	2,218,564.00	2.79
43	600834	申通地铁	2,215,522.00	2.79
44	600403	大有能源	2,215,348.00	2.79
45	301312	智立方	2,193,678.00	2.76
46	002823	凯中精密	2,183,157.00	2.75
47	688280	精进电动	2,181,922.25	2.75
48	600097	开创国际	2,164,376.00	2.72
49	002346	柘中股份	2,159,474.00	2.72
50	301328	维峰电子	2,153,266.00	2.71
51	688238	和元生物	2,124,181.49	2.67
52	603036	如通股份	2,122,869.00	2.67
53	688228	开普云	2,081,810.01	2.62
54	688302	海创药业	2,079,550.06	2.62

55	603386	骏亚科技	2,077,338.00	2.61
56	002355	兴民智通	2,076,431.00	2.61
57	600722	金牛化工	2,071,017.00	2.61
58	603328	依顿电子	2,070,687.00	2.61
59	002950	奥美医疗	2,065,088.00	2.60
60	300400	劲拓股份	2,061,508.00	2.59
61	603186	华正新材	2,060,162.00	2.59
62	300554	三超新材	2,016,886.00	2.54
63	300215	电科院	2,011,845.00	2.53
64	301248	杰创智能	2,001,610.00	2.52
65	603628	清源股份	1,990,537.00	2.51
66	300232	洲明科技	1,988,435.00	2.50
67	300586	美联新材	1,937,754.00	2.44
68	603408	建霖家居	1,931,043.00	2.43
69	688388	嘉元科技	1,918,401.78	2.41
70	300447	全信股份	1,917,853.00	2.41
71	002206	海利得	1,915,863.11	2.41
72	002723	小崧股份	1,901,242.00	2.39
73	300511	雪榕生物	1,900,942.00	2.39
74	603600	永艺股份	1,898,034.00	2.39
75	301511	德福科技	1,897,977.00	2.39
76	300864	南大环境	1,886,266.00	2.37
77	600758	辽宁能源	1,870,973.00	2.35
78	605589	圣泉集团	1,850,891.00	2.33
79	601818	光大银行	1,850,612.00	2.33
80	688600	皖仪科技	1,843,152.63	2.32
81	301408	华人健康	1,841,407.00	2.32
82	300006	莱美药业	1,832,897.80	2.31
83	002842	翔鹭钨业	1,829,980.65	2.30
84	002287	奇正藏药	1,822,854.66	2.29
85	300088	长信科技	1,814,103.00	2.28
86	600050	中国联通	1,813,485.00	2.28
87	300609	汇纳科技	1,809,591.00	2.28
88	600841	动力新科	1,798,035.00	2.26
89	300739	明阳电路	1,794,682.50	2.26
90	300410	正业科技	1,792,123.00	2.26
91	300560	中富通	1,789,404.00	2.25
92	601118	海南橡胶	1,788,882.00	2.25
93	300363	博腾股份	1,782,525.00	2.24
94	601919	中远海控	1,762,539.40	2.22
95	002741	光华科技	1,761,111.00	2.22
96	600490	鹏欣资源	1,760,480.00	2.22
97	002589	瑞康医药	1,757,219.00	2.21

98	603122	合富中国	1,755,321.00	2.21
99	002495	佳隆股份	1,753,913.00	2.21
100	688093	世华科技	1,747,572.93	2.20
101	603500	祥和实业	1,741,487.00	2.19
102	603086	先达股份	1,736,687.00	2.19
103	002434	万里扬	1,728,701.00	2.18
104	300991	创益通	1,728,121.60	2.18
105	002358	森源电气	1,717,720.00	2.16
106	300578	会畅通讯	1,708,266.00	2.15
107	688410	山外山	1,706,984.53	2.15
108	002556	辉隆股份	1,684,993.00	2.12
109	300715	凯伦股份	1,677,591.00	2.11
110	601918	新集能源	1,677,338.00	2.11
111	301128	强瑞技术	1,677,212.00	2.11
112	603499	翔港科技	1,669,143.00	2.10
113	300420	五洋自控	1,668,606.00	2.10
114	300019	硅宝科技	1,657,014.00	2.09
115	605006	山东玻纤	1,655,941.00	2.08
116	603079	圣达生物	1,655,762.00	2.08
117	688661	和林微纳	1,652,481.07	2.08
118	600367	红星发展	1,647,758.00	2.07
119	688662	富信科技	1,646,946.45	2.07
120	300509	新美星	1,645,978.00	2.07
121	300395	菲利华	1,642,410.00	2.07
122	605305	中际联合	1,641,198.20	2.07
123	300299	富春股份	1,636,721.00	2.06
124	300572	安车检测	1,630,236.00	2.05
125	000757	浩物股份	1,628,420.00	2.05
126	600998	九州通	1,622,612.00	2.04
127	300166	东方国信	1,617,055.00	2.04
128	300909	汇创达	1,613,989.00	2.03
129	600960	渤海汽车	1,611,276.00	2.03
130	300039	上海凯宝	1,609,973.00	2.03
131	300120	经纬辉开	1,609,817.00	2.03
132	601728	中国电信	1,607,443.00	2.02
133	000705	浙江震元	1,603,646.00	2.02
134	002782	可立克	1,600,346.00	2.01
135	688251	井松智能	1,596,923.51	2.01
136	603160	汇顶科技	1,595,023.00	2.01
137	301022	海泰科	1,592,399.68	2.00
138	300320	海达股份	1,591,674.00	2.00

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	1,458,628,306.09
卖出股票收入（成交）总额	1,370,920,440.79

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，浙江九洲药业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到台州市生态环境局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	65,785.96
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,827,173.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,892,959.27

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

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
易方达易百智能量化策略混合 A	1,866	63,072.41	26,423,108.59	22.45%	91,270,012.74	77.55%
易方达易百智能量化策略混合 C	1,398	29,819.28	1,070,402.01	2.57%	40,616,945.31	97.43%
合计	3,264	48,829.80	27,493,510.60	17.25%	131,886,958.05	82.75%

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	易方达易百智能量化策略混合 A	9,712,819.27	8.2527%
	易方达易百智能量化策略混合 C	545,363.19	1.3082%
	合计	10,258,182.46	6.4363%

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	易方达易百智能量化策略混合 A	>100
	易方达易百智能量化策略混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达易百智能量化策略混合 A	10~50
	易方达易百智能量化策略混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达易百智能量化策略混合 A	易方达易百智能量化策略混合 C
基金合同生效日（2018 年 1 月 24 日）基金份额总额	785,605,733.86	9,148,962.61
本报告期期初基金份额总额	59,263,650.21	16,028,627.30
本报告期基金总申购份额	73,696,748.98	51,501,829.85
减：本报告期基金总赎回份额	15,267,277.86	25,843,109.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	117,693,121.33	41,687,347.32

§ 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 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	2,829,294,922.45	100.00%	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为国信证券股份有限公司。国联证券股份有限公司更名为国联民生证券股份有限公司，国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司合并为国泰海通证券股份有限公司。

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有调整，调整后的标准如下：

- 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	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-01-21
2	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
4	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
5	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-25
7	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（2024 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证券报	2025-03-31
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-04-22
10	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2025-05-17

		电子披露网站	
--	--	--------	--

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025 年 01 月 01 日~2025 年 04 月 06 日,2025 年 04 月 08 日~2025 年 04 月 17 日	23,782,305.37	0.00	0.00	23,782,305.37	14.92 %
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

§ 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易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达易百智能量化策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

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

二〇二五年八月三十日