

# 易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

## 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年三月三十一日

## § 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。本年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	19
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 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	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	88

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	90
8.6	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 .....	90
8.7	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 .....	90
8.8	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 .....	90
8.9	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 .....	90
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	90
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	90
8.12	投资组合报告附注 .....	91
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>92</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	92
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	92
9.3	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 .....	92
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	93
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>93</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>93</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	93
11.2	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 .....	93
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	94
11.4	基金投资策略的改变 .....	94
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	94
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	94
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	95
11.8	其他重大事件 .....	97
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>99</b>
12.1	备查文件目录 .....	99
12.2	存放地点 .....	99
12.3	查阅方式 .....	99

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	易方达中证 500 量化增强	
基金主代码	012080	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 15 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	751,655,338.06 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 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
下属分级基金的交易代码	012080	012081
报告期末下属分级基金的份额总额	311,303,082.37 份	440,352,255.69 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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本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%；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，谋求基金资产的长期增值。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先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。债券投资方面，本基金

	将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，并通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择等方面进行积极主动的债券投资管理。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券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。</p> <p>本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的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、以及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“风险揭示”部分。</p>

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
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55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55号
邮政编码		510627；510623；519031	100140
法定代表人		吴欣荣	廖林

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2025 年		2024 年		2023 年	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
本期已实现收益	81,891,878.10	81,859,999.36	7,769,329.21	3,616,273.31	-24,167,535.45	-8,211,848.07
本期利润	101,422,498.10	83,654,667.21	30,972,732.70	13,138,314.49	-15,599,912.86	-8,855,063.99
加权平均基金份额本期利润	0.3057	0.3133	0.0810	0.0799	-0.0377	-0.0535
本期加权平均净值利润率	30.33%	29.92%	9.78%	9.72%	-4.29%	-6.09%

本期基金份额净值增长率	34.41%	34.01%	10.18%	9.84%	-4.84%	-5.12%	
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末		
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	
	期末可供分配利润	43,968,379.96	55,401,966.07	-46,463,159.65	-23,572,385.74	-69,651,045.04	-25,933,453.09
	期末可供分配基金份额利润	0.1412	0.1258	-0.1242	-0.1333	-0.1767	-0.1829
	期末基金资产净值	379,534,352.40	529,620,545.14	339,336,735.49	158,707,003.10	324,570,071.88	115,833,856.11
	期末基金份额净值	1.2192	1.2027	0.9071	0.8975	0.8233	0.8171
	3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
易方达中证 500 量化增强 A		易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	
基金份额累计净值增长率	21.92%	20.27%	-9.29%	-10.25%	-17.67%	-18.29%	

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 500 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	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	2.11%	1.10%	0.71%	1.18%	1.40%	-0.08%
过去六个月	26.89%	1.04%	24.81%	1.11%	2.08%	-0.07%
过去一年	34.41%	1.14%	28.81%	1.20%	5.60%	-0.06%
过去三年	40.92%	1.25%	26.25%	1.30%	14.67%	-0.05%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	21.92%	1.19%	11.02%	1.26%	10.90%	-0.07%

易方达中证 500 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	2.04%	1.10%	0.71%	1.18%	1.33%	-0.08%
过去六个月	26.69%	1.04%	24.81%	1.11%	1.88%	-0.07%
过去一年	34.01%	1.14%	28.81%	1.20%	5.20%	-0.06%
过去三年	39.65%	1.25%	26.25%	1.30%	13.40%	-0.05%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	20.27%	1.19%	11.02%	1.26%	9.25%	-0.07%

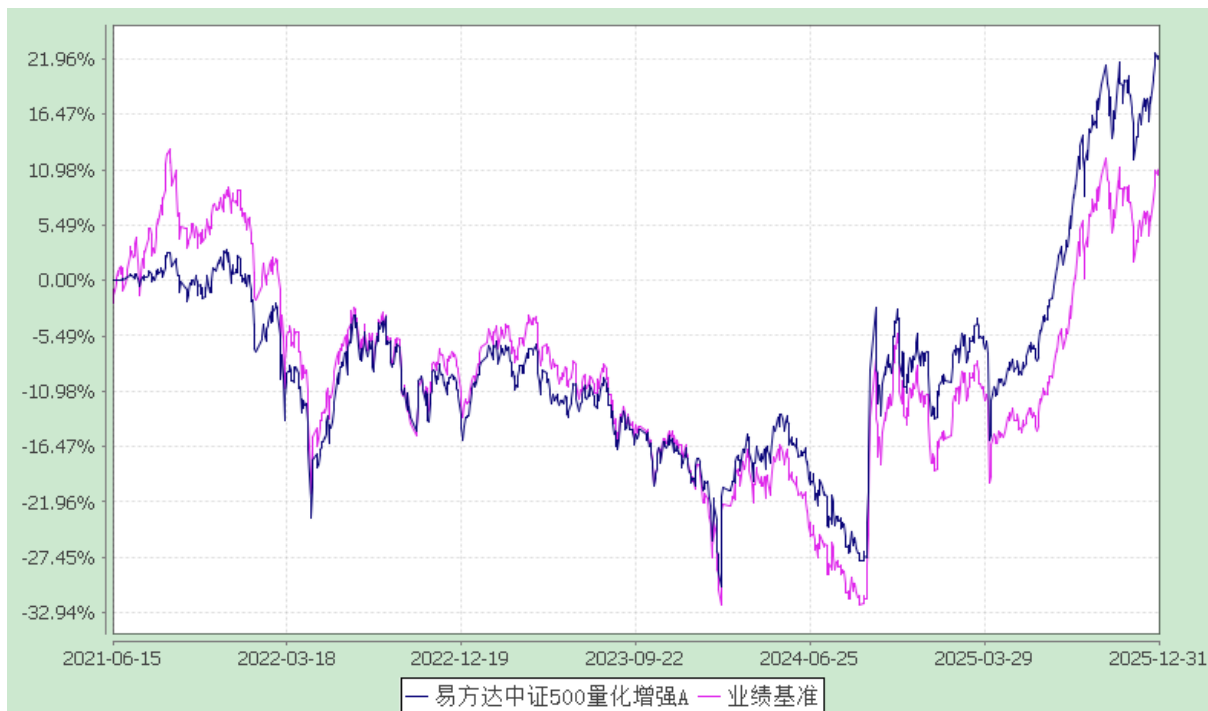
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

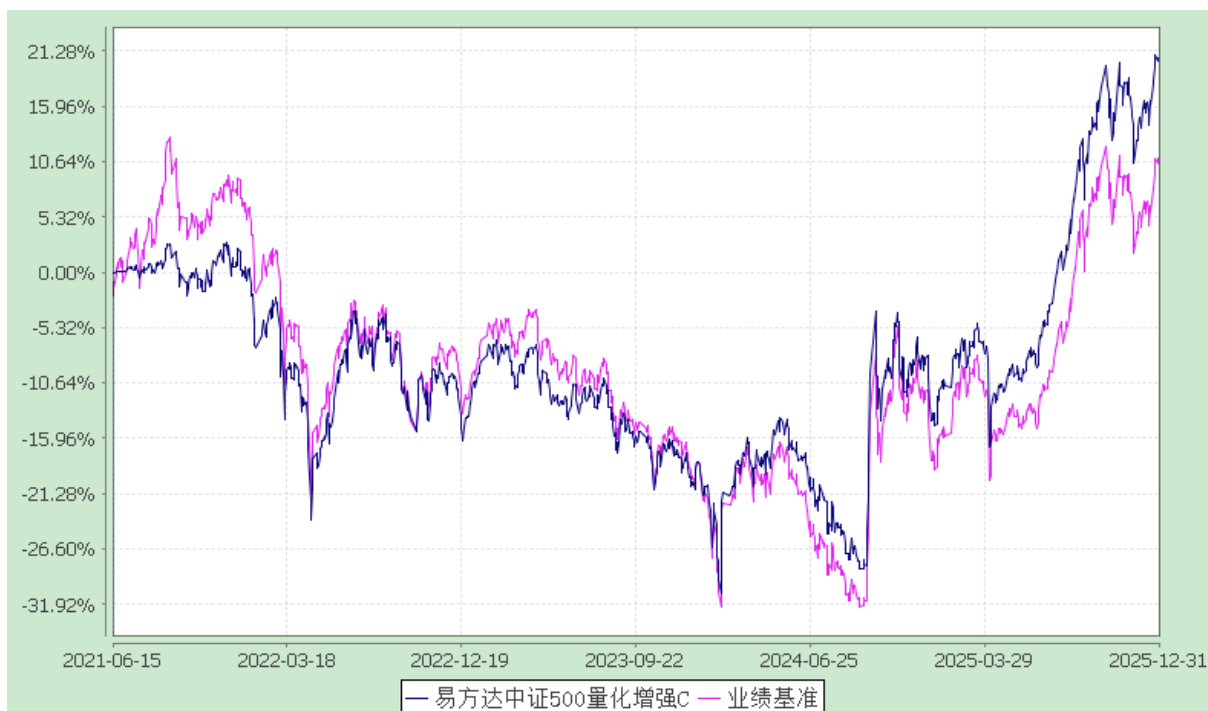
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 6 月 15 日至 2025 年 12 月 31 日)

易方达中证 500 量化增强 A



易方达中证 500 量化增强 C

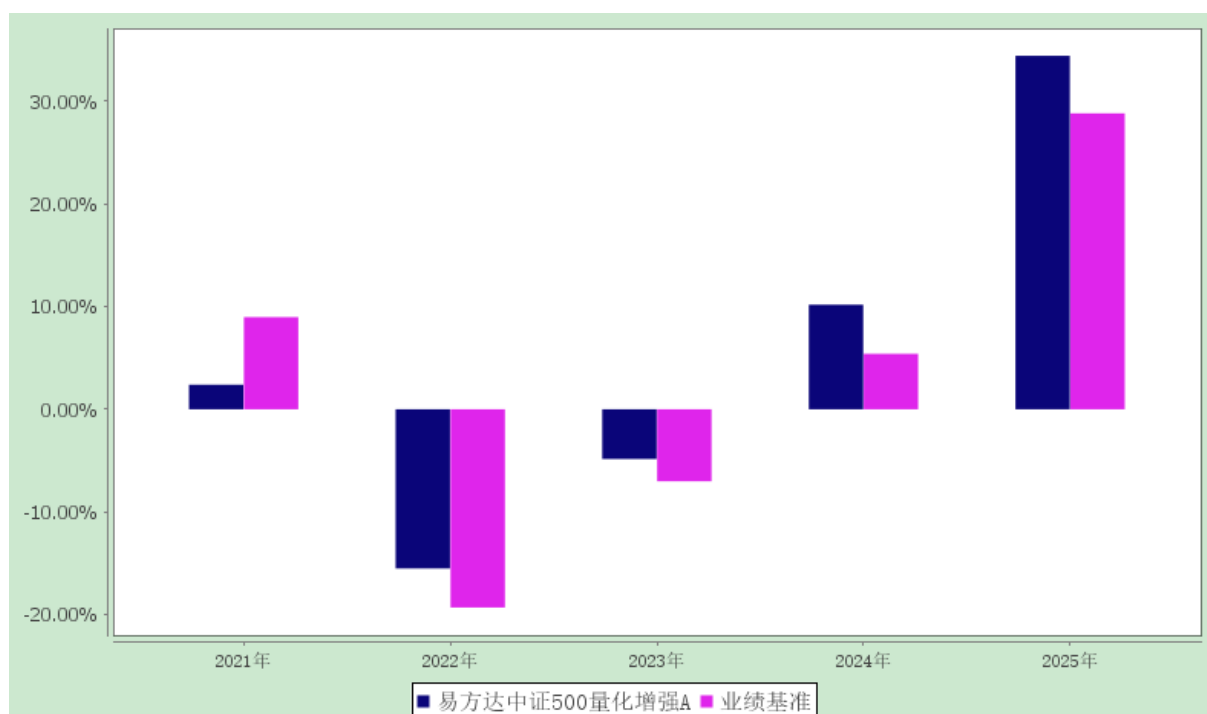


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

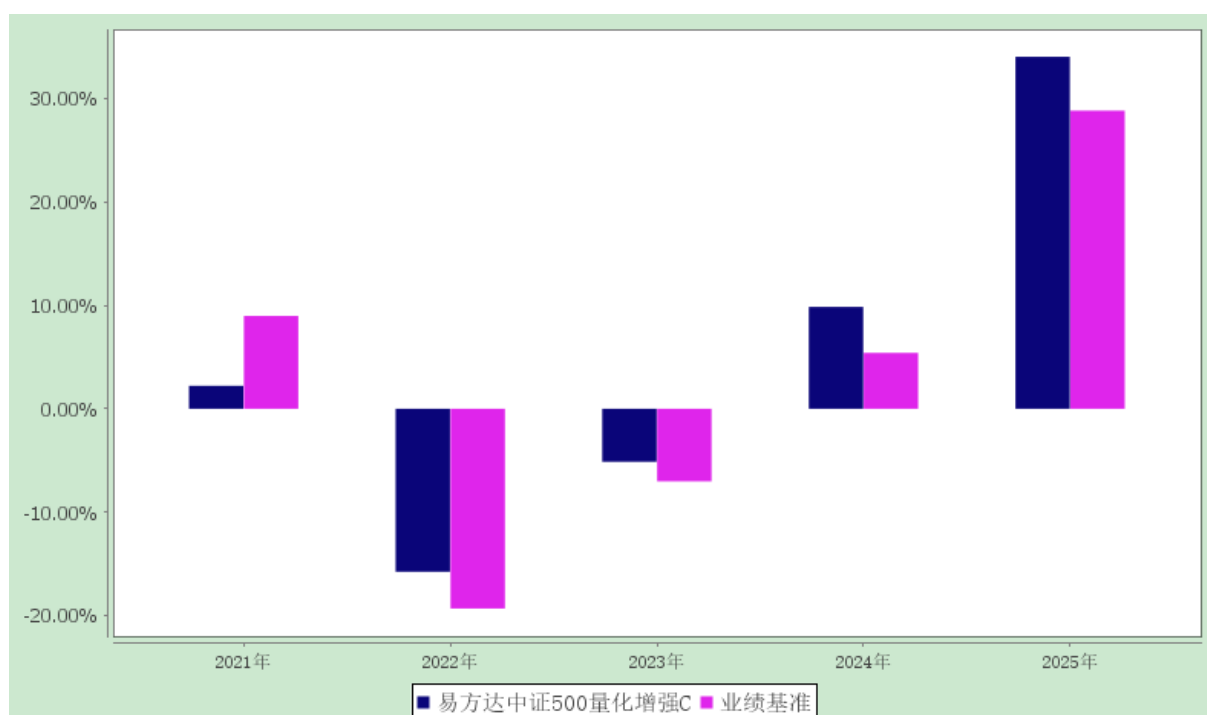
易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达中证 500 量化增强 A



### 易方达中证 500 量化增强 C



注：本基金合同生效日为 2021 年 6 月 15 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 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 增强策略 ETF、易方达中证 A500 量化增强的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员	2021-06-15	-	15 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限公司量化研究员、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。
刘 文 贵	本基金的基金经理，易方达丰惠混合的基金经理助理，投资经理	2023-11-09	-	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任松河资本管理公司量化研究员，上海泓信投资管理有限公司衍生品投资总监，深圳市弘源泰平资产管理有限公司量化投资总监。

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
----	------	---------	---------	------

刘文贵	公募基金	1	909,154,897.54	2023-11-09
	私募资产管理计划	1	59,992,341.34	2019-04-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	2	969,147,238.88	-

注：1.“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2.报告期内，刘文贵曾兼任管理的1个其他组合于2025年8月5日终止。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，具体按其对产品业绩和投资团队的贡献等情况综合评定。

#### 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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进

行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形，公司进一步加强了对投资指令下达、交易执行和反向交易控制等环节的控制措施，同时强化了对相关同向交易价差、反向交易价差及组合收益率差异的事后监测分析，按监管要求进行相关信息披露，进一步落实对兼任基金经理投资交易行为的规范和监督。本报告期内，相关制度措施执行情况良好，未发现同一基金经理管理公募基金、私募资产管理计划之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 94 次，其中 80 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，14 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。

### 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 年我国经济运行总体平稳，全年实际 GDP 同比增长 5.0%，顺利实现预定增长目标，经济总量首次突破 140 万亿元大关。纵观全年，经济运行呈现“前高后低”走势，受房地产景气度持续下滑及内需动能不足影响，四季度实际 GDP 同比增速放缓至 4.5%。在结构上，外需表现出强劲韧性，货物和服务贸易净出口对 GDP 增长保持正贡献，贸易顺差首次突破万亿美元大关，有力支撑了经济基本盘。工业生产稳步增长，规模以上工业增加值全年同比增长 5.9%，其中高技术制造业和新能源产品产量保持高速增长。然而，国内有效需求不足的问题依然突出。全年固定资产投资受地产和基

建拖累同比下降 3.8%，其中房地产开发投资同比下降 17.2%，连续四年处于下行区间。消费市场呈弱修复态势，社会消费品零售总额全年增长 3.7%，但受居民收入修复受限及信心不足影响，12 月当月增速回落至 0.9% 的低位。

2025 年 A 股市场在风格上呈现出明显的“成长领跑、价值压舱”特征，反映了市场在经济转型期对高增长与高股息资产的双向配置需求。以创业板指为代表的成长风格全年录得近 50% 的显著增长，展现出极强的进攻属性。与此同时，价值风格的内涵在这一年发生了深刻变迁，由传统的地产金融向红利资产进一步深化。整体而言，2025 年市场风格由初期的红利防御逐渐过渡到中后期的“红利与成长”双轮驱动，机构资金在保持红利的底仓的同时，显著加大了对硬科技等成长赛道的配置权重。

在此期间，作为指数增强型基金，管理人严格遵照量化指数增强投资模式进行操作，以标的指数的构成为基础，主要利用基金管理人自主开发的以基本面选股因子为主的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。

#### 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 1.2192 元，本报告期份额净值增长率为 34.41%，同期业绩比较基准收益率为 28.81%；C 类基金份额净值为 1.2027 元，本报告期份额净值增长率为 34.01%，同期业绩比较基准收益率为 28.81%。年化跟踪误差 2.79%，在合同规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

政策转型过程中经济结构分化加剧，但政策对经济的提振效果也在显现。伴随促消费政策由商品转向服务，以商品消费为代表的社零等指标读数下行，但以服务消费为代表的服务零售额增速明显上升；稳投资政策更多聚焦“新投资”领域，虽然个别房企风险导致地产投资进一步走弱，但政策加码已在缓和化债对投资的“挤出效应”，新基建、服务业投资等指标出现积极改善，未来有望延续。

下阶段权益市场，受产业趋势与增量博弈共振影响，或仍将以结构性行情为主，但当前部分板块及市场整体估值已处高位，行情正从上涨向震荡过渡，需通过回调及业绩兑现消化估值，等待性价比改善。中期来看，核心是等待产业趋势线索清晰及估值与筹码矛盾缓和，长期仍有上行空间，景气科技与周期领域仍具机会。

综上，下阶段基金运作管理仍将迎来诸多方面的挑战，管理人将继续严格遵照多因子量化增强的投资模式进行操作，同时结合采用长期有效的基本面量化模型进行选股，配置稳健的策略模型以顺应市场风格变换，为投资人创造持续稳健的超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人紧扣公募基金行业高质量发展主线，根据法律法规、最新监管要求和业务发展需要，围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程，强化对法规和制度执行情况的监督检查，保障旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作情况如下：

(1) 坚持投资者利益至上，大力培育良好的合规文化，严格落实从业人员廉洁从业、职业操守和道德规范相关要求，积极探索合规文化宣贯新形式，组织面向全体员工及不同部门的合规专项培训、考试及承诺函签署等工作，引导员工将合规意识内化于心、外化于行，自觉践行“五要五不”的中国特色金融文化。

(2) 通过系统升级，进一步优化投资交易的日常监控机制，提升投前、投中和投后全链条的合规风控效能。投资合规部门与研究、投资、交易业务部门协同完善内部制度和流程，进一步明确业务执行规范。根据监管要求和业务发展情况，加强程序化交易执行监控，持续巩固公平交易和异常交易管控措施。

(3) 持续优化各类法律文件审核流程，强化全流程合规管控。坚持以投资者为本，积极推进浮动费率基金等创新产品开发论证，审慎评估各项新业务方案，保障公司各项业务稳妥有序开展，更好服务广大投资者财富管理需求。

(4) 严格遵守法律法规及监管规定，持续规范基金销售行为，强化对自媒体账号、社群运营等重点领域的合规管控。不断完善新型基金营销模式管控机制，支持创新业务与服务规范有序落地。积极探索运用数智化技术，开发宣传推介材料智能审核系统，提升合规审核效率。始终坚持以投资者利益为核心，健全投资者适当性管理长效机制，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的科学性与合理性。认真贯彻落实监管部门关于中小投资者保护工作要求，深入推进投诉溯源治理，妥善化解业务纠纷，切实维护投资者合法权益。

(5) 持续督促各部门落实法律法规、自律规则、基金法律文件中各项信息披露规定，优化完善相关制度流程；推进公司级信息披露平台和智能审核系统建设，深度探索人工智能技术在信息披露工作中的应用，以科技赋能有效应对持续增长的信息披露工作，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 深入贯彻落实新《反洗钱法》及配套法规制度要求，全面完善“基于风险”的洗钱风险管理体系，建立健全客户尽职调查和受益所有人识别机制，加强洗钱风险识别管控，推动科技赋能与数据治理，持续提升反洗钱工作有效性水平。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据, 有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱、境内外子公司等工作领域开展内审检查, 同时聘请并配合外部审计机构开展年度内控评价、ISAE3402 内控鉴证、GIPS (全球投资业绩标准) 鉴证项目, 全方位审视公司内控机制和执行情况, 督促改进内外部检查发现问题, 进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 努力防范和控制重大风险, 充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内, 参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达中证 500 量化增强 A: 本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 500 量化增强 C: 本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内, 本基金托管人在对本基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

容诚审字[2026]200Z1279 号

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金的财务报告过程。

#### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

薛竞 周祎

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2026 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	93,838,945.20	29,034,507.86
结算备付金		20,465,659.24	2,161,097.77
存出保证金		7,176,899.72	44,958.72
交易性金融资产	7.4.7.2	794,912,543.65	467,919,145.75
其中：股票投资		794,912,543.65	467,912,382.63
基金投资		-	-
债券投资		-	6,763.12
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		40,825,625.43	132,201.37
应收股利		-	-
应收申购款		4,157,303.44	1,290,358.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>961,376,976.68</b>	<b>500,582,269.66</b>

负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	376,268.05
应付赎回款		50,744,236.22	1,452,262.73
应付管理人报酬		571,464.53	346,634.53
应付托管费		107,149.60	64,994.00
应付销售服务费		127,652.44	41,391.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		305,300.69	1.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	366,275.66	256,979.50
<b>负债合计</b>		<b>52,222,079.14</b>	<b>2,538,531.07</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	751,655,338.06	550,921,975.92
未分配利润	7.4.7.8	157,499,559.48	-52,878,237.33
<b>净资产合计</b>		<b>909,154,897.54</b>	<b>498,043,738.59</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>961,376,976.68</b>	<b>500,582,269.66</b>

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.2192 元，C 类基金份额净值 1.2027 元；基金份额总额 751,655,338.06 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 311,303,082.37 份，C 类基金份额总额 440,352,255.69 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>191,949,731.77</b>	<b>48,982,679.73</b>
1.利息收入		336,491.84	233,240.14
其中：存款利息收入	7.4.7.9	336,491.84	233,240.14
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）		169,848,990.09	15,790,160.30
其中：股票投资收益	7.4.7.10	151,179,577.81	4,524,573.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	339,469.25	85,656.02
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	11,065,192.28	3,442,282.12
股利收益	7.4.7.14	7,264,750.75	7,737,648.68
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	21,325,287.85	32,725,444.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	438,961.99	233,834.62
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>6,872,566.46</b>	<b>4,871,632.54</b>
1. 管理人报酬		4,907,050.19	3,612,150.20
2. 托管费		920,071.94	677,278.12
3. 销售服务费		837,354.43	404,170.13
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	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		39,864.44	12,398.47
8. 其他费用	7.4.7.18	168,225.46	165,635.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>185,077,165.31</b>	<b>44,111,047.19</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>185,077,165.31</b>	<b>44,111,047.19</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>185,077,165.31</b>	<b>44,111,047.19</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	550,921,975.92	-52,878,237.33	498,043,738.59
二、本期期初净资产	550,921,975.92	-52,878,237.33	498,043,738.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	200,733,362.14	210,377,796.81	411,111,158.95
（一）、综合收益总额	-	185,077,165.31	185,077,165.31
（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）	200,733,362.14	25,300,631.50	226,033,993.64
其中：1.基金申购款	792,444,953.29	47,947,513.36	840,392,466.65
2.基金赎回款	-591,711,591.15	-22,646,881.86	-614,358,473.01
（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	751,655,338.06	157,499,559.48	909,154,897.54
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	535,988,426.12	-95,584,498.13	440,403,927.99
二、本期期初净资产	535,988,426.12	-95,584,498.13	440,403,927.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	14,933,549.80	42,706,260.80	57,639,810.60
（一）、综合收益总额	-	44,111,047.19	44,111,047.19
（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）	14,933,549.80	-1,404,786.39	13,528,763.41
其中：1.基金申购款	241,457,657.14	-33,826,864.62	207,630,792.52
2.基金赎回款	-226,524,107.34	32,422,078.23	-194,102,029.11
（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	550,921,975.92	-52,878,237.33	498,043,738.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

易方达中证 500 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[2021]1043 号《关于准予易方达中证 500 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 500 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 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,088,975,598.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 547,709.87 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

#### 7.4.2 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《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。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 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。

##### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会审议;

(6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 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、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继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》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财税[2024]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》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。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，暂适用简易计税方法，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。

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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
活期存款	93,838,945.20	29,034,507.86
等于：本金	93,830,134.72	29,031,598.12
加：应计利息	8,810.48	2,909.74
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	93,838,945.20	29,034,507.86

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	762,456,835.54	-	794,912,543.65	32,455,708.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	-	-	-	-
交易所市	-	-	-	-

	场				
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		762,456,835.54	-	794,912,543.65	32,455,708.11
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		453,146,079.39	-	467,912,382.63	14,766,303.24
贵金属投资-金交所黄 金合约		-	-	-	-
债券	交易所市 场	4,999.98	6.12	6,763.12	1,757.02
	银行间市 场	-	-	-	-
	合计	4,999.98	6.12	6,763.12	1,757.02
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		453,151,079.37	6.12	467,919,145.75	14,768,060.26

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	55,258,040.00	-	-	-
IC2606	55,258,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	55,258,040.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2606	IC2606	41	58,895,680.00	3,637,640.00
合计	-	-	-	3,637,640.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	3,637,640.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,155.85	1,330.84
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	203,119.81	93,648.66
其中：交易所市场	203,119.81	93,648.66
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	162,000.00	162,000.00
合计	366,275.66	256,979.50

#### 7.4.7.7 实收基金

易方达中证 500 量化增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	374,092,497.04	374,092,497.04
本期申购	159,419,636.71	159,419,636.71
本期赎回（以“-”号填列）	-222,209,051.38	-222,209,051.38
本期末	311,303,082.37	311,303,082.37

易方达中证 500 量化增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	176,829,478.88	176,829,478.88
本期申购	633,025,316.58	633,025,316.58

本期赎回（以“-”号填列）	-369,502,539.77	-369,502,539.77
本期末	440,352,255.69	440,352,255.69

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

易方达中证 500 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	-46,463,159.65	11,707,398.10	-34,755,761.55
本期期初	-46,463,159.65	11,707,398.10	-34,755,761.55
本期利润	81,891,878.10	19,530,620.00	101,422,498.10
本期基金份额交易产生的变动数	8,539,661.51	-6,975,128.03	1,564,533.48
其中：基金申购款	4,541,045.89	11,757,105.64	16,298,151.53
基金赎回款	3,998,615.62	-18,732,233.67	-14,733,618.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,968,379.96	24,262,890.07	68,231,270.03

易方达中证 500 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	-23,572,385.74	5,449,909.96	-18,122,475.78
本期期初	-23,572,385.74	5,449,909.96	-18,122,475.78
本期利润	81,859,999.36	1,794,667.85	83,654,667.21
本期基金份额交易产生的变动数	-2,885,647.55	26,621,745.57	23,736,098.02
其中：基金申购款	-18,353,531.29	50,002,893.12	31,649,361.83
基金赎回款	15,467,883.74	-23,381,147.55	-7,913,263.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,401,966.07	33,866,323.38	89,268,289.45

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	220,366.77	128,062.32
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	110,069.17	102,843.54
其他	6,055.90	2,334.28
合计	336,491.84	233,240.14

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	151,179,577.81	4,524,573.48
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	151,179,577.81	4,524,573.48

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,684,597,723.86	1,373,473,115.44
减：卖出股票成本总额	2,531,169,789.35	1,367,689,795.89
减：交易费用	2,248,356.70	1,258,746.07
买卖股票差价收入	151,179,577.81	4,524,573.48

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

	31日	日
债券投资收益——利息收入	101.51	151.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	339,367.74	85,504.67
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	339,469.25	85,656.02

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,202,815.02	614,686.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	863,297.11	528,994.24
减：应计利息总额	102.06	163.16
减：交易费用	48.11	24.55
买卖债券差价收入	339,367.74	85,504.67

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股指期货投资收益	11,065,192.28	3,442,282.12

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,264,750.75	7,737,648.68
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	7,264,750.75	7,737,648.68

## 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	17,687,647.85	32,387,964.67
——股票投资	17,689,404.87	32,386,207.65
——债券投资	-1,757.02	1,757.02
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	3,637,640.00	337,480.00
——权证投资	-	-
——期货投资	3,637,640.00	337,480.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	21,325,287.85	32,725,444.67

## 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	438,961.99	233,834.62
合计	438,961.99	233,834.62

## 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

## 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	42,000.00	42,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	5,971.50	3,487.13
存托服务费	253.96	148.49
合计	168,225.46	165,635.62

#### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司	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
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达私募基金管理有限公司	基金管理人的子公司
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
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	409,946,277.43	7.43%	1,287,012,756.77	46.37%

## 7.4.10.1.2 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。

## 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	-	-	227,444.64	37.00%

## 7.4.10.1.4 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。

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	40,993.53	7.43%	40,993.53	20.18%
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	244,948.40	62.19%	-	-

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

2.2024 年 7 月 1 日前，本基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为基金提供的证券交易服务及研究服务。自 2024 年 7 月 1 日起，本基金佣金协议约定的服务仅包括证券交易服务，不包括研究服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,907,050.19	3,612,150.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,668,361.52	1,309,615.16
应支付基金管理人的净管理费	3,238,688.67	2,302,535.04

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

	月31日	月31日
当期发生的基金应支付的托管费	920,071.94	677,278.12

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	202,477.55	202,477.55
中国工商银行	-	84,580.49	84,580.49
广发证券	-	3,824.81	3,824.81
合计	-	290,882.85	290,882.85
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证500量化增强A	易方达中证500量化增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	59,471.18	59,471.18
中国工商银行	-	67,212.98	67,212.98
广发证券	-	5,670.52	5,670.52
合计	-	132,354.68	132,354.68

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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 500 量化增强 A

无。

易方达中证 500 量化增强 C

无。

#### 7.4.10.6 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12月31日		2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	93,838,945.20	220,366.77	29,034,507.86	128,062.32

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

## 7.4.10.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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
万联证券股份有限公司	001396	誉帆科技	新股发行	688	15,335.52
广发证券股份有限公司	688795	摩尔线程	新股发行	4,359	498,146.52
广发证券股份有限公司	688805	健信超导	新股发行	2,643	49,106.94
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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
-	-	-	-	-	-

注：万联证券股份有限公司为本基金管理人股东的关联方。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

易方达中证 500 量化增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 500 量化增强 C

本报告期内未发生利润分配。

## 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001221	悍高集团	2025-07-23	6 个月	新股流通受限	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001233	海安集团	2025-11-18	6 个月	新股流通受限	48.00	51.88	367	17,616.00	19,039.96	-
001280	中国铝业	2025-11-25	6 个月	新股流通受限	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6 个月	新股流通受限	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
001369	双欣环保	2025-12-23	6 个月	新股流通受限	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001386	马可波罗	2025-10-15	6 个月	新股流通受限	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股流通受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
001396	誉帆科技	2025-12-23	6 个月	新股流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301563	云汉芯城	2025-09-23	6 个月	新股流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025-09-03	6 个月	新股流通受限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025-09-18	6 个月	新股流通受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025-07-16	6 个月	新股流通受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301632	广东建科	2025-08-05	6 个月	新股流通受限	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301638	南网	2025-11-11	6 个月	新股	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-

	数字			流通受限						
301656	联合动力	2025-09-17	6 个月	新股流通受限	12.48	25.46	5,093	63,560.64	129,667.78	-
301667	纳百川	2025-12-10	6 个月	新股流通受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6 个月	新股流通受限	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
601026	道生天合	2025-10-09	6 个月	新股流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025-10-30	6 个月	新股流通受限	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6 个月	新股流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025-12-16	6 个月	新股流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025-07-16	6 个月	新股流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6 个月	新股流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025-08-27	6 个月	新股流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6 个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025-07-30	6 个月	新股流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025-09-16	6 个月	新股流通受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-

688727	恒坤新材	2025-11-11	6 个月	新股流通受限	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688729	屹唐股份	2025-07-01	6 个月	新股流通受限	8.45	24.28	2,454	20,736.30	59,583.12	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	25.13	12,552	223,174.56	315,431.76	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	18.39	36,359	313,414.58	668,642.01	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	117.07	2,319	192,616.14	271,485.33	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	416.02	3,052	348,782.56	1,269,693.04	-
688796	百奥赛图	2025-12-02	6 个月	新股流通受限	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	104.66	399.40	2,197	229,938.02	877,481.80	-
688805	健信超导	2025-12-17	6 个月	新股流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6 个月	新股流通受限	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025-12-23	6 个月	新股流通受限	85.09	203.31	247	21,017.23	50,217.57	-

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。

#### 7.4.12.2 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
001331	胜通能源	2025-12-30	重大事项停牌	46.31	2026-01-06	50.94	100	992.57	4,631.00	-

002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项 停牌	78.81	2026-01-15	86.69	8,100	663,583.00	638,361.00	-
--------	------	------------	------------	-------	------------	-------	-------	------------	------------	---

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的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、以及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“风险揭示”部分。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。

##### 7.4.13.2 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 12 月 31 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%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 7.4.13.2.1 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12月31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。

#### 7.4.13.2.2 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12月31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

#### 7.4.13.2.3 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12月31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

## 7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	6,763.12
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	6,763.12

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。

## 7.4.13.2.5 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12月31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

## 7.4.13.2.6 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12月31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

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 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同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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	93,838,945.20	-	-	-	93,838,945.20
结算备付金	20,465,659.24	-	-	-	20,465,659.24
存出保证金	7,176,899.72	-	-	-	7,176,899.72
交易性金融资产	-	-	-	794,912,543.65	794,912,543.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	40,825,625.43	40,825,625.43
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,157,303.44	4,157,303.44
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	121,481,504.16	-	-	839,895,472.52	961,376,976.68
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	50,744,236.22	50,744,236.22
应付管理人报酬	-	-	-	571,464.53	571,464.53
应付托管费	-	-	-	107,149.60	107,149.60

应付销售服务费	-	-	-	127,652.44	127,652.44
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	305,300.69	305,300.69
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	366,275.66	366,275.66
负债总计	-	-	-	52,222,079.14	52,222,079.14
利率敏感度缺口	121,481,504.16	-	-	787,673,393.38	909,154,897.54
<b>上年度末</b>					
<b>2024 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	29,034,507.86	-	-	-	29,034,507.86
结算备付金	2,161,097.77	-	-	-	2,161,097.77
存出保证金	44,958.72	-	-	-	44,958.72
交易性金融资产	-	-	6,763.12	467,912,382.63	467,919,145.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	132,201.37	132,201.37
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,290,358.19	1,290,358.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	31,240,564.35	-	6,763.12	469,334,942.19	500,582,269.66
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	-	-	-	376,268.05	376,268.05
应付赎回款	-	-	-	1,452,262.73	1,452,262.73
应付管理人报酬	-	-	-	346,634.53	346,634.53

应付托管费	-	-	-	64,994.00	64,994.00
应付销售服务费	-	-	-	41,391.14	41,391.14
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.12	1.12
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	256,979.50	256,979.50
负债总计	-	-	-	2,538,531.07	2,538,531.07
利率敏感度缺口	31,240,564.35	-	6,763.12	466,796,411.12	498,043,738.59

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	794,912,543.65	87.43	467,912,382.63	93.95

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	794,912,543.65	87.43	467,912,382.63	93.95

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

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	39,669,375.38	24,088,999.05
2.业绩比较基准下降 5%	-39,669,375.38	-24,088,999.05	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	790,201,464.79	467,469,460.19
第二层次	642,992.00	27,736.50
第三层次	4,068,086.86	421,949.06
合计	794,912,543.65	467,919,145.75

###### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	421,949.06	421,949.06
当期购买	-	1,784,640.69	1,784,640.69
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,003,412.76	1,003,412.76
当期利得或损失总额	-	2,864,909.87	2,864,909.87
其中:计入损益的利得或损失	-	2,864,909.87	2,864,909.87
计入其他综合收益的利得或损失(若有)	-	-	-
期末余额	-	4,068,086.86	4,068,086.86
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	2,451,050.01	2,451,050.01
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	918,232.00	918,232.00
当期购买	-	413,021.12	413,021.12
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,200,529.77	1,200,529.77
当期利得或损失总额	-	291,225.71	291,225.71

其中：计入损益的利得或损失	-	291,225.71	291,225.71
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	421,949.06	421,949.06
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	231,759.11	231,759.11

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	4,068,086.86	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.18—3.0323	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	421,949.06	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3423—4.9648	负相关

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	794,912,543.65	82.68
	其中：股票	794,912,543.65	82.68
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	114,304,604.44	11.89
8	其他各项资产	52,159,828.59	5.43
9	合计	961,376,976.68	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 8.2.1.1 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	1,662,115.00	0.18
B	采矿业	30,644,964.60	3.37
C	制造业	479,419,276.56	52.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,736,314.70	1.84
E	建筑业	4,751,887.00	0.52
F	批发和零售业	17,611,807.40	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	9,765,874.70	1.07
H	住宿和餐饮业	1,718,360.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,469,716.76	5.77
J	金融业	48,782,760.76	5.37

K	房地产业	7,244,732.00	0.80
L	租赁和商务服务业	2,623,040.00	0.29
M	科学研究和技术服务业	5,282,296.60	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	520,904.00	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,890,714.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	7,482,265.00	0.82
S	综合	1,112,528.00	0.12
	合计	689,719,557.08	75.86

## 8.2.1.2 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	278,559.00	0.03
B	采矿业	1,079,754.72	0.12
C	制造业	75,343,656.37	8.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,881,872.00	0.43
E	建筑业	772,242.00	0.08
F	批发和零售业	2,209,815.84	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	1,232,729.00	0.14
H	住宿和餐饮业	75,375.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,343,754.26	0.81
J	金融业	3,942,668.20	0.43
K	房地产业	1,158,604.00	0.13
L	租赁和商务服务业	3,010,384.44	0.33
M	科学研究和技术服务业	2,411,378.48	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	629,744.26	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	947,952.00	0.10
Q	卫生和社会工作	196,708.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	646,295.00	0.07
S	综合	31,494.00	0.00
	合计	105,192,986.57	11.57

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	002156	通富微电	214,700	8,094,190.00	0.89
2	002436	兴森科技	381,300	8,072,121.00	0.89
3	600988	赤峰黄金	212,400	6,635,376.00	0.73
4	000933	神火股份	239,400	6,576,318.00	0.72
5	000783	长江证券	776,000	6,324,400.00	0.70
6	600096	云天化	185,800	6,207,578.00	0.68
7	600549	厦门钨业	150,600	6,183,636.00	0.68
8	000733	振华科技	115,500	6,053,355.00	0.67
9	600873	梅花生物	594,700	6,024,311.00	0.66
10	688002	睿创微纳	59,433	5,990,846.40	0.66
11	300207	欣旺达	216,000	5,648,400.00	0.62
12	600166	福田汽车	1,931,600	5,640,272.00	0.62
13	002008	大族激光	136,600	5,626,554.00	0.62
14	300604	长川科技	55,300	5,602,443.00	0.62
15	002841	视源股份	139,700	5,536,311.00	0.61
16	688772	珠海冠宇	250,351	5,390,057.03	0.59
17	688561	奇安信	151,003	5,372,686.74	0.59
18	002281	光迅科技	76,100	5,323,195.00	0.59
19	002603	以岭药业	310,300	5,296,821.00	0.58
20	002558	巨人网络	121,600	5,264,064.00	0.58
21	601108	财通证券	599,100	5,224,152.00	0.57
22	603659	璞泰来	188,565	5,155,367.10	0.57
23	603486	科沃斯	63,800	5,147,384.00	0.57
24	002414	高德红外	344,016	5,046,714.72	0.56
25	601865	福莱特	320,600	5,023,802.00	0.55
26	601128	常熟银行	706,231	4,971,866.24	0.55
27	300454	深信服	43,100	4,963,396.00	0.55
28	300373	扬杰科技	71,300	4,848,400.00	0.53

29	300073	当升科技	83,378	4,819,248.40	0.53
30	601717	中创智领	192,100	4,716,055.00	0.52
31	301308	江波龙	18,900	4,627,476.00	0.51
32	002410	广联达	361,300	4,545,154.00	0.50
33	300003	乐普医疗	276,600	4,373,046.00	0.48
34	001696	宗申动力	198,700	4,309,803.00	0.47
35	600909	华安证券	625,900	4,243,602.00	0.47
36	002195	岩山科技	594,300	4,213,587.00	0.46
37	601168	西部矿业	151,700	4,192,988.00	0.46
38	603529	爱玛科技	139,500	4,143,150.00	0.46
39	002138	顺络电子	115,700	4,110,821.00	0.45
40	600378	昊华科技	123,800	3,956,648.00	0.44
41	603379	三美股份	64,800	3,934,656.00	0.43
42	000050	深天马 A	435,400	3,931,662.00	0.43
43	000932	华菱钢铁	698,300	3,924,446.00	0.43
44	300735	光弘科技	156,200	3,883,132.00	0.43
45	300017	网宿科技	377,200	3,866,300.00	0.43
46	603699	纽威股份	73,000	3,793,810.00	0.42
47	600499	科达制造	272,400	3,778,188.00	0.42
48	688017	绿的谐波	19,372	3,721,361.20	0.41
49	300450	先导智能	74,200	3,708,516.00	0.41
50	603858	步长制药	236,100	3,692,604.00	0.41
51	002294	信立泰	74,000	3,666,700.00	0.40
52	600885	宏发股份	120,500	3,663,200.00	0.40
53	601918	新集能源	553,400	3,657,974.00	0.40
54	002312	川发龙蟒	333,600	3,646,248.00	0.40
55	000729	燕京啤酒	323,500	3,632,905.00	0.40
56	688629	华丰科技	36,163	3,618,469.78	0.40
57	300857	协创数据	21,400	3,609,752.00	0.40
58	600848	上海临港	300,500	3,515,850.00	0.39
59	002299	圣农发展	211,600	3,499,864.00	0.38
60	601555	东吴证券	381,300	3,454,578.00	0.38
61	300474	景嘉微	47,900	3,442,573.00	0.38
62	300012	华测检测	253,800	3,438,990.00	0.38
63	300748	金力永磁	99,800	3,404,178.00	0.37
64	002273	水晶光电	135,300	3,398,736.00	0.37
65	600060	海信视像	138,800	3,370,064.00	0.37
66	688235	百济神州	12,462	3,347,293.20	0.37
67	300496	中科创达	49,450	3,337,875.00	0.37
68	603160	汇顶科技	42,200	3,333,800.00	0.37
69	603444	吉比特	7,800	3,306,030.00	0.36
70	002202	金风科技	160,900	3,282,360.00	0.36
71	688220	翱捷科技	39,495	3,262,681.95	0.36
72	601019	山东出版	374,675	3,237,192.00	0.36

73	600884	杉杉股份	239,300	3,232,943.00	0.36
74	300458	全志科技	76,300	3,206,889.00	0.35
75	300054	鼎龙股份	84,700	3,184,720.00	0.35
76	600801	华新建材	129,600	3,180,384.00	0.35
77	002926	华西证券	337,600	3,132,928.00	0.34
78	603979	金诚信	40,500	3,084,075.00	0.34
79	000887	中鼎股份	132,200	3,068,362.00	0.34
80	300567	精测电子	33,300	3,036,960.00	0.33
81	603939	益丰药房	139,400	3,027,768.00	0.33
82	000951	中国重汽	176,300	2,979,470.00	0.33
83	301200	大族数控	25,000	2,969,250.00	0.33
84	600392	盛和资源	137,700	2,964,681.00	0.33
85	301358	湖南裕能	45,100	2,916,166.00	0.32
86	000997	新大陆	101,900	2,885,808.00	0.32
87	300146	汤臣倍健	239,000	2,870,390.00	0.32
88	688322	奥比中光	31,785	2,850,160.95	0.31
89	600170	上海建工	1,071,600	2,839,740.00	0.31
90	603606	东方电缆	46,700	2,790,325.00	0.31
91	601997	贵阳银行	475,200	2,789,424.00	0.31
92	002444	巨星科技	81,700	2,779,434.00	0.31
93	300888	稳健医疗	72,600	2,747,184.00	0.30
94	002244	滨江集团	272,300	2,736,615.00	0.30
95	002461	珠江啤酒	293,800	2,729,402.00	0.30
96	600704	物产中大	487,600	2,715,932.00	0.30
97	002850	科达利	17,200	2,715,192.00	0.30
98	002340	格林美	316,600	2,646,776.00	0.29
99	600578	京能电力	510,900	2,605,590.00	0.29
100	300390	天华新能	46,800	2,555,748.00	0.28
101	688702	盛科通信	17,789	2,520,523.41	0.28
102	002738	中矿资源	31,100	2,442,905.00	0.27
103	603737	三棵树	52,700	2,438,429.00	0.27
104	688183	生益电子	25,437	2,434,066.53	0.27
105	600487	亨通光电	97,900	2,421,067.00	0.27
106	688578	艾力斯	23,165	2,412,634.75	0.27
107	603233	大参林	134,900	2,376,938.00	0.26
108	603129	春风动力	8,500	2,368,780.00	0.26
109	600546	山煤国际	234,000	2,361,060.00	0.26
110	002056	横店东磁	120,600	2,351,700.00	0.26
111	601991	大唐发电	669,700	2,337,253.00	0.26
112	600132	重庆啤酒	44,400	2,319,456.00	0.26
113	603920	世运电路	47,400	2,294,634.00	0.25
114	600583	海油工程	417,900	2,294,271.00	0.25
115	000415	渤海租赁	564,300	2,285,415.00	0.25
116	002402	和而泰	57,800	2,261,136.00	0.25

117	002595	豪迈科技	26,700	2,256,417.00	0.25
118	002080	中材科技	61,600	2,238,544.00	0.25
119	688525	佰维存储	19,372	2,223,711.88	0.24
120	002185	华天科技	199,200	2,185,224.00	0.24
121	688692	达梦数据	8,325	2,175,072.75	0.24
122	688295	中复神鹰	65,820	2,159,554.20	0.24
123	002739	万达电影	189,900	2,149,668.00	0.24
124	002155	湖南黄金	100,840	2,126,715.60	0.23
125	689009	九号公司	38,078	2,116,756.02	0.23
126	688385	复旦微电	28,585	2,106,714.50	0.23
127	688347	华虹公司	19,426	2,095,482.62	0.23
128	600699	均胜电子	66,700	2,091,712.00	0.23
129	000959	首钢股份	422,900	2,072,210.00	0.23
130	688778	厦钨新能	26,296	2,034,521.52	0.22
131	688301	奕瑞科技	19,886	2,010,673.46	0.22
132	688052	纳芯微	12,685	2,006,513.30	0.22
133	600737	中粮糖业	116,400	2,003,244.00	0.22
134	600517	国网英大	332,600	1,998,926.00	0.22
135	300972	万辰集团	9,900	1,990,593.00	0.22
136	600143	金发科技	100,400	1,961,816.00	0.22
137	300037	新宙邦	37,100	1,944,040.00	0.21
138	600808	马钢股份	456,200	1,925,164.00	0.21
139	001286	陕西能源	206,400	1,921,584.00	0.21
140	000423	东阿阿胶	38,900	1,909,212.00	0.21
141	000657	中钨高新	68,100	1,887,051.00	0.21
142	300558	贝达药业	40,300	1,881,607.00	0.21
143	601958	金钼股份	119,700	1,864,926.00	0.21
144	000598	兴蓉环境	255,900	1,834,803.00	0.20
145	002508	老板电器	93,900	1,816,965.00	0.20
146	603596	伯特利	35,300	1,809,831.00	0.20
147	600109	国金证券	194,600	1,809,780.00	0.20
148	300142	沃森生物	163,700	1,785,967.00	0.20
149	603298	杭叉集团	66,400	1,764,248.00	0.19
150	600995	南网储能	138,800	1,744,716.00	0.19
151	600754	锦江酒店	68,000	1,718,360.00	0.19
152	002085	万丰奥威	107,000	1,713,070.00	0.19
153	600685	中船防务	60,100	1,709,845.00	0.19
154	688297	中无人机	35,409	1,700,340.18	0.19
155	000062	深圳华强	68,620	1,689,424.40	0.19
156	300001	特锐德	65,600	1,684,608.00	0.19
157	300627	华测导航	47,600	1,661,716.00	0.18
158	002831	裕同科技	57,000	1,625,070.00	0.18
159	600038	中直股份	44,600	1,611,398.00	0.18
160	301536	星宸科技	26,436	1,583,780.76	0.17

161	600352	浙江龙盛	148,300	1,580,878.00	0.17
162	603341	龙旗科技	36,900	1,559,394.00	0.17
163	600901	江苏金租	253,800	1,553,256.00	0.17
164	002318	久立特材	52,800	1,528,560.00	0.17
165	000683	博源化工	205,200	1,526,688.00	0.17
166	600282	南钢股份	289,900	1,524,874.00	0.17
167	601061	中信金属	104,600	1,506,240.00	0.17
168	600598	北大荒	100,300	1,499,485.00	0.16
169	300763	锦浪科技	20,700	1,478,187.00	0.16
170	600497	驰宏锌锗	200,800	1,467,848.00	0.16
171	688188	柏楚电子	10,655	1,447,907.95	0.16
172	600998	九州通	279,800	1,432,576.00	0.16
173	000750	国海证券	337,500	1,431,000.00	0.16
174	600763	通策医疗	35,400	1,423,434.00	0.16
175	600563	法拉电子	13,400	1,406,330.00	0.15
176	300919	中伟股份	30,100	1,394,533.00	0.15
177	002409	雅克科技	18,700	1,385,670.00	0.15
178	688281	华秦科技	18,630	1,374,894.00	0.15
179	688100	威胜信息	34,873	1,370,508.90	0.15
180	600968	海油发展	353,300	1,356,672.00	0.15
181	600959	江苏有线	393,000	1,351,920.00	0.15
182	600329	达仁堂	29,600	1,350,352.00	0.15
183	002608	江苏国信	182,500	1,348,675.00	0.15
184	000034	神州数码	34,500	1,342,395.00	0.15
185	600141	兴发集团	38,800	1,341,704.00	0.15
186	600126	杭钢股份	163,400	1,333,344.00	0.15
187	601577	长沙银行	135,400	1,313,380.00	0.14
188	600380	健康元	112,300	1,297,065.00	0.14
189	600435	北方导航	83,900	1,293,738.00	0.14
190	002966	苏州银行	155,600	1,289,924.00	0.14
191	600602	云赛智联	68,000	1,270,920.00	0.14
192	600332	白云山	49,200	1,266,408.00	0.14
193	002583	海能达	111,100	1,257,652.00	0.14
194	603766	隆鑫通用	77,700	1,251,747.00	0.14
195	002271	东方雨虹	91,700	1,246,203.00	0.14
196	601156	东航物流	66,900	1,231,629.00	0.14
197	603728	鸣志电器	16,900	1,222,715.00	0.13
198	600369	西南证券	266,700	1,194,816.00	0.13
199	601000	唐山港	310,700	1,193,088.00	0.13
200	002430	杭氧股份	39,700	1,185,839.00	0.13
201	601106	中国一重	293,600	1,171,464.00	0.13
202	600004	白云机场	123,745	1,170,627.70	0.13
203	600511	国药股份	40,600	1,167,250.00	0.13
204	300395	菲利华	11,500	1,153,450.00	0.13

205	300679	电连技术	23,600	1,148,848.00	0.13
206	600820	隧道股份	176,400	1,144,836.00	0.13
207	603786	科博达	14,500	1,132,450.00	0.12
208	603565	中谷物流	111,700	1,121,468.00	0.12
209	600673	东阳光	49,600	1,112,528.00	0.12
210	600906	财达证券	165,300	1,102,551.00	0.12
211	600967	内蒙一机	64,300	1,080,240.00	0.12
212	600312	平高电气	62,200	1,079,170.00	0.12
213	601231	环旭电子	35,500	1,065,000.00	0.12
214	600098	广州发展	160,100	1,047,054.00	0.12
215	000960	锡业股份	37,000	1,031,560.00	0.11
216	002773	康弘药业	34,200	1,024,974.00	0.11
217	000987	越秀资本	124,128	1,010,401.92	0.11
218	601608	中信重工	153,000	1,008,270.00	0.11
219	600688	上海石化	360,500	1,002,190.00	0.11
220	688336	三生国健	16,678	993,508.46	0.11
221	600177	雅戈尔	129,200	981,920.00	0.11
222	000429	粤高速 A	82,500	971,850.00	0.11
223	603228	景旺电子	13,000	950,170.00	0.10
224	002837	英维克	8,800	940,632.00	0.10
225	601333	广深铁路	306,800	932,672.00	0.10
226	688617	惠泰医疗	3,756	913,722.12	0.10
227	600601	方正科技	77,300	905,956.00	0.10
228	600118	中国卫星	9,200	873,540.00	0.10
229	000088	盐田港	195,800	871,310.00	0.10
230	688019	安集科技	3,956	862,091.52	0.09
231	600580	卧龙电驱	17,500	859,250.00	0.09
232	600977	中国电影	54,400	855,168.00	0.09
233	603885	吉祥航空	55,700	828,816.00	0.09
234	601216	君正集团	171,600	827,112.00	0.09
235	603338	浙江鼎力	14,600	826,944.00	0.09
236	600062	华润双鹤	44,100	806,589.00	0.09
237	601665	齐鲁银行	137,900	791,546.00	0.09
238	600390	五矿资本	141,700	786,435.00	0.09
239	002465	海格通信	49,700	782,775.00	0.09
240	002126	银轮股份	20,300	767,340.00	0.08
241	003035	南网能源	167,200	765,776.00	0.08
242	002203	海亮股份	58,600	741,876.00	0.08
243	002432	九安医疗	18,100	724,724.00	0.08
244	002078	太阳纸业	46,000	724,500.00	0.08
245	002673	西部证券	90,800	716,412.00	0.08
246	600970	中材国际	67,500	701,325.00	0.08
247	000825	太钢不锈	143,400	701,226.00	0.08
248	600863	内蒙华电	155,400	696,192.00	0.08

249	688475	萤石网络	22,884	689,037.24	0.08
250	603049	中策橡胶	12,300	688,185.00	0.08
251	300601	康泰生物	46,500	686,805.00	0.08
252	688608	恒玄科技	2,999	680,593.06	0.07
253	688819	天能股份	20,476	680,212.72	0.07
254	600339	中油工程	198,000	663,300.00	0.07
255	605589	圣泉集团	23,200	656,560.00	0.07
256	600298	安琪酵母	14,800	647,352.00	0.07
257	600208	衢州发展	166,900	645,903.00	0.07
258	601212	白银有色	109,800	642,330.00	0.07
259	003022	联泓新科	32,200	637,882.00	0.07
260	000831	中国稀土	13,600	631,584.00	0.07
261	600764	中国海防	23,100	631,554.00	0.07
262	002130	沃尔核材	23,700	623,784.00	0.07
263	603179	新泉股份	8,400	620,592.00	0.07
264	002532	天山铝业	38,300	619,694.00	0.07
265	600927	永安期货	38,500	618,695.00	0.07
266	002958	青农商行	199,400	618,140.00	0.07
267	002262	恩华药业	25,600	617,728.00	0.07
268	300002	神州泰岳	53,600	617,472.00	0.07
269	002152	广电运通	44,600	615,926.00	0.07
270	600862	中航高科	25,900	612,017.00	0.07
271	002064	华峰化学	55,100	606,100.00	0.07
272	002128	电投能源	21,600	602,856.00	0.07
273	601162	天风证券	144,600	601,536.00	0.07
274	600535	天士力	39,600	596,772.00	0.07
275	688615	合合信息	2,589	589,204.62	0.06
276	603899	晨光股份	21,700	587,202.00	0.06
277	601615	明阳智能	39,600	573,408.00	0.06
278	600131	国网信通	35,500	572,970.00	0.06
279	600398	海澜之家	94,600	572,330.00	0.06
280	688728	格科微	38,190	570,558.60	0.06
281	600642	申能股份	72,000	560,160.00	0.06
282	002372	伟星新材	53,300	555,919.00	0.06
283	600363	联创光电	8,800	554,928.00	0.06
284	002223	鱼跃医疗	14,500	554,045.00	0.06
285	002025	航天电器	10,900	546,417.00	0.06
286	600562	国睿科技	19,000	536,940.00	0.06
287	300570	太辰光	4,600	531,530.00	0.06
288	688469	芯联集成	79,328	530,704.32	0.06
289	000021	深科技	20,900	528,352.00	0.06
290	300676	华大基因	11,500	521,640.00	0.06
291	603806	福斯特	37,200	519,312.00	0.06
292	000539	粤电力 A	111,800	494,156.00	0.05

293	603077	和邦生物	214,400	484,544.00	0.05
294	600295	鄂尔多斯	39,000	482,040.00	0.05
295	603927	中科软	25,200	481,068.00	0.05
296	603156	养元饮品	16,600	477,250.00	0.05
297	600498	烽火通信	14,600	468,368.00	0.05
298	002044	美年健康	88,500	467,280.00	0.05
299	601966	玲珑轮胎	32,100	466,413.00	0.05
300	000728	国元证券	53,296	445,021.60	0.05
301	000830	鲁西化工	25,900	429,163.00	0.05
302	000039	中集集团	42,300	426,807.00	0.05
303	300144	宋城演艺	51,700	423,423.00	0.05
304	000400	许继电气	16,300	419,073.00	0.05
305	601001	晋控煤业	31,500	414,225.00	0.05
306	000528	柳工	34,400	408,328.00	0.04
307	603707	健友股份	45,200	408,156.00	0.04
308	600637	东方明珠	41,000	403,850.00	0.04
309	002683	广东宏大	8,400	401,520.00	0.04
310	603833	欧派家居	7,700	401,093.00	0.04
311	600765	中航重机	20,780	398,144.80	0.04
312	601880	辽港股份	245,900	393,440.00	0.04
313	600879	航天电子	18,200	388,024.00	0.04
314	002821	凯莱英	4,100	381,013.00	0.04
315	601928	凤凰传媒	37,400	375,496.00	0.04
316	300957	贝泰妮	9,400	372,334.00	0.04
317	002335	科华数据	6,700	372,051.00	0.04
318	600655	豫园股份	70,700	362,691.00	0.04
319	000591	太阳能	80,300	356,532.00	0.04
320	300140	节能环境	52,200	353,394.00	0.04
321	000883	湖北能源	76,600	347,764.00	0.04
322	600720	中交设计	47,900	345,838.00	0.04
323	000709	河钢股份	147,600	340,956.00	0.04
324	600153	建发股份	36,500	337,625.00	0.04
325	601228	广州港	104,000	336,960.00	0.04
326	000739	普洛药业	20,700	336,789.00	0.04
327	600316	洪都航空	9,600	335,136.00	0.04
328	002353	杰瑞股份	4,700	332,901.00	0.04
329	002429	兆驰股份	44,700	331,674.00	0.04
330	603345	安井食品	4,100	325,048.00	0.04
331	601699	潞安环能	27,300	322,140.00	0.04
332	002261	拓维信息	9,600	317,760.00	0.03
333	688318	财富趋势	2,389	316,112.48	0.03
334	000155	川能动力	26,600	309,890.00	0.03
335	688166	博瑞医药	6,311	309,617.66	0.03
336	002500	山西证券	50,400	301,896.00	0.03

337	600008	首创环保	100,400	301,200.00	0.03
338	600516	方大炭素	52,900	301,001.00	0.03
339	000723	美锦能源	63,000	296,100.00	0.03
340	600348	华阳股份	34,900	288,274.00	0.03
341	301498	乖宝宠物	4,300	280,145.00	0.03
342	601921	浙版传媒	35,700	279,174.00	0.03
343	688538	和辉光电	104,543	278,084.38	0.03
344	688122	西部超导	3,709	276,617.22	0.03
345	601567	三星医疗	12,000	276,240.00	0.03
346	601990	南京证券	34,400	272,448.00	0.03
347	600566	济川药业	10,300	270,890.00	0.03
348	000921	海信家电	10,800	267,948.00	0.03
349	688425	铁建重工	49,822	252,597.54	0.03
350	000513	丽珠集团	7,200	248,112.00	0.03
351	300136	信维通信	4,000	248,000.00	0.03
352	600299	安迪苏	27,000	242,190.00	0.03
353	002984	森麒麟	11,300	239,221.00	0.03
354	600483	福能股份	25,210	238,738.70	0.03
355	001389	广合科技	2,800	228,564.00	0.03
356	688777	中控技术	4,600	226,964.00	0.02
357	688387	信科移动	17,439	224,963.10	0.02
358	600985	淮北矿业	20,100	223,311.00	0.02
359	601598	中国外运	36,500	221,190.00	0.02
360	603290	斯达半导	2,300	221,007.00	0.02
361	600663	陆家嘴	27,000	213,570.00	0.02
362	002568	百润股份	9,700	211,557.00	0.02
363	002472	双环传动	4,400	208,604.00	0.02
364	000582	北部湾港	22,200	208,236.00	0.02
365	000898	鞍钢股份	82,200	207,966.00	0.02
366	688363	华熙生物	4,744	207,217.92	0.02
367	300677	英科医疗	5,100	198,390.00	0.02
368	688180	君实生物	5,719	195,361.04	0.02
369	600707	彩虹股份	29,900	194,051.00	0.02
370	300724	捷佳伟创	2,000	191,200.00	0.02
371	601099	太平洋	45,900	188,649.00	0.02
372	688563	航材股份	3,213	187,799.85	0.02
373	000027	深圳能源	28,800	187,776.00	0.02
374	300529	健帆生物	9,500	186,865.00	0.02
375	600528	中铁工业	22,300	182,414.00	0.02
376	601866	中远海发	71,700	180,684.00	0.02
377	688248	南网科技	3,990	178,512.60	0.02
378	600486	扬农化工	2,500	173,475.00	0.02
379	600032	浙江新能	22,600	167,466.00	0.02
380	601233	桐昆股份	9,600	165,216.00	0.02

381	601118	海南橡胶	27,800	162,630.00	0.02
382	601098	中南传媒	14,400	162,144.00	0.02
383	600582	天地科技	26,600	155,078.00	0.02
384	300699	光威复材	3,800	149,948.00	0.02
385	603658	安图生物	4,030	142,742.60	0.02
386	688065	凯赛生物	2,713	135,107.40	0.01
387	600007	中国国贸	6,700	132,794.00	0.01
388	603087	甘李药业	1,900	129,333.00	0.01
389	601198	东兴证券	9,100	126,308.00	0.01
390	000703	恒逸石化	11,400	122,778.00	0.01
391	688599	天合光能	7,291	120,666.05	0.01
392	688120	华海清科	765	114,811.20	0.01
393	688582	芯动联科	1,725	114,039.75	0.01
394	600021	上海电力	5,200	104,104.00	0.01
395	300383	光环新网	7,500	93,825.00	0.01
396	002007	华兰生物	6,100	92,293.00	0.01
397	000937	冀中能源	16,900	90,922.00	0.01
398	002939	长城证券	8,600	87,720.00	0.01
399	601696	中银证券	5,600	83,944.00	0.01
400	688568	中科星图	1,419	83,721.00	0.01
401	300115	长盈精密	1,800	83,700.00	0.01
402	002266	浙富控股	20,100	83,616.00	0.01
403	002945	华林证券	5,400	82,782.00	0.01
404	000878	云南铜业	4,000	82,040.00	0.01
405	600536	中国软件	1,700	78,710.00	0.01
406	300718	长盛轴承	900	76,824.00	0.01
407	000563	陕国投 A	22,000	75,900.00	0.01
408	300487	蓝晓科技	1,200	74,100.00	0.01
409	001213	中铁特货	18,000	72,900.00	0.01
410	000738	航发控制	3,400	72,454.00	0.01
411	300432	富临精工	4,000	66,800.00	0.01
412	002670	国盛证券	3,900	65,676.00	0.01
413	300285	国瓷材料	2,200	60,302.00	0.01
414	603225	新凤鸣	3,000	58,380.00	0.01
415	002756	永兴材料	1,000	54,250.00	0.01
416	000629	钒钛股份	17,300	53,630.00	0.01
417	688349	三一重能	2,107	53,264.96	0.01
418	002439	启明星辰	3,700	52,244.00	0.01
419	002265	建设工业	1,900	50,958.00	0.01
420	600521	华海药业	3,000	50,910.00	0.01
421	603568	伟明环保	1,900	48,222.00	0.01
422	000519	中兵红箭	2,600	47,346.00	0.01
423	300346	南大光电	1,100	47,190.00	0.01
424	688099	晶晨股份	537	46,842.51	0.01

425	002851	麦格米特	500	45,035.00	0.00
426	688114	华大智造	736	44,719.36	0.00
427	002385	大北农	10,900	43,600.00	0.00
428	300623	捷捷微电	1,600	43,472.00	0.00
429	300223	北京君正	400	42,416.00	0.00
430	002797	第一创业	6,100	41,907.00	0.00
431	688375	国博电子	439	40,875.29	0.00
432	002065	东华软件	4,400	40,260.00	0.00
433	601179	中国西电	4,200	38,220.00	0.00
434	003031	中瓷电子	500	36,580.00	0.00
435	601016	节能风电	12,100	35,695.00	0.00
436	300070	碧水源	9,100	35,672.00	0.00
437	000958	电投产融	5,500	35,585.00	0.00
438	601666	平煤股份	4,500	35,415.00	0.00
439	600606	绿地控股	21,100	35,026.00	0.00
440	000537	中绿电	4,100	33,661.00	0.00
441	603688	石英股份	900	32,922.00	0.00
442	002423	中粮资本	2,800	32,760.00	0.00
443	601965	中国汽研	1,900	31,540.00	0.00
444	002120	韵达股份	4,600	31,004.00	0.00
445	000032	深桑达 A	1,600	30,960.00	0.00
446	300024	机器人	1,600	29,104.00	0.00
447	600871	石化油服	13,400	28,944.00	0.00
448	601139	深圳燃气	4,200	27,720.00	0.00
449	600171	上海贝岭	800	25,000.00	0.00
450	301301	川宁生物	2,200	22,308.00	0.00
451	688172	燕东微	760	21,994.40	0.00
452	688234	天岳先进	245	21,775.60	0.00
453	603000	人民网	1,100	20,955.00	0.00
454	688278	特宝生物	205	17,154.40	0.00
455	603589	口子窖	500	15,025.00	0.00
456	688520	神州细胞	305	13,209.55	0.00
457	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
458	603605	珀莱雅	100	6,848.00	0.00

## 8.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600415	小商品城	106,300	1,695,485.00	0.19
2	300573	兴齐眼药	23,160	1,627,916.40	0.18
3	688072	拓荆科技	4,817	1,589,610.00	0.17
4	301031	中熔电气	13,440	1,507,833.60	0.17

5	688200	华峰测控	7,823	1,487,934.60	0.16
6	688372	伟测科技	13,435	1,465,624.15	0.16
7	688677	海泰新光	32,774	1,414,525.84	0.16
8	688795	摩尔线程	3,052	1,269,693.04	0.14
9	601963	重庆银行	114,300	1,237,869.00	0.14
10	600150	中国船舶	34,900	1,160,774.00	0.13
11	300438	鹏辉能源	19,300	1,027,146.00	0.11
12	000422	湖北宣化	69,600	989,016.00	0.11
13	688267	中触媒	34,669	976,625.73	0.11
14	688700	东威科技	27,628	974,715.84	0.11
15	000543	皖能电力	121,200	963,540.00	0.11
16	301606	绿联科技	16,400	963,336.00	0.11
17	605098	行动教育	22,700	947,952.00	0.10
18	000600	建投能源	108,900	928,917.00	0.10
19	688536	思瑞浦	5,675	907,319.00	0.10
20	688063	派能科技	15,680	890,937.60	0.10
21	301095	广立微	12,400	889,204.00	0.10
22	300593	新雷能	29,700	883,872.00	0.10
23	688153	唯捷创芯	23,468	883,335.52	0.10
24	688390	固德威	14,154	879,388.02	0.10
25	688802	沐曦股份	2,197	877,481.80	0.10
26	300363	博腾股份	37,217	864,923.08	0.10
27	688062	迈威生物	22,384	861,112.48	0.09
28	603061	金海通	6,100	856,440.00	0.09
29	300693	盛弘股份	20,900	800,052.00	0.09
30	300389	艾比森	47,800	775,794.00	0.09
31	301162	国能日新	15,000	768,900.00	0.08
32	601059	信达证券	42,500	752,675.00	0.08
33	601628	中国人寿	16,400	746,200.00	0.08
34	688356	键凯科技	9,004	740,128.80	0.08
35	300850	新强联	17,200	711,564.00	0.08
36	688049	炬芯科技	13,223	695,529.80	0.08
37	688783	西安奕材	36,359	668,642.01	0.07
38	300138	晨光生物	53,100	658,971.00	0.07
39	000576	甘化科工	62,100	653,913.00	0.07
40	002049	紫光国微	8,100	638,361.00	0.07
41	688084	晶品特装	7,182	594,669.60	0.07
42	301529	福赛科技	5,100	576,810.00	0.06
43	002284	亚太股份	37,200	555,396.00	0.06
44	600657	信达地产	160,800	554,760.00	0.06
45	000988	华工科技	6,900	547,377.00	0.06
46	301283	聚胶股份	11,400	544,692.00	0.06
47	300662	科锐国际	21,400	542,062.00	0.06
48	688025	杰普特	3,817	540,372.69	0.06

49	688636	智明达	12,603	539,912.52	0.06
50	688612	威迈斯	14,938	492,505.86	0.05
51	688270	臻镭科技	4,022	490,965.54	0.05
52	688095	福昕软件	5,430	484,736.10	0.05
53	300681	英搏尔	18,900	473,634.00	0.05
54	688410	山外山	29,683	444,354.51	0.05
55	603187	海容冷链	28,300	444,027.00	0.05
56	301219	腾远钴业	6,500	443,820.00	0.05
57	002039	黔源电力	24,300	441,531.00	0.05
58	603566	普莱柯	35,200	437,536.00	0.05
59	301349	信德新材	9,300	436,263.00	0.05
60	301528	多浦乐	6,300	428,400.00	0.05
61	688610	埃科光电	6,864	424,263.84	0.05
62	301191	菲菱科思	3,900	419,328.00	0.05
63	300872	天阳科技	20,300	417,368.00	0.05
64	600210	紫江企业	52,700	387,345.00	0.04
65	301110	青木科技	5,700	377,226.00	0.04
66	688498	源杰科技	583	374,280.17	0.04
67	688185	康希诺	5,892	370,312.20	0.04
68	601336	新华保险	5,100	355,470.00	0.04
69	688333	铂力特	3,138	349,918.38	0.04
70	300219	鸿利智汇	45,100	325,171.00	0.04
71	688759	必贝特	12,552	315,431.76	0.03
72	300750	宁德时代	800	293,808.00	0.03
73	605020	永和股份	10,800	290,412.00	0.03
74	688668	鼎通科技	2,292	284,208.00	0.03
75	300802	矩子科技	14,800	283,272.00	0.03
76	002838	道恩股份	11,700	281,736.00	0.03
77	688790	昂瑞微	2,319	271,485.33	0.03
78	600361	创新新材	62,300	264,152.00	0.03
79	603619	中曼石油	11,000	253,550.00	0.03
80	300620	光库科技	1,700	249,985.00	0.03
81	603365	水星家纺	11,200	235,648.00	0.03
82	300418	昆仑万维	5,600	233,520.00	0.03
83	600676	交运股份	39,600	232,848.00	0.03
84	002803	吉宏股份	14,100	230,676.00	0.03
85	002324	普利特	14,400	230,256.00	0.03
86	300221	银禧科技	22,100	228,072.00	0.03
87	605155	西大门	13,200	227,040.00	0.02
88	301345	涛涛车业	900	226,188.00	0.02
89	601899	紫金矿业	6,400	220,608.00	0.02
90	605016	百龙创园	10,100	218,160.00	0.02
91	002170	芭田股份	17,800	216,804.00	0.02
92	600558	大西洋	34,600	211,060.00	0.02

93	002282	博深股份	28,100	206,535.00	0.02
94	002027	分众传媒	27,700	204,149.00	0.02
95	600507	方大特钢	34,400	202,616.00	0.02
96	300596	利安隆	4,800	202,608.00	0.02
97	301090	华润材料	28,700	202,048.00	0.02
98	002452	长高电新	24,500	201,635.00	0.02
99	300953	震裕科技	1,200	201,624.00	0.02
100	300415	伊之密	7,700	200,662.00	0.02
101	300257	开山股份	14,200	199,510.00	0.02
102	300505	川金诺	8,900	199,271.00	0.02
103	002091	江苏国泰	21,900	197,757.00	0.02
104	600315	上海家化	8,700	195,924.00	0.02
105	002004	华邦健康	40,900	195,502.00	0.02
106	003017	大洋生物	6,500	194,090.00	0.02
107	000338	潍柴动力	11,200	192,640.00	0.02
108	300357	我武生物	6,700	189,945.00	0.02
109	600278	东方创业	24,800	188,480.00	0.02
110	600011	华能国际	25,100	187,246.00	0.02
111	002731	萃华珠宝	14,900	187,144.00	0.02
112	300697	电工合金	11,100	186,258.00	0.02
113	600867	通化东宝	22,400	183,008.00	0.02
114	600235	民丰特纸	26,500	180,200.00	0.02
115	600262	北方股份	6,900	179,607.00	0.02
116	605066	天正电气	24,100	175,930.00	0.02
117	605305	中际联合	4,200	174,972.00	0.02
118	300251	光线传媒	10,600	173,628.00	0.02
119	300057	万顺新材	30,500	173,545.00	0.02
120	300074	华平股份	37,500	172,875.00	0.02
121	600386	北巴传媒	39,100	171,649.00	0.02
122	600303	曙光股份	52,300	170,498.00	0.02
123	600488	津药药业	41,100	168,099.00	0.02
124	688249	晶合集成	4,906	162,830.14	0.02
125	601599	浙文影业	39,700	158,006.00	0.02
126	000931	中关村	32,300	157,301.00	0.02
127	688720	艾森股份	2,212	155,680.56	0.02
128	301261	恒工精密	1,500	153,870.00	0.02
129	000601	韶能股份	32,700	153,690.00	0.02
130	603700	宁水集团	11,200	152,208.00	0.02
131	300595	欧普康视	10,300	151,307.00	0.02
132	600326	西藏天路	13,700	151,111.00	0.02
133	002357	富临运业	14,000	150,080.00	0.02
134	605208	永茂泰	11,000	149,380.00	0.02
135	300858	科拓生物	8,900	149,253.00	0.02
136	605577	龙版传媒	11,300	147,691.00	0.02

137	002441	众业达	15,700	147,580.00	0.02
138	002609	捷顺科技	15,800	146,782.00	0.02
139	605567	春雪食品	13,300	146,300.00	0.02
140	601111	中国国航	15,600	146,172.00	0.02
141	600082	海泰发展	36,000	146,160.00	0.02
142	300127	银河磁体	4,800	145,584.00	0.02
143	603035	常熟汽饰	9,400	145,418.00	0.02
144	603018	华设集团	19,000	144,590.00	0.02
145	002016	世荣兆业	25,000	144,500.00	0.02
146	603611	诺力股份	5,900	144,255.00	0.02
147	002722	物产金轮	9,600	144,096.00	0.02
148	603309	维力医疗	10,600	144,054.00	0.02
149	002758	浙农股份	14,300	144,001.00	0.02
150	301160	翔楼新材	2,000	143,780.00	0.02
151	002486	嘉麟杰	46,200	143,682.00	0.02
151	300320	海达股份	15,400	143,682.00	0.02
153	603333	尚纬股份	17,200	143,620.00	0.02
154	600030	中信证券	5,000	143,550.00	0.02
155	300381	溢多利	22,000	143,440.00	0.02
156	301316	慧博云通	3,200	142,976.00	0.02
157	002963	豪尔赛	9,600	142,848.00	0.02
158	300040	九洲集团	23,700	142,674.00	0.02
159	600780	通宝能源	25,100	142,568.00	0.02
160	001258	立新能源	20,000	142,200.00	0.02
161	603950	长源东谷	4,900	141,855.00	0.02
162	603223	恒通股份	15,200	141,360.00	0.02
163	301051	信濠光电	7,200	141,120.00	0.02
164	603050	科林电气	7,800	140,556.00	0.02
165	600895	张江高科	3,200	140,480.00	0.02
166	603190	亚通精工	5,200	140,244.00	0.02
167	600388	龙净环保	8,500	138,635.00	0.02
168	301190	善水科技	6,500	137,865.00	0.02
169	301313	凡拓数创	5,200	137,852.00	0.02
170	600531	豫光金铅	11,700	137,475.00	0.02
171	688199	久日新材	5,827	137,342.39	0.02
172	301509	金凯生科	4,000	135,120.00	0.01
173	600795	国电电力	26,400	133,056.00	0.01
174	300296	利亚德	21,000	132,720.00	0.01
175	300489	光智科技	2,600	132,080.00	0.01
176	301103	何氏眼科	6,700	131,454.00	0.01
177	300521	爱司凯	4,600	131,100.00	0.01
178	600100	同方股份	14,600	130,232.00	0.01
179	600500	中化国际	33,200	130,144.00	0.01
180	688216	气派科技	5,839	130,092.92	0.01

181	301656	联合动力	5,093	129,667.78	0.01
182	603955	大千生态	4,400	127,644.00	0.01
183	000159	国际实业	22,000	127,160.00	0.01
184	301608	博实结	1,400	126,756.00	0.01
185	603162	海通发展	10,500	126,420.00	0.01
186	600313	农发种业	19,500	125,580.00	0.01
187	300696	爱乐达	3,900	124,449.00	0.01
188	002028	思源电气	800	123,672.00	0.01
189	002869	金溢科技	5,300	123,278.00	0.01
190	688259	创耀科技	2,936	122,724.80	0.01
191	300132	青松股份	14,000	121,940.00	0.01
192	688799	华纳药厂	2,535	120,919.50	0.01
193	688321	微芯生物	4,138	120,912.36	0.01
194	300652	雷迪克	2,200	120,692.00	0.01
195	688508	芯朋微	1,981	120,642.90	0.01
196	688158	优刻得	4,272	120,000.48	0.01
197	688550	瑞联新材	2,647	119,935.57	0.01
198	002387	维信诺	13,900	119,818.00	0.01
199	601857	中国石油	11,500	119,715.00	0.01
200	300420	五洋自控	30,000	119,700.00	0.01
201	603717	天域生物	15,200	119,168.00	0.01
202	000637	茂化实华	27,600	118,680.00	0.01
203	002712	思美传媒	21,300	118,428.00	0.01
204	301098	金埔园林	13,800	118,404.00	0.01
205	688768	容知日新	2,725	118,374.00	0.01
206	002006	精工科技	5,100	118,116.00	0.01
207	600933	爱柯迪	5,800	116,580.00	0.01
208	600986	浙文互联	14,900	116,518.00	0.01
209	603903	中持股份	8,000	116,400.00	0.01
210	601318	中国平安	1,700	116,280.00	0.01
211	688559	海目星	2,414	116,016.84	0.01
212	002117	东港股份	8,400	116,004.00	0.01
213	688639	华恒生物	3,551	115,691.58	0.01
214	300047	天源迪科	9,200	115,460.00	0.01
215	002246	北化股份	6,400	115,328.00	0.01
216	600686	金龙汽车	6,500	115,310.00	0.01
217	002467	二六三	18,900	115,101.00	0.01
218	002023	海特高新	8,500	115,090.00	0.01
219	603901	永创智能	8,100	115,020.00	0.01
220	002582	好想你	10,400	114,920.00	0.01
221	002878	元隆雅图	6,300	114,786.00	0.01
222	688103	国力电子	1,891	114,575.69	0.01
223	002612	朗姿股份	5,600	114,464.00	0.01
224	600919	江苏银行	11,000	114,400.00	0.01

225	603170	宝立食品	8,000	114,240.00	0.01
226	603993	洛阳钼业	5,700	114,000.00	0.01
227	601360	三六零	10,200	113,934.00	0.01
228	301631	壹连科技	1,100	113,905.00	0.01
229	300780	德恩精工	5,900	113,752.00	0.01
230	300531	优博讯	6,300	113,652.00	0.01
231	300587	天铁科技	18,500	113,405.00	0.01
232	601890	亚星锚链	11,000	113,190.00	0.01
233	601872	招商轮船	12,600	113,148.00	0.01
234	000708	中信特钢	6,900	112,953.00	0.01
235	002645	华宏科技	7,700	112,728.00	0.01
236	603038	华立股份	7,000	112,700.00	0.01
237	002705	新宝股份	7,900	112,654.00	0.01
238	603218	日月股份	8,500	112,625.00	0.01
239	603335	迪生力	20,000	112,600.00	0.01
240	300921	南凌科技	4,900	112,553.00	0.01
241	300206	理邦仪器	8,800	112,552.00	0.01
242	600039	四川路桥	11,300	112,435.00	0.01
243	000612	焦作万方	10,200	112,404.00	0.01
244	603998	方盛制药	10,000	112,400.00	0.01
245	301027	华蓝集团	6,100	112,301.00	0.01
246	300098	高新兴	18,400	112,240.00	0.01
247	002258	利尔化学	8,600	112,230.00	0.01
248	002826	易明医药	6,100	112,118.00	0.01
249	300092	科新机电	7,100	112,109.00	0.01
250	002787	华源控股	9,000	112,050.00	0.01
251	300861	美畅股份	7,500	111,975.00	0.01
252	301101	明月镜片	2,700	111,861.00	0.01
253	002334	英威腾	12,400	111,848.00	0.01
254	603867	新化股份	4,400	111,760.00	0.01
255	601975	招商南油	37,000	111,740.00	0.01
256	300358	楚天科技	11,400	111,606.00	0.01
257	002010	传化智联	19,200	111,552.00	0.01
258	002137	实益达	13,000	111,540.00	0.01
259	002912	中新赛克	3,700	111,518.00	0.01
260	300746	汉嘉设计	8,800	111,496.00	0.01
261	300956	英力股份	6,700	111,488.00	0.01
262	605118	力鼎光电	3,700	111,407.00	0.01
263	000581	威孚高科	5,400	111,348.00	0.01
264	300224	正海磁材	7,200	111,312.00	0.01
265	601900	南方传媒	8,300	111,303.00	0.01
266	688690	纳微科技	4,309	111,215.29	0.01
267	300249	依米康	7,600	111,188.00	0.01
268	002845	同兴达	7,900	111,153.00	0.01

269	300452	山河药辅	8,300	111,054.00	0.01
270	300328	宜安科技	6,500	110,955.00	0.01
271	300407	凯发电气	9,800	110,936.00	0.01
272	603677	奇精机械	6,100	110,898.00	0.01
273	300191	潜能恒信	6,000	110,880.00	0.01
273	300442	润泽科技	2,100	110,880.00	0.01
275	002073	软控股份	13,600	110,840.00	0.01
276	601218	吉鑫科技	21,900	110,814.00	0.01
277	003015	日久光电	7,100	110,760.00	0.01
278	600155	华创云信	16,700	110,554.00	0.01
279	300382	斯莱克	7,100	110,476.00	0.01
280	603100	川仪股份	4,800	110,400.00	0.01
281	002626	金达威	5,600	110,376.00	0.01
282	301518	长华化学	3,100	110,267.00	0.01
283	600094	大名城	26,500	110,240.00	0.01
283	600478	科力远	16,000	110,240.00	0.01
285	002736	国信证券	8,400	110,208.00	0.01
286	603489	八方股份	3,600	110,088.00	0.01
287	603181	皇马科技	7,700	110,033.00	0.01
288	600803	新奥股份	5,300	110,028.00	0.01
289	600114	东睦股份	3,600	109,980.00	0.01
290	600833	第一医药	8,500	109,905.00	0.01
291	300171	东富龙	7,000	109,900.00	0.01
292	600613	神奇制药	18,100	109,867.00	0.01
293	300862	蓝盾光电	4,800	109,824.00	0.01
294	000885	城发环境	8,000	109,760.00	0.01
295	600104	上汽集团	7,200	109,584.00	0.01
296	300775	三角防务	3,600	109,440.00	0.01
297	002772	众兴菌业	7,500	109,425.00	0.01
298	002054	德美化工	14,800	109,224.00	0.01
299	002440	闰土股份	14,600	109,062.00	0.01
300	003030	祖名股份	5,400	109,026.00	0.01
301	002345	潮宏基	8,700	108,750.00	0.01
301	603316	诚邦股份	7,500	108,750.00	0.01
303	301029	怡合达	4,100	108,732.00	0.01
304	300867	圣元环保	5,700	108,642.00	0.01
305	002358	森源电气	20,000	108,400.00	0.01
306	603505	金石资源	5,800	108,344.00	0.01
307	002741	光华科技	5,400	108,324.00	0.01
308	002846	英联股份	6,700	108,138.00	0.01
309	603612	索通发展	4,600	108,100.00	0.01
310	300572	安车检测	3,800	108,034.00	0.01
311	300341	麦克奥迪	6,600	107,844.00	0.01
312	300790	宇瞳光学	3,600	107,676.00	0.01

313	002415	海康威视	3,600	107,424.00	0.01
314	301082	久盛电气	6,000	107,400.00	0.01
315	300019	硅宝科技	5,200	107,380.00	0.01
316	300890	翔丰华	3,600	107,280.00	0.01
317	688343	云天励飞	1,410	107,272.80	0.01
318	605056	咸亨国际	6,500	107,250.00	0.01
319	300302	同有科技	5,900	107,026.00	0.01
320	603350	安乃达	2,800	106,652.00	0.01
321	603191	望变电气	7,200	106,632.00	0.01
322	603629	利通电子	4,000	106,600.00	0.01
323	301089	拓新药业	3,800	106,400.00	0.01
324	603358	华达科技	2,100	106,050.00	0.01
325	002823	凯中精密	6,600	105,996.00	0.01
326	688262	国芯科技	3,487	105,830.45	0.01
327	002293	罗莱生活	10,300	105,781.00	0.01
328	002074	国轩高科	2,700	105,597.00	0.01
329	603639	海利尔	8,300	105,410.00	0.01
330	002593	日上集团	17,800	105,198.00	0.01
331	002993	奥海科技	2,400	104,904.00	0.01
332	300327	中颖电子	3,700	103,711.00	0.01
333	603267	鸿远电子	1,900	103,417.00	0.01
334	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.01
335	300315	掌趣科技	20,700	102,258.00	0.01
336	600552	凯盛科技	8,100	100,440.00	0.01
337	300964	本川智能	1,800	100,080.00	0.01
338	300796	贝斯美	11,500	99,935.00	0.01
339	603259	药明康德	1,100	99,704.00	0.01
340	300898	熊猫乳品	3,700	99,641.00	0.01
341	601211	国泰海通	4,700	96,585.00	0.01
342	600057	厦门象屿	11,300	96,276.00	0.01
343	603185	弘元绿能	3,150	96,075.00	0.01
344	002523	天桥起重	22,300	95,667.00	0.01
345	601919	中远海控	6,200	94,116.00	0.01
346	688779	五矿新能	12,562	94,089.38	0.01
347	688609	九联科技	9,030	92,196.30	0.01
348	000425	徐工机械	7,900	91,482.00	0.01
349	002048	宁波华翔	2,900	91,234.00	0.01
350	300933	中辰股份	11,000	91,190.00	0.01
351	688223	晶科能源	16,108	90,849.12	0.01
352	688191	智洋创新	2,812	90,490.16	0.01
353	002376	新北洋	11,700	90,324.00	0.01
354	601515	衢州东峰	20,900	89,870.00	0.01
355	002666	德联集团	16,300	89,813.00	0.01
356	300088	长信科技	14,800	89,688.00	0.01

357	000725	京东方 A	21,300	89,673.00	0.01
358	300232	洲明科技	12,600	89,334.00	0.01
359	000157	中联重科	10,300	88,889.00	0.01
360	600246	万通发展	7,200	88,560.00	0.01
361	301378	通达海	3,100	88,040.00	0.01
362	688352	颀中科技	6,980	88,017.80	0.01
363	300597	吉大通信	9,500	87,780.00	0.01
364	002063	远光软件	14,400	87,408.00	0.01
365	601678	滨化股份	20,600	87,344.00	0.01
366	603697	有友食品	7,100	86,975.00	0.01
367	603331	百达精工	6,100	86,925.00	0.01
368	601766	中国中车	12,700	86,614.00	0.01
369	300365	恒华科技	13,700	86,584.00	0.01
370	601881	中国银河	5,500	86,460.00	0.01
371	000100	TCL 科技	19,000	86,260.00	0.01
372	000570	苏常柴 A	15,500	86,180.00	0.01
373	300292	吴通控股	19,100	86,141.00	0.01
374	300510	金冠股份	20,800	85,904.00	0.01
375	000597	东北制药	16,400	85,608.00	0.01
376	300274	阳光电源	500	85,520.00	0.01
377	688303	大全能源	3,142	84,268.44	0.01
378	002668	TCL 智家	8,100	84,078.00	0.01
379	002518	科士达	1,700	82,484.00	0.01
380	002653	海思科	1,600	82,112.00	0.01
381	002367	康力电梯	10,000	80,600.00	0.01
382	002969	嘉美包装	6,300	79,758.00	0.01
383	600258	首旅酒店	4,500	75,375.00	0.01
384	688111	金山办公	243	74,618.01	0.01
385	002507	涪陵榨菜	5,700	73,587.00	0.01
386	603893	瑞芯微	400	71,312.00	0.01
387	688283	坤恒顺维	1,705	68,711.50	0.01
388	688468	科美诊断	9,241	67,828.94	0.01
389	601636	旗滨集团	11,400	67,602.00	0.01
390	688373	盟科药业	10,506	63,456.24	0.01
391	300443	金雷股份	2,200	61,886.00	0.01
392	688729	屹唐股份	2,454	59,583.12	0.01
393	300476	胜宏科技	197	56,653.26	0.01
394	603556	海兴电力	1,500	54,600.00	0.01
395	600859	王府井	3,500	54,355.00	0.01
396	600373	中文传媒	5,600	52,304.00	0.01
397	300502	新易盛	120	51,705.60	0.01
398	688809	强一股份	247	50,217.57	0.01
399	600325	华发股份	11,500	48,530.00	0.01
400	600629	华建集团	2,200	47,740.00	0.01

401	600925	苏能股份	10,200	46,308.00	0.01
402	600612	老凤祥	1,000	44,470.00	0.00
403	301165	锐捷网络	500	44,400.00	0.00
404	000599	青岛双星	6,700	44,354.00	0.00
405	603219	富佳股份	2,600	43,784.00	0.00
406	002148	北纬科技	4,900	43,610.00	0.00
407	601568	北元集团	11,700	43,524.00	0.00
408	301000	肇民科技	1,100	43,307.00	0.00
409	002017	东信和平	1,900	42,370.00	0.00
410	000949	新乡化纤	7,700	42,350.00	0.00
411	301038	深水规院	1,800	42,210.00	0.00
412	002097	山河智能	3,400	42,194.00	0.00
413	300184	力源信息	4,200	41,958.00	0.00
414	600529	山东药玻	2,100	41,853.00	0.00
415	000066	中国长城	2,900	41,789.00	0.00
416	002161	远望谷	5,700	41,667.00	0.00
417	300922	天秦装备	1,800	41,166.00	0.00
418	300158	振东制药	7,000	40,670.00	0.00
419	300340	科恒股份	3,300	40,656.00	0.00
420	605100	华丰股份	900	40,473.00	0.00
421	301216	万凯新材	2,400	40,464.00	0.00
422	300642	透景生命	2,200	40,458.00	0.00
423	002365	永安药业	2,700	40,284.00	0.00
424	300491	通合科技	1,600	40,208.00	0.00
425	600644	乐山电力	4,100	39,975.00	0.00
426	600579	中化装备	4,800	39,840.00	0.00
427	605277	新亚电子	1,800	39,600.00	0.00
428	688175	高凌信息	1,228	39,553.88	0.00
429	600056	中国医药	3,800	39,254.00	0.00
430	600249	两面针	6,700	38,525.00	0.00
431	301505	苏州规划	1,725	38,415.75	0.00
432	301052	果麦文化	1,000	38,190.00	0.00
433	301328	维峰电子	800	38,056.00	0.00
434	002897	意华股份	700	37,849.00	0.00
435	688545	兴福电子	994	37,324.70	0.00
436	600736	苏州高新	5,500	37,180.00	0.00
437	300970	华绿生物	1,800	36,918.00	0.00
438	600230	沧州大化	2,400	36,624.00	0.00
439	300378	鼎捷数智	800	36,208.00	0.00
440	688162	巨一科技	1,168	35,974.40	0.00
441	688045	必易微	926	35,826.94	0.00
442	600969	郴电国际	3,500	35,805.00	0.00
443	002921	联诚精密	2,100	35,742.00	0.00
444	688069	德林海	1,582	35,484.26	0.00

445	301580	爱迪特	800	35,360.00	0.00
446	002363	隆基机械	3,500	35,350.00	0.00
447	300501	海顺新材	2,300	35,236.00	0.00
448	301198	喜悦智行	2,800	35,168.00	0.00
449	603787	新日股份	2,500	35,150.00	0.00
450	603270	金帝股份	1,300	35,139.00	0.00
451	301115	联检科技	2,200	34,782.00	0.00
452	688569	铁科轨道	1,581	34,734.57	0.00
453	301006	迈拓股份	2,100	34,629.00	0.00
454	603926	铁流股份	2,000	34,140.00	0.00
455	605033	美邦股份	1,700	34,136.00	0.00
456	301167	建研设计	2,100	34,125.00	0.00
457	600128	苏豪弘业	3,100	34,069.00	0.00
458	300932	三友联众	2,840	34,051.60	0.00
459	002968	新大正	2,800	34,048.00	0.00
460	003013	地铁设计	2,400	34,008.00	0.00
461	001223	欧克科技	700	34,006.00	0.00
462	301186	超达装备	700	33,992.00	0.00
463	301220	亚香股份	900	33,975.00	0.00
464	603022	新通联	3,300	33,891.00	0.00
465	600626	申达股份	7,000	33,810.00	0.00
466	603086	先达股份	4,100	33,702.00	0.00
467	603081	大丰实业	2,400	33,672.00	0.00
468	603079	圣达生物	1,900	33,668.00	0.00
469	601999	出版传媒	4,900	33,663.00	0.00
470	603956	威派格	5,200	33,592.00	0.00
471	002042	华孚时尚	7,900	33,575.00	0.00
472	605001	威奥股份	4,400	33,572.00	0.00
473	605259	绿田机械	1,500	33,570.00	0.00
474	688089	嘉必优	1,441	33,546.48	0.00
475	301170	锡南科技	1,200	33,540.00	0.00
476	001256	炜冈科技	1,500	33,510.00	0.00
477	688163	赛伦生物	1,539	33,504.03	0.00
478	603238	诺邦股份	1,900	33,478.00	0.00
479	688334	西高院	1,729	33,473.44	0.00
480	300616	尚品宅配	2,400	33,432.00	0.00
481	002494	华斯股份	6,200	33,418.00	0.00
482	301469	恒达新材	1,100	33,407.00	0.00
483	603587	地素时尚	2,500	33,400.00	0.00
484	301287	康力源	800	33,376.00	0.00
485	002406	远东传动	4,200	33,348.00	0.00
486	002206	海利得	5,700	33,345.00	0.00
487	600853	龙建股份	7,700	33,341.00	0.00
488	600965	福成股份	5,600	33,320.00	0.00

488	603966	法兰泰克	2,800	33,320.00	0.00
490	002696	百洋股份	4,700	33,229.00	0.00
491	002556	辉隆股份	5,500	33,220.00	0.00
492	300923	研奥股份	1,300	33,189.00	0.00
493	300212	易华录	1,900	33,155.00	0.00
494	603080	新疆火炬	1,400	33,068.00	0.00
495	002576	通达动力	1,900	33,060.00	0.00
495	003011	海象新材	1,500	33,060.00	0.00
497	603999	读者传媒	4,700	33,041.00	0.00
498	300190	维尔利	7,700	33,033.00	0.00
499	300566	激智科技	1,800	33,030.00	0.00
500	001378	德冠新材	1,400	33,012.00	0.00
501	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
502	603706	东方环宇	1,700	32,980.00	0.00
503	603231	索宝蛋白	1,800	32,976.00	0.00
504	300873	海晨股份	1,500	32,955.00	0.00
505	301386	未来电器	1,400	32,900.00	0.00
506	002116	中国海诚	3,200	32,896.00	0.00
507	301239	普瑞眼科	1,000	32,890.00	0.00
508	300788	中信出版	1,200	32,880.00	0.00
509	603029	天鹄股份	1,800	32,832.00	0.00
510	002637	赞宇科技	3,200	32,800.00	0.00
511	002999	天禾股份	4,800	32,784.00	0.00
512	002616	长青集团	6,000	32,760.00	0.00
512	002887	绿茵生态	3,500	32,760.00	0.00
512	301210	金杨精密	900	32,760.00	0.00
512	603948	建业股份	1,200	32,760.00	0.00
516	002918	蒙娜丽莎	2,300	32,729.00	0.00
517	001338	永顺泰	2,700	32,697.00	0.00
518	002817	黄山胶囊	4,300	32,680.00	0.00
518	603987	康德莱	3,800	32,680.00	0.00
520	300430	诚益通	1,700	32,674.00	0.00
521	300977	深圳瑞捷	1,900	32,661.00	0.00
522	301199	迈赫股份	1,400	32,648.00	0.00
523	301203	国泰环保	1,000	32,640.00	0.00
523	603897	长城科技	1,200	32,640.00	0.00
525	603107	上海汽配	2,200	32,626.00	0.00
526	300694	蠡湖股份	2,700	32,616.00	0.00
527	002111	威海广泰	3,100	32,612.00	0.00
528	603558	健盛集团	2,900	32,567.00	0.00
529	600479	千金药业	3,200	32,512.00	0.00
530	301258	富士莱	1,000	32,500.00	0.00
531	300826	测绘股份	1,900	32,490.00	0.00
532	002296	辉煌科技	2,900	32,480.00	0.00

533	002283	天润工业	5,200	32,448.00	0.00
533	002521	齐峰新材	3,900	32,448.00	0.00
535	603151	邦基科技	1,800	32,436.00	0.00
536	601518	吉林高速	11,500	32,430.00	0.00
537	300240	飞力达	4,300	32,422.00	0.00
537	600051	宁波联合	4,300	32,422.00	0.00
539	603937	丽岛新材	2,700	32,373.00	0.00
540	600308	华泰股份	8,300	32,370.00	0.00
541	300715	凯伦股份	3,100	32,364.00	0.00
541	301267	华夏眼科	1,800	32,364.00	0.00
543	605050	福然德	2,400	32,328.00	0.00
544	003008	开普检测	1,500	32,325.00	0.00
545	603153	上海建科	1,900	32,300.00	0.00
546	002687	乔治白	6,700	32,294.00	0.00
547	002863	今飞凯达	5,500	32,285.00	0.00
548	002012	凯恩股份	5,000	32,250.00	0.00
549	601368	绿城水务	6,500	32,240.00	0.00
550	002454	松芝股份	3,700	32,227.00	0.00
551	300193	佳士科技	3,600	32,220.00	0.00
552	002375	亚厦股份	8,500	32,215.00	0.00
553	600512	腾达建设	13,300	32,186.00	0.00
554	002286	保龄宝	3,600	32,184.00	0.00
555	600569	安阳钢铁	14,300	32,175.00	0.00
556	002573	清新环境	8,600	32,164.00	0.00
556	603916	苏博特	3,400	32,164.00	0.00
558	300664	鹏鹞环保	6,000	32,160.00	0.00
558	603318	水发燃气	4,800	32,160.00	0.00
560	300851	交大思诺	1,200	32,148.00	0.00
560	301163	宏德股份	1,200	32,148.00	0.00
562	000757	浩物股份	6,600	32,142.00	0.00
563	603569	长久物流	4,200	32,130.00	0.00
564	605151	西上海	1,700	32,113.00	0.00
565	301373	凌玮科技	1,000	32,100.00	0.00
566	300214	日科化学	4,800	32,064.00	0.00
567	688329	艾隆科技	1,506	32,062.74	0.00
568	603167	渤海轮渡	3,400	32,062.00	0.00
569	300577	开润股份	1,500	32,055.00	0.00
570	002566	益盛药业	4,200	32,046.00	0.00
571	603172	万丰股份	1,800	32,040.00	0.00
572	300196	长海股份	2,200	32,032.00	0.00
573	002033	丽江股份	3,500	32,025.00	0.00
573	300838	浙江力诺	2,100	32,025.00	0.00
573	301065	本立科技	1,500	32,025.00	0.00
576	603661	恒林股份	1,000	32,010.00	0.00

577	301100	风光股份	1,500	31,965.00	0.00
578	001368	通达创智	1,300	31,954.00	0.00
579	002349	精华制药	4,400	31,944.00	0.00
580	603073	彩蝶实业	1,700	31,943.00	0.00
581	603810	丰山集团	2,000	31,940.00	0.00
582	603310	巍华新材	1,900	31,939.00	0.00
583	600469	风神股份	4,600	31,924.00	0.00
584	300355	蒙草生态	7,900	31,916.00	0.00
585	001218	丽臣实业	1,400	31,892.00	0.00
586	000722	湖南发展	2,700	31,860.00	0.00
587	688285	高铁电气	3,668	31,838.24	0.00
588	603115	海星股份	1,700	31,807.00	0.00
589	603590	康辰药业	800	31,800.00	0.00
590	301356	天振股份	1,500	31,785.00	0.00
591	000507	珠海港	6,100	31,781.00	0.00
592	002344	海宁皮城	6,700	31,758.00	0.00
593	603282	亚光股份	1,600	31,744.00	0.00
594	301063	海锅股份	1,300	31,733.00	0.00
595	603048	浙江黎明	1,500	31,710.00	0.00
596	600982	宁波能源	7,300	31,682.00	0.00
597	603285	键邦股份	1,300	31,668.00	0.00
598	600668	尖峰集团	2,800	31,640.00	0.00
598	603182	嘉华股份	2,000	31,640.00	0.00
600	001277	速达股份	800	31,600.00	0.00
601	600872	中炬高新	1,800	31,590.00	0.00
602	603126	中材节能	4,700	31,584.00	0.00
603	603161	科华控股	2,300	31,579.00	0.00
604	603276	恒兴新材	1,900	31,540.00	0.00
605	603637	镇海股份	2,900	31,523.00	0.00
606	300804	广康生化	900	31,500.00	0.00
607	600805	悦达投资	5,800	31,494.00	0.00
608	001228	永泰运	1,200	31,488.00	0.00
609	603307	扬州金泉	800	31,448.00	0.00
610	002671	龙泉股份	6,000	31,440.00	0.00
610	605186	健麾信息	1,600	31,440.00	0.00
612	002303	美盈森	7,800	31,434.00	0.00
612	603020	爱普股份	3,100	31,434.00	0.00
614	000531	穗恒运 A	4,900	31,409.00	0.00
615	603289	泰瑞机器	3,100	31,372.00	0.00
616	000726	鲁泰 A	4,400	31,328.00	0.00
617	000419	通程控股	4,900	31,311.00	0.00
617	301439	泓淋电力	2,100	31,311.00	0.00
619	603900	莱绅通灵	3,700	31,302.00	0.00
620	605258	协和电子	1,000	31,270.00	0.00

621	688021	奥福科技	1,704	31,268.40	0.00
622	300823	建科智能	2,000	31,240.00	0.00
623	301223	中荣股份	1,700	31,229.00	0.00
624	603351	威尔药业	1,200	31,224.00	0.00
625	603856	东宏股份	2,500	31,175.00	0.00
626	688357	建龙微纳	943	31,166.15	0.00
627	600785	新华百货	2,300	31,165.00	0.00
628	603739	蔚蓝生物	2,200	31,130.00	0.00
629	600279	重庆港	5,700	31,122.00	0.00
630	688121	卓然股份	2,843	31,045.56	0.00
631	300375	鹏翎股份	5,900	31,034.00	0.00
632	300016	北陆药业	3,900	30,966.00	0.00
633	600738	丽尚国潮	6,000	30,960.00	0.00
634	000862	银星能源	5,300	30,952.00	0.00
635	000715	中兴商业	4,900	30,821.00	0.00
636	688358	祥生医疗	1,023	30,792.30	0.00
637	001313	粤海饲料	4,200	30,744.00	0.00
638	002889	东方嘉盛	2,000	30,720.00	0.00
639	002614	奥佳华	4,200	30,702.00	0.00
640	688015	交控科技	1,341	30,547.98	0.00
641	002695	煌上煌	2,600	30,524.00	0.00
642	605058	澳弘电子	1,000	30,520.00	0.00
643	300908	仲景食品	1,100	30,470.00	0.00
644	600180	瑞茂通	8,700	30,450.00	0.00
645	002763	汇洁股份	4,200	30,324.00	0.00
646	603836	海程邦达	2,200	30,272.00	0.00
647	002034	旺能环境	1,900	30,210.00	0.00
648	002443	金洲管道	3,700	30,192.00	0.00
649	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
650	301032	新柴股份	2,500	30,075.00	0.00
651	002959	小熊电器	700	29,561.00	0.00
652	688458	美芯晟	743	29,452.52	0.00
653	603313	梦百合	3,300	29,370.00	0.00
654	688181	八亿时空	908	29,346.56	0.00
655	003003	天元股份	2,200	29,084.00	0.00
656	301266	宇邦新材	800	29,080.00	0.00
657	300833	浩洋股份	700	28,476.00	0.00
658	688087	英科再生	921	28,385.22	0.00
659	688576	西山科技	430	27,072.80	0.00
660	600928	西安银行	6,700	24,790.00	0.00
661	601858	中国科传	1,300	23,595.00	0.00
662	603986	兆易创新	100	21,425.00	0.00
663	300803	指南针	160	20,939.20	0.00
664	688032	禾迈股份	201	20,258.79	0.00

665	601158	重庆水务	4,500	20,115.00	0.00
666	600271	航天信息	1,700	19,873.00	0.00
667	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
668	001233	海安集团	367	19,039.96	0.00
669	601456	国联民生	1,800	18,306.00	0.00
670	300950	德固特	800	18,288.00	0.00
671	300765	新诺威	500	18,035.00	0.00
672	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
673	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
674	603868	飞科电器	400	17,312.00	0.00
675	300636	同和药业	2,100	15,771.00	0.00
676	688509	正元地信	2,860	15,701.40	0.00
677	300241	瑞丰光电	2,800	15,652.00	0.00
678	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
679	600037	歌华有线	2,100	15,330.00	0.00
680	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
681	688143	长盈通	279	14,008.59	0.00
682	603799	华友钴业	200	13,652.00	0.00
683	605376	博迁新材	200	13,080.00	0.00
684	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
685	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
686	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
687	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
688	002714	牧原股份	200	10,116.00	0.00
689	301022	海泰科	300	9,927.00	0.00
690	688606	奥泰生物	150	9,583.50	0.00
691	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
692	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
693	002384	东山精密	100	8,465.00	0.00
694	601601	中国太保	200	8,382.00	0.00
695	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
696	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
697	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
698	603014	威高血净	205	8,124.15	0.00
699	600956	新天绿能	1,100	7,975.00	0.00
700	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
701	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
702	603193	润本股份	303	7,341.69	0.00
703	000977	浪潮信息	100	6,660.00	0.00
704	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
705	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
706	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
707	002906	华阳集团	200	6,116.00	0.00
708	000045	深纺织 A	500	6,110.00	0.00

709	300866	安克创新	50	5,719.50	0.00
710	603207	小方制药	185	5,294.70	0.00
711	002487	大金重工	100	5,193.00	0.00
712	002368	太极股份	200	4,898.00	0.00
713	301236	软通动力	100	4,743.00	0.00
714	001331	胜通能源	100	4,631.00	0.00
715	688429	时创能源	346	4,529.14	0.00
716	002881	美格智能	100	4,456.00	0.00
717	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
718	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
719	300777	中简科技	100	4,080.00	0.00
720	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
721	301363	美好医疗	160	3,848.00	0.00
722	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
723	300781	因赛集团	98	3,408.44	0.00
724	001203	大中矿业	100	3,065.00	0.00
725	605296	神农集团	100	2,932.00	0.00
726	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
727	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
728	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
729	002019	亿帆医药	200	2,392.00	0.00
730	605080	浙江自然	100	2,300.00	0.00
731	002557	洽洽食品	100	2,162.00	0.00
732	601137	博威合金	100	2,137.00	0.00
733	603456	九洲药业	100	1,790.00	0.00
734	600961	株冶集团	100	1,610.00	0.00
735	300981	中红医疗	120	1,507.20	0.00
736	600216	浙江医药	100	1,386.00	0.00
737	600350	山东高速	100	975.00	0.00
738	603883	老百姓	48	710.40	0.00
739	600219	南山铝业	100	538.00	0.00
740	600383	金地集团	100	306.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	002156	通富微电	13,530,368.03	2.72
2	300476	胜宏科技	12,245,125.49	2.46
3	600096	云天化	12,122,883.00	2.43

4	601128	常熟银行	12,021,496.95	2.41
5	002436	兴森科技	11,872,047.17	2.38
6	300207	欣旺达	11,813,589.71	2.37
7	300496	中科创达	11,151,729.65	2.24
8	002603	以岭药业	10,602,865.80	2.13
9	002558	巨人网络	10,500,414.00	2.11
10	300454	深信服	10,379,910.00	2.08
11	600988	赤峰黄金	10,178,457.00	2.04
12	301358	湖南裕能	10,162,899.00	2.04
13	601717	中创智领	10,065,237.00	2.02
14	002299	圣农发展	9,964,547.00	2.00
15	600499	科达制造	9,827,031.00	1.97
16	688002	睿创微纳	9,752,414.80	1.96
17	601918	新集能源	9,750,663.00	1.96
18	600166	福田汽车	9,699,522.00	1.95
19	002008	大族激光	9,688,097.48	1.95
20	002080	中材科技	9,650,456.50	1.94

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。

#### 8.4.2 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	300476	胜宏科技	24,997,870.61	5.02
2	002558	巨人网络	12,522,064.00	2.51
3	688122	西部超导	12,129,429.87	2.44
4	600096	云天化	11,647,880.20	2.34
5	000988	华工科技	11,392,290.00	2.29
6	688099	晶晨股份	10,221,282.52	2.05
7	601717	中创智领	10,160,938.00	2.04
8	600487	亨通光电	10,103,870.00	2.03
9	300207	欣旺达	10,013,206.35	2.01
10	603893	瑞芯微	9,906,157.00	1.99
11	002080	中材科技	9,888,915.56	1.99
12	600298	安琪酵母	9,871,028.00	1.98
13	600499	科达制造	9,686,834.00	1.94
14	002202	金风科技	9,647,206.55	1.94
15	601128	常熟银行	9,269,916.00	1.86
16	603606	东方电缆	9,117,812.24	1.83
17	002273	水晶光电	9,033,695.57	1.81
18	600988	赤峰黄金	8,962,176.16	1.80

19	600867	通化东宝	8,907,996.40	1.79
20	002294	信立泰	8,841,941.04	1.78

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。

#### 8.4.3 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	2,840,480,545.50
卖出股票收入（成交）总额	2,684,597,723.86

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，长江证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局湖北省分局的处罚。河南神火煤电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家矿山安全监察局河南局、永城市市场监督管理局的处罚。

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。

8.12.2 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。

### 8.12.3 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	7,176,899.72
2	应收清算款	40,825,625.43
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,157,303.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,159,828.59

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 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。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 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 500 量化增强 A	6,814	45,685.81	45,387,843.42	14.58%	265,915,238.95	85.42%
易方达中证 500 量化增强 C	14,402	30,575.77	286,250,617.32	65.00%	154,101,638.37	35.00%
合计	21,216	35,428.70	331,638,460.74	44.12%	420,016,877.32	55.88%

## 9.2 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 500 量化增强 A	1,253,722.05	0.4027%
	易方达中证 500 量化增强 C	7,282.97	0.0017%
	合计	1,261,005.02	0.1678%

## 9.3 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 500 量化增强 A	0
	易方达中证 500 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 500 量化增强 A	50~100
	易方达中证 500 量化增强 C	0
	合计	50~100

## 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
刘文贵	公募基金	0
	私募资产管理计划	0
	合计	0

注：持有本人管理的产品份额总量的数量区间为基金经理本人及其直系亲属持有份额的合计数。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 15 日）基金份额总额	777,613,734.55	311,361,864.27
本报告期期初基金份额总额	374,092,497.04	176,829,478.88
本报告期基金总申购份额	159,419,636.71	633,025,316.58
减：本报告期基金总赎回份额	222,209,051.38	369,502,539.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	311,303,082.37	440,352,255.69

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 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。

## 11.2 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。本基金管理人于 2025 年 9 月 30 日发布公告，自 2025 年 9 月 29 日起张清华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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金已连续 2 年聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 42,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《货币市场基金监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管部门对管理人上述方面部分制度机制不完善、规定执行不严格提出整改意见，管理人已及时通过完善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改，整改成果已经监管部门验收通过。
其他	/

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，本基金相关从业人员未受到调查或处罚。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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重	佣金	占当期佣金总量的比例	
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	409,946,277.43	7.43%	40,993.53	7.43%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	189,251,722.99	3.43%	18,925.36	3.43%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	998,142,194.89	18.08%	99,815.02	18.08%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	832,718,313.71	15.09%	83,272.58	15.09%	-
招商证券	2	508,378,649.43	9.21%	50,838.53	9.21%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	213,106,443.20	3.86%	21,310.88	3.86%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	2,367,671,607.33	42.90%	236,808.49	42.90%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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、国泰海通证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司，无新增交易单元。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。本年度内基

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。

### 11.7.2 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
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	290,822.65	24.18%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	171,308.76	14.24%	-	-	-	-

招商证券	517,902.58	43.06%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	222,781.03	18.52%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	关于易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金 2025 年港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	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	2025-03-22
3	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
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
7	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
8	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
9	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
10	关于旗下部分基金 2025 年 4 月 18 日至 2025 年 4 月 21 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2025-04-15
11	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
12	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	2025-05-17

13	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	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	2025-06-06
14	关于旗下部分基金 2025 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2025-06-26
15	易方达基金管理有限公司关于设立易方达财富管理基金销售（广州）有限公司的公告	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	2025-07-03
16	易方达基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	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	2025-07-10
17	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-07-21
18	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	中国证券报	2025-08-30
19	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	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	2025-09-04
20	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	2025-09-30
21	关于旗下部分基金 2025 年 10 月 29 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2025-10-24
22	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-10-28
23	易方达基金管理有限公司关于终止锦州银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2025-11-01
24	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	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	2025-11-28
25	关于旗下部分基金 2025 年 12 月 25 日至 2025 年 12 月 26 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2025-12-19
26	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	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	2025-12-19
27	关于易方达财富管理基金销售（广州）有限公司展业及易方达基金管理有限公司零售直销	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2025-12-23

	与基金投顾业务迁移安排的联合公告	金电子披露网站	
28	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	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	2025-12-25
29	关于旗下部分基金 2025 年 12 月 31 日因境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	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	2025-12-26

## § 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 500 指数量化增强型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达中证 500 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

二〇二六年三月三十一日