

# 易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

## 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。安永华明会计师事务所（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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	15
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	56

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	79
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	79
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	79
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	79
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	79
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	80
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12	投资组合报告附注	80
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>81</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
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	81
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	81
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>82</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>82</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	82
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	82
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4	基金投资策略的改变	83
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	83
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	83
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8	其他重大事件	86
<b>§ 12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>88</b>
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	88
<b>§ 13</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>89</b>
13.1	备查文件目录	89
13.2	存放地点	89
13.3	查阅方式	89

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 量化增强证券投资基金
基金简称	易方达沪深 300 量化增强
基金主代码	110030
交易代码	110030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 7 月 5 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	330,629,766.85 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用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。
投资策略	本基金主要策略为复制标的指数，投资组合将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。基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果，结合基金管理人的长期研究与实践应用，利用多因子量化模型预测股票超额回报，在有效控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。本基金可投资存托凭证。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times 95\%$ + 活期存款利率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金属股票型基金中的指数增强型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号 楼
邮政编码		510627； 510623； 519031	100033
法定代表人		吴欣荣	张金良

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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	安永华明会计师事务所（特殊普 通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永 大楼17层01-12室
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
本期已实现收益	212,302,215.24	-30,906,262.54	-123,299,611.89
本期利润	258,622,103.25	119,142,751.75	-136,748,452.56
加权平均基金份额本期利润	0.5544	0.2913	-0.3867
本期加权平均净值利润率	20.61%	12.43%	-15.54%
本期基金份额净值增长率	22.51%	14.07%	-14.40%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	570,906,274.21	673,563,461.37	440,796,338.61
期末可供分配基金份额利润	1.7267	1.1872	1.2233
期末基金资产净值	1,027,259,147.19	1,438,893,072.32	801,128,237.65
期末基金份额净值	3.1070	2.5361	2.2233
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	210.70%	153.61%	122.33%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.09%	0.86%	-0.20%	0.90%	1.29%	-0.04%
过去六个月	19.33%	0.83%	16.72%	0.86%	2.61%	-0.03%
过去一年	22.51%	0.93%	16.79%	0.91%	5.72%	0.02%
过去三年	19.62%	1.05%	18.82%	1.02%	0.80%	0.03%
过去五年	-8.61%	1.15%	-10.22%	1.08%	1.61%	0.07%
自基金合同生效起至今	210.70%	1.30%	84.87%	1.27%	125.83%	0.03%

## 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

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

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

(2012 年 7 月 5 日至 2025 年 12 月 31 日)

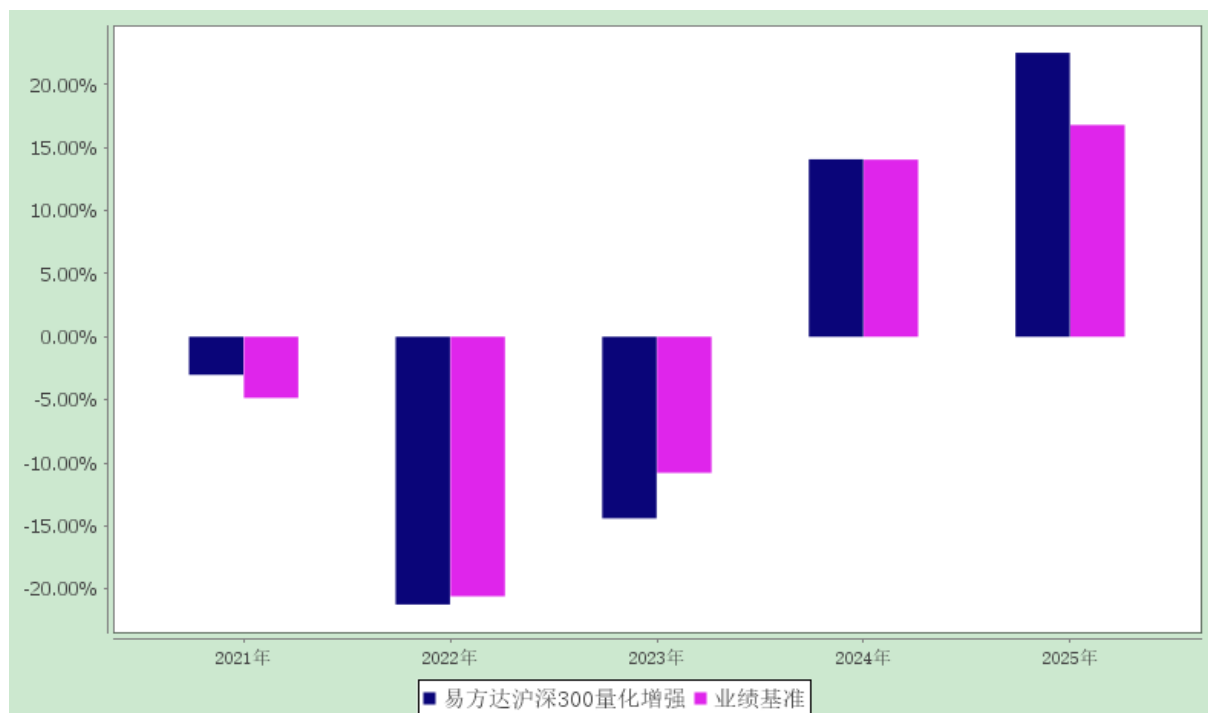


注：自 2013 年 6 月 7 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×80%+活期存款利率（税后）×20%”调整为“沪深 300 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

3.2.3 过去五年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

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



### 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 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		
王建	本基金的基金经理，易方达量化策略精选混合、易方达MSCI中国A50	2021-09-04	-	18年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任汇添富基金管理有限公司数量分

军	互联互通量化增强、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达高股息量化选股股票发起式的基金经理，量化投资部负责人、量化投资决策委员会委员、投资经理				析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、量化投资部副总经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF 联接、易方达创业板 ETF、易方达中小板指数分级、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达重组分级的基金经理。
明朗	本基金的基金经理，易方达高股息量化选股股票发起式的基金经理	2023-11-09	-	10 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任交通银行股份有限公司高级投资经理，易方达基金管理有限公司投资经理、投资经理助理、量化研究员。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

#### 4.1.3 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
王建军	公募基金	5	1,371,907,808.62	2021-09-04
	私募资产管理计划	1	18,810,923,883.69	2019-07-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	6	20,182,831,692.31	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

#### 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合规守信情况的说明

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

回顾本报告期，国内经济在复杂的外部环境中展现出较强韧性，在更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策的协同推动下，宏观经济顺利实现了预期增长目标，GDP 同比增速达到 5.0%。结构上看，供给强于需求，外需强于内需，代表新经济的科技制造强于代表旧经济的地产链，整体结构在逐渐优化。

股票市场整体呈现活跃态势，主要宽基指数均录得显著涨幅，其中以创业板、中证 500 为代表的成长及中小盘风格指数表现尤为突出。从行业与主题看，市场热点集中于 AI、机器人、储能、创新药等具备产业变革预期的成长方向，有色金属、通信、电子等板块涨幅领先。相比之下，部分偏防御、注重分红的传统行业，如食品饮料、煤炭、公用事业等，阶段性表现相对平淡。市场整体风格明显偏向成长与小盘。

报告期内，作为量化指数增强型基金，本基金严格遵照量化指数增强的投资模式进行操作，一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面坚持基本面量化投资的投资理念，灵活运用投资工具，配置基本面好且性价比占优的标的，积极调整投资组合，力求在跟踪指数的基础上实现超越业绩比较基准的投资回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 3.1070 元，本报告期份额净值增长率为 22.51%，同期业绩比较基准收益率为 16.79%。年化跟踪误差 1.88%，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

展望下一阶段，A 股市场有望走出慢牛行情。宏观经济环境预计将保持稳增长与调结构并重的特征。作为“十五五”规划的开局之年，积极的财政政策与稳健偏适度宽松的货币环境有望形成合力，为新质生产力的培育与内需潜力的释放提供支撑，推动经济实现更高质量的发展。从行业板块来看，金融板块依然有较高的股息率和稳健的经营表现。同时，随着价格指数的逐步回暖，再通胀有望成

为一条重要的宏观线索，从上游资源品到中游化工，乃至部分必需消费领域，均可能迎来基本面边际改善。

管理人在下阶段的投资运作中，将坚持使用基本面量化模型优选质地优良、成长性好、估值性价比占优的公司进行配置，重点把握市场的结构性机会。

#### 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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了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,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

安永华明(2026)审字第 70013033\_G208 号

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金全体基金份额持有人:

### 6.1 审计意见

我们审计了易方达沪深 300 量化增强证券投资基金的财务报表,包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,2025 年度的利润表和净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为,后附的易方达沪深 300 量化增强证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了易方达沪深 300 量化增强证券投资基金 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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则,我们独立于易方达沪深 300 量化增强证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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 其他信息

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估易方达沪深 300 量化增强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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达沪深 300 量化增强证券投资基金的财务报告过程。

### 6.5 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沪深 300 量化增强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沪深 300 量化增强证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵雅 林亚小

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2026 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

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	91,828,384.59	82,915,173.12
结算备付金		3,437,570.44	5,428,325.72
存出保证金		202,960.83	264,280.55
交易性金融资产	7.4.7.2	937,662,733.38	1,345,307,336.16
其中：股票投资		937,661,733.36	1,345,307,336.16

基金投资		-	-
债券投资		1,000.02	-
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		-	7,255,191.22
应收股利		-	-
应收申购款		2,656,082.82	5,368,618.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,035,787,732.06</b>	<b>1,446,538,924.84</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<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		5,294,789.71	-
应付赎回款		2,110,878.27	5,992,697.84
应付管理人报酬		661,834.35	989,266.73
应付托管费		124,093.95	185,487.51
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.6	336,988.59	478,400.24
<b>负债合计</b>		<b>8,528,584.87</b>	<b>7,645,852.52</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	330,629,766.85	567,359,008.38
未分配利润	7.4.7.8	696,629,380.34	871,534,063.94
<b>净资产合计</b>		<b>1,027,259,147.19</b>	<b>1,438,893,072.32</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>1,035,787,732.06</b>	<b>1,446,538,924.84</b>

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.1070 元，基金份额总额 330,629,766.85 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

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>270,821,579.68</b>	<b>128,584,528.51</b>
1.利息收入		289,275.30	256,021.13
其中：存款利息收入	7.4.7.9	289,275.30	256,021.13
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）		223,014,098.94	-22,101,046.02
其中：股票投资收益	7.4.7.10	193,473,413.46	-44,965,644.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	165,276.87	27,421.07
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	66,353.83	-
股利收益	7.4.7.14	29,309,054.78	22,837,177.56

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	46,319,888.01	150,049,014.29
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	1,198,317.43	380,539.11
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>12,199,476.43</b>	<b>9,441,776.76</b>
1. 管理人报酬		10,050,568.94	7,617,371.86
2. 托管费		1,884,481.67	1,428,257.25
3. 销售服务费		-	-
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		239.70	0.16
8. 其他费用	7.4.7.18	264,186.12	396,147.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>258,622,103.25</b>	<b>119,142,751.75</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>258,622,103.25</b>	<b>119,142,751.75</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>258,622,103.25</b>	<b>119,142,751.75</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

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	567,359,008.38	871,534,063.94	1,438,893,072.32
二、本期期初净资产	567,359,008.38	871,534,063.94	1,438,893,072.32

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-236,729,241.53	-174,904,683.60	-411,633,925.13
（一）、综合收益总额	-	258,622,103.25	258,622,103.25
（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）	-236,729,241.53	-433,526,786.85	-670,256,028.38
其中：1.基金申购款	177,855,188.54	332,089,767.05	509,944,955.59
2.基金赎回款	-414,584,430.07	-765,616,553.90	-1,180,200,983.97
（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	330,629,766.85	696,629,380.34	1,027,259,147.19
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	360,331,899.04	440,796,338.61	801,128,237.65
二、本期期初净资产	360,331,899.04	440,796,338.61	801,128,237.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	207,027,109.34	430,737,725.33	637,764,834.67
（一）、综合收益总额	-	119,142,751.75	119,142,751.75
（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）	207,027,109.34	311,594,973.58	518,622,082.92
其中：1.基金申购款	334,608,771.12	498,851,033.54	833,459,804.66
2.基金赎回款	-127,581,661.78	-187,256,059.96	-314,837,721.74
（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	567,359,008.38	871,534,063.94	1,438,893,072.32

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

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金（原名易方达量化衍伸股票型证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]627 号《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 248,871,987.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 6,407.02 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中国证监会 2013 年 6 月 7 日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监许可[2013]742 号），易方达量化衍伸股票型证券投资基金自 2013 年 6 月 7 日起变更为易方达沪深 300 量化增强证券投资基金，修改基金合同中基金名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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

#### 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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信

用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项

负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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）不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占净资产比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，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，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为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) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

#### (1) 印花税

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

半征收。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中

债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

根据财政部、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》，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。

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

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	91,828,384.59	82,915,173.12
等于：本金	91,822,005.91	82,907,363.98
加：应计利息	6,378.68	7,809.14
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	91,828,384.59	82,915,173.12

## 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		876,220,377.11	-	937,661,733.36	61,441,356.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,000.00	0.02	1,000.02	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,000.00	0.02	1,000.02	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		876,221,377.11	0.02	937,662,733.38	61,441,356.25
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		1,330,185,867.92	-	1,345,307,336.16	15,121,468.24
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		1,330,185,867.9	-	1,345,307,336.16	15,121,468.24
		2			

#### 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

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 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	4,245.71	20,742.24
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	247,642.88	334,654.29
其中：交易所市场	247,642.88	334,654.29
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	85,100.00	69,000.00
其他应付款	-	54,003.71
合计	336,988.59	478,400.24

## 7.4.7.7 实收基金

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	567,359,008.38	567,359,008.38
本期申购	177,855,188.54	177,855,188.54
本期赎回（以“-”号填列）	-414,584,430.07	-414,584,430.07
本期末	330,629,766.85	330,629,766.85

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

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	673,563,461.37	197,970,602.57	871,534,063.94
本期期初	673,563,461.37	197,970,602.57	871,534,063.94
本期利润	212,302,215.24	46,319,888.01	258,622,103.25
本期基金份额交易产生的变动数	-314,959,402.40	-118,567,384.45	-433,526,786.85
其中：基金申购款	258,506,383.10	73,583,383.95	332,089,767.05
基金赎回款	-573,465,785.50	-192,150,768.40	-765,616,553.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	570,906,274.21	125,723,106.13	696,629,380.34

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	267,222.73
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	21,158.71	40,557.11
其他	893.86	2,188.47
合计	289,275.30	256,021.13

#### 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 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
股票投资收益——买卖股票差价收入	193,473,413.46	-44,965,644.65
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	193,473,413.46	-44,965,644.65

##### 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 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
卖出股票成交总额	6,749,100,620.91	3,883,213,640.81
减：卖出股票成本总额	6,550,147,737.11	3,924,423,276.81
减：交易费用	5,479,470.34	3,756,008.65
买卖股票差价收入	193,473,413.46	-44,965,644.65

#### 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 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
债券投资收益——利息收入	118.43	29.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	165,158.44	27,391.23
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	165,276.87	27,421.07
----	------------	-----------

## 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	622,305.30	126,929.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	456,998.53	99,499.35
减：应计利息总额	123.45	33.34
减：交易费用	24.88	5.08
买卖债券差价收入	165,158.44	27,391.23

## 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	66,353.83	-

## 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	29,309,054.78	22,837,177.56
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	29,309,054.78	22,837,177.56

## 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	46,319,888.01	150,049,014.29
——股票投资	46,319,888.01	150,049,014.29
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	46,319,888.01	150,049,014.29

#### 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	1,198,317.43	380,539.11
合计	1,198,317.43	380,539.11

#### 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	85,100.00	69,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

指数使用费	49,236.09	204,003.71
银行汇划费	9,845.12	3,143.78
存托服务费	4.91	-
合计	264,186.12	396,147.49

#### 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
中国建设银行股份有限公司	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	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	
	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	988,086,217.68	7.70%	1,516,214,044.78	18.38%

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 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	98,812.32	7.70%	97,910.52	39.54%
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	343,123.98	26.70%	-	-

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	10,050,568.94	7,617,371.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,033,415.06	2,229,915.94
应支付基金管理人的净管理费	7,017,153.88	5,387,455.92

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

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,884,481.67	1,428,257.25

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

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 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

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	16,318,489.99	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	16,318,489.99	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.9356%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

##### 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

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
中国建设银行-活期存款	91,828,384.59	267,222.73	82,915,173.12	213,275.55

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设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	5,624	642,710.72
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

本基金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	6,711	83,753.28	170,862.06	-
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	3,505	29,617.25	85,101.40	-
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	44,370	382,469.40	815,964.30	-
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	3,937	449,920.36	1,637,870.74	-
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	2,795	292,524.70	1,116,323.00	-
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	259	22,038.31	52,657.29	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118063	金 05 转债	2025-12-26	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.02	-

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
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项停牌	78.81	2026-01-15	86.69	14,900	1,162,919.30	1,174,269.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项停牌	283.75	2026-01-05	278.00	12,601	3,342,896.80	3,575,533.75	-

## 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。

本基金属股票型基金中的指数增强型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。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	1,000.02	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,000.02	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

## 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	91,828,384.59	-	-	-	91,828,384.59
结算备付金	3,437,570.44	-	-	-	3,437,570.44
存出保证金	202,960.83	-	-	-	202,960.83
交易性金融资产	-	-	1,000.02	937,661,733.36	937,662,733.38
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,656,082.82	2,656,082.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	95,468,915.86	-	1,000.02	940,317,816.18	1,035,787,732.06
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	-	-	-	5,294,789.71	5,294,789.71
应付赎回款	-	-	-	2,110,878.27	2,110,878.27
应付管理人报酬	-	-	-	661,834.35	661,834.35
应付托管费	-	-	-	124,093.95	124,093.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	336,988.59	336,988.59
负债总计	-	-	-	8,528,584.87	8,528,584.87
					7
利率敏感度缺口	95,468,915.86	-	1,000.02	931,789,231.31	1,027,259,147.19
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	82,915,173.12	-	-	-	82,915,173.12
结算备付金	5,428,325.72	-	-	-	5,428,325.72
存出保证金	264,280.55	-	-	-	264,280.55
交易性金融资产	-	-	-	1,345,307,336.16	1,345,307,336.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,255,191.22	7,255,191.22
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,368,618.07	5,368,618.07
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	88,607,779.39	-	-	1,357,931,145.45	1,446,538,924.84
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	-	-	-	5,992,697.84	5,992,697.84
应付管理人报酬	-	-	-	989,266.73	989,266.73
应付托管费	-	-	-	185,487.51	185,487.51

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.20	0.20
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	478,400.24	478,400.24
负债总计	-	-	-	7,645,852.52	7,645,852.52
利率敏感度缺口	88,607,779.39	-	-	1,350,285,292.93	1,438,893,072.32

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	937,661,733.36	91.28	1,345,307,336.16	93.50
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	937,661,733.36	91.28	1,345,307,336.16	93.50

#### 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%	47,756,375.00	78,500,128.53
	2.业绩比较基准下降 5%	-47,756,375.00	-78,500,128.53

#### 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	928,020,350.28	1,343,488,738.60
第二层次	4,750,802.77	1,396,648.50
第三层次	4,891,580.33	421,949.06
合计	937,662,733.38	1,345,307,336.16

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

###### 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	-	2,053,754.82	2,053,754.82
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,021,507.38	1,021,507.38
当期利得或损失总额	-	3,437,383.83	3,437,383.83
其中：计入损益的利得或损失	-	3,437,383.83	3,437,383.83
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	4,891,580.33	4,891,580.33
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	-	3,011,669.51	3,011,669.51
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	-	1,054,342.11	1,054,342.11
当期购买	-	454,199.00	454,199.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,388,496.91	1,388,496.91
当期利得或损失总额	-	301,904.86	301,904.86
其中：计入损益的利得或损失	-	301,904.86	301,904.86
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	-	231,759.11	231,759.11

未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
-----------------------	--	--	--

## 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	4,891,580.33	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

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

## 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	937,661,733.36	90.53
	其中：股票	937,661,733.36	90.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,000.02	0.00
	其中：债券	1,000.02	0.00
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	95,265,955.03	9.20
8	其他各项资产	2,859,043.65	0.28
9	合计	1,035,787,732.06	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	539,644.00	0.05
B	采矿业	44,751,612.25	4.36
C	制造业	414,733,789.15	40.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,047,535.00	1.95
E	建筑业	19,238,443.00	1.87
F	批发和零售业	1,459,364.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	14,532,304.00	1.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,702,619.32	2.99
J	金融业	195,352,197.69	19.02
K	房地产业	8,309,515.00	0.81
L	租赁和商务服务业	9,716,896.00	0.95
M	科学研究和技术服务业	10,779,206.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	2,204,784.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	772,367,909.41	75.19

## 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	387,328.00	0.04
B	采矿业	5,109,967.72	0.50
C	制造业	92,158,924.64	8.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,336,259.00	0.71
E	建筑业	133,501.00	0.01
F	批发和零售业	1,621,245.44	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	6,750,448.00	0.66
H	住宿和餐饮业	26,667.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,786,204.44	1.44
J	金融业	25,409,428.40	2.47
K	房地产业	2,030,226.00	0.20
L	租赁和商务服务业	97,926.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	4,448,778.54	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	2,684,796.77	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	43,873.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,268,250.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	165,293,823.95	16.09

## 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	600519	贵州茅台	24,977	34,397,824.86	3.35
2	601318	中国平安	460,088	31,470,019.20	3.06
3	300750	宁德时代	81,687	30,000,367.62	2.92
4	300308	中际旭创	39,180	23,899,800.00	2.33
5	600036	招商银行	407,247	17,145,098.70	1.67
6	000333	美的集团	200,824	15,694,395.60	1.53
7	601899	紫金矿业	434,974	14,993,553.78	1.46
8	600030	中信证券	493,975	14,182,022.25	1.38
9	601166	兴业银行	656,100	13,817,466.00	1.35
10	300502	新易盛	32,060	13,814,012.80	1.34
11	300059	东方财富	587,233	13,612,060.94	1.33
12	002594	比亚迪	122,600	11,980,472.00	1.17
13	600276	恒瑞医药	198,359	11,816,245.63	1.15
14	688981	中芯国际	94,707	11,632,860.81	1.13
15	600900	长江电力	348,000	9,462,120.00	0.92
16	002475	立讯精密	155,335	8,809,047.85	0.86
17	002371	北方华创	18,476	8,481,962.08	0.83
18	601211	国泰海通	411,128	8,448,680.40	0.82
19	688256	寒武纪	5,970	8,092,633.50	0.79
20	601138	工业富联	127,100	7,886,555.00	0.77
21	300274	阳光电源	44,900	7,679,696.00	0.75
22	601229	上海银行	736,700	7,440,670.00	0.72
23	300476	胜宏科技	25,300	7,275,774.00	0.71
24	601600	中国铝业	587,100	7,174,362.00	0.70
25	600926	杭州银行	460,400	7,034,912.00	0.68
26	601009	南京银行	610,800	6,981,444.00	0.68
27	000858	五粮液	65,100	6,896,694.00	0.67
28	601225	陕西煤业	319,600	6,813,872.00	0.66
29	603259	药明康德	73,800	6,689,232.00	0.65
30	000792	盐湖股份	232,800	6,555,648.00	0.64
31	600019	宝钢股份	870,800	6,487,460.00	0.63
32	600887	伊利股份	226,100	6,466,460.00	0.63
33	601857	中国石油	586,400	6,104,424.00	0.59
34	600104	上汽集团	398,300	6,062,126.00	0.59
35	600989	宝丰能源	302,400	5,936,112.00	0.58
36	000651	格力电器	147,487	5,931,927.14	0.58

37	601398	工商银行	746,500	5,919,745.00	0.58
38	601328	交通银行	804,200	5,830,450.00	0.57
39	002027	分众传媒	778,000	5,733,860.00	0.56
40	002142	宁波银行	197,960	5,560,696.40	0.54
41	688041	海光信息	24,653	5,532,379.73	0.54
42	600999	招商证券	324,500	5,399,680.00	0.53
43	600115	中国东航	896,800	5,380,800.00	0.52
44	002050	三花智控	94,500	5,226,795.00	0.51
45	600674	川投能源	370,600	5,151,340.00	0.50
46	601668	中国建筑	1,001,400	5,137,182.00	0.50
47	001979	招商蛇口	587,000	5,071,680.00	0.49
48	600050	中国联通	977,000	4,992,470.00	0.49
49	600039	四川路桥	490,600	4,881,470.00	0.48
50	601838	成都银行	294,900	4,753,788.00	0.46
51	600919	江苏银行	456,882	4,751,572.80	0.46
52	600690	海尔智家	180,100	4,698,809.00	0.46
53	601628	中国人寿	103,100	4,691,050.00	0.46
54	300033	同花顺	14,500	4,671,610.00	0.45
55	600188	兖矿能源	353,000	4,641,950.00	0.45
56	601898	中煤能源	369,400	4,595,336.00	0.45
57	000425	徐工机械	394,600	4,569,468.00	0.44
58	300760	迈瑞医疗	23,400	4,456,530.00	0.43
59	000338	潍柴动力	249,500	4,291,400.00	0.42
60	601288	农业银行	545,700	4,190,976.00	0.41
61	002493	荣盛石化	352,300	4,125,433.00	0.40
62	600941	中国移动	40,200	4,062,210.00	0.40
63	002460	赣锋锂业	63,900	4,018,671.00	0.39
64	002236	大华股份	212,100	4,017,174.00	0.39
65	600029	南方航空	501,500	4,017,015.00	0.39
66	600803	新奥股份	192,300	3,992,148.00	0.39
67	601186	中国铁建	512,200	3,928,574.00	0.38
68	603986	兆易创新	17,500	3,749,375.00	0.36
69	600015	华夏银行	538,800	3,701,556.00	0.36
70	600150	中国船舶	109,273	3,634,419.98	0.35
71	002920	德赛西威	30,200	3,633,060.00	0.35
72	000725	京东方 A	862,700	3,631,967.00	0.35
73	688012	中微公司	12,601	3,575,533.75	0.35
74	301236	软通动力	73,300	3,476,619.00	0.34
75	002001	新和成	136,700	3,443,473.00	0.34
76	002384	东山精密	40,600	3,436,790.00	0.33
77	300347	泰格医药	60,200	3,413,340.00	0.33
78	000568	泸州老窖	28,900	3,358,758.00	0.33
79	601995	中金公司	95,700	3,349,500.00	0.33
80	688008	澜起科技	27,520	3,241,856.00	0.32

81	300394	天孚通信	15,800	3,207,874.00	0.31
82	605499	东鹏饮料	11,810	3,157,875.90	0.31
83	600048	保利发展	516,300	3,149,430.00	0.31
84	600183	生益科技	41,900	2,992,079.00	0.29
85	600089	特变电工	134,400	2,986,368.00	0.29
86	600585	海螺水泥	135,100	2,953,286.00	0.29
87	603019	中科曙光	33,900	2,903,196.00	0.28
88	600031	三一重工	134,600	2,844,098.00	0.28
89	300418	昆仑万维	68,200	2,843,940.00	0.28
90	601888	中国中免	29,100	2,751,696.00	0.27
91	002463	沪电股份	37,400	2,732,818.00	0.27
92	601601	中国太保	64,100	2,686,431.00	0.26
93	601688	华泰证券	104,500	2,465,155.00	0.24
94	603993	洛阳钼业	122,800	2,456,000.00	0.24
95	601456	国联民生	240,700	2,447,919.00	0.24
96	601012	隆基绿能	134,100	2,440,620.00	0.24
97	601336	新华保险	35,000	2,439,500.00	0.24
98	600809	山西汾酒	14,100	2,420,970.00	0.24
99	300014	亿纬锂能	36,200	2,380,512.00	0.23
100	603501	豪威集团	18,600	2,341,740.00	0.23
101	002028	思源电气	15,000	2,318,850.00	0.23
102	601800	中国交建	280,800	2,313,792.00	0.23
103	300124	汇川技术	30,500	2,297,565.00	0.22
104	002230	科大讯飞	45,050	2,265,564.50	0.22
105	000408	藏格矿业	26,600	2,245,040.00	0.22
106	300015	爱尔眼科	200,800	2,204,784.00	0.21
107	600938	中国海油	70,200	2,118,636.00	0.21
108	000538	云南白药	36,500	2,071,740.00	0.20
109	000708	中信特钢	123,900	2,028,243.00	0.20
110	601872	招商轮船	224,000	2,011,520.00	0.20
111	002074	国轩高科	51,100	1,998,521.00	0.19
112	601689	拓普集团	25,700	1,983,526.00	0.19
113	600000	浦发银行	157,900	1,964,276.00	0.19
114	600436	片仔癀	11,600	1,957,848.00	0.19
115	600066	宇通客车	58,400	1,909,680.00	0.19
116	000063	中兴通讯	48,520	1,835,996.80	0.18
117	603288	海天味业	48,628	1,800,208.56	0.18
118	601390	中国中铁	329,200	1,780,972.00	0.17
119	000100	TCL 科技	388,400	1,763,336.00	0.17
120	300442	润泽科技	33,300	1,758,240.00	0.17
121	600406	国电南瑞	78,100	1,755,688.00	0.17
122	600482	中国动力	83,800	1,734,660.00	0.17
123	601077	渝农商行	268,100	1,731,926.00	0.17
124	002916	深南电路	6,800	1,579,572.00	0.15

125	002415	海康威视	52,400	1,563,616.00	0.15
126	600111	北方稀土	33,200	1,531,184.00	0.15
127	688271	联影医疗	12,007	1,506,878.50	0.15
128	002241	歌尔股份	51,400	1,476,722.00	0.14
129	002252	上海莱士	232,000	1,470,880.00	0.14
130	000661	长春高新	15,700	1,453,035.00	0.14
131	605117	德业股份	16,500	1,422,300.00	0.14
132	600346	恒力石化	57,600	1,297,728.00	0.13
133	600415	小商品城	77,200	1,231,340.00	0.12
134	601607	上海医药	68,900	1,230,554.00	0.12
135	002049	紫光国微	14,900	1,174,269.00	0.11
136	300433	蓝思科技	34,300	1,038,261.00	0.10
137	601816	京沪高铁	199,300	1,026,395.00	0.10
138	600196	复星医药	38,600	1,022,514.00	0.10
139	601117	中国化学	134,600	1,013,538.00	0.10
140	600660	福耀玻璃	15,100	978,027.00	0.10
141	601728	中国电信	152,200	958,860.00	0.09
142	600309	万华化学	12,300	943,164.00	0.09
143	300316	晶盛机电	25,500	937,125.00	0.09
144	603799	华友钴业	13,000	887,380.00	0.09
145	000617	中油资本	90,700	870,720.00	0.08
146	601877	正泰电器	31,200	870,168.00	0.08
147	600160	巨化股份	22,600	868,292.00	0.08
148	601088	中国神华	20,700	838,350.00	0.08
149	002600	领益智造	53,100	825,174.00	0.08
150	601066	中信建投	29,800	797,746.00	0.08
151	600918	中泰证券	121,800	791,700.00	0.08
152	300408	三环集团	17,100	782,325.00	0.08
153	600741	华域汽车	37,100	742,000.00	0.07
154	002709	天赐材料	15,700	727,381.00	0.07
155	601901	方正证券	89,000	694,200.00	0.07
156	300759	康龙化成	23,800	676,634.00	0.07
157	600547	山东黄金	16,957	656,405.47	0.06
158	600438	通威股份	31,700	650,484.00	0.06
159	600016	民生银行	167,600	641,908.00	0.06
160	002736	国信证券	48,900	641,568.00	0.06
161	600028	中国石化	103,700	640,866.00	0.06
162	601766	中国中车	92,300	629,486.00	0.06
163	601127	赛力斯	5,200	628,992.00	0.06
164	601998	中信银行	78,200	602,140.00	0.06
165	688303	大全能源	21,868	586,499.76	0.06
166	300999	金龙鱼	20,000	574,800.00	0.06
167	002625	光启技术	11,700	570,492.00	0.06
168	600011	华能国际	75,600	563,976.00	0.05

169	601319	中国人保	62,100	555,795.00	0.05
170	688506	百利天恒	1,719	555,408.90	0.05
171	600233	圆通速递	32,300	530,366.00	0.05
172	002304	洋河股份	8,500	516,290.00	0.05
173	601919	中远海控	31,800	482,724.00	0.05
174	600875	东方电气	19,200	466,176.00	0.05
175	601377	兴业证券	60,800	451,136.00	0.04
176	600362	江西铜业	8,200	450,344.00	0.04
177	000999	华润三九	15,390	437,999.40	0.04
178	002714	牧原股份	8,600	434,988.00	0.04
179	601111	中国国航	45,800	429,146.00	0.04
180	000895	双汇发展	16,000	423,520.00	0.04
181	600489	中金黄金	17,900	418,144.00	0.04
182	600176	中国巨石	24,100	412,110.00	0.04
183	000166	申万宏源	75,400	397,358.00	0.04
184	601633	长城汽车	16,500	373,395.00	0.04
185	600584	长电科技	9,900	364,122.00	0.04
186	600795	国电电力	70,500	355,320.00	0.03
187	601988	中国银行	59,500	340,935.00	0.03
188	302132	中航成飞	4,200	331,800.00	0.03
189	688169	石头科技	2,123	322,823.38	0.03
190	601881	中国银河	19,600	308,112.00	0.03
191	601100	恒立液压	2,800	307,748.00	0.03
192	688111	金山办公	976	299,700.32	0.03
193	000001	平安银行	25,900	295,519.00	0.03
194	600460	士兰微	10,400	295,464.00	0.03
195	000975	山金国际	12,100	294,393.00	0.03
196	000157	中联重科	32,300	278,749.00	0.03
197	002938	鹏鼎控股	5,500	278,190.00	0.03
198	601825	沪农商行	29,800	276,842.00	0.03
199	601658	邮储银行	45,500	247,975.00	0.02
200	600760	中航沈飞	4,200	235,830.00	0.02
201	000963	华东医药	5,800	228,810.00	0.02
202	600009	上海机场	6,900	226,044.00	0.02
203	000807	云铝股份	6,700	220,028.00	0.02
204	600372	中航机载	15,100	202,642.00	0.02
205	600893	航发动力	4,900	196,147.00	0.02
206	600010	包钢股份	81,000	192,780.00	0.02
207	601006	大秦铁路	35,200	181,632.00	0.02
208	601878	浙商证券	16,800	181,608.00	0.02
209	300832	新产业	3,100	174,375.00	0.02
210	000630	铜陵有色	27,200	163,472.00	0.02
211	603369	今世缘	4,500	156,510.00	0.02
212	601985	中国核电	17,900	154,835.00	0.02

213	300661	圣邦股份	2,180	149,635.20	0.01
214	600023	浙能电力	30,100	148,995.00	0.01
215	000301	东方盛虹	13,100	142,659.00	0.01
216	601808	中海油服	10,100	141,804.00	0.01
217	600026	中远海能	11,900	138,992.00	0.01
218	300782	卓胜微	1,700	138,516.00	0.01
219	601788	光大证券	7,800	136,890.00	0.01
220	600027	华电国际	27,500	136,400.00	0.01
221	600219	南山铝业	25,000	134,500.00	0.01
222	002311	海大集团	2,400	132,912.00	0.01
223	601360	三六零	11,300	126,221.00	0.01
224	600958	东方证券	11,500	125,350.00	0.01
225	000977	浪潮信息	1,800	119,880.00	0.01
226	601868	中国能建	47,400	111,390.00	0.01
227	601169	北京银行	20,000	109,600.00	0.01
228	300498	温氏股份	6,200	104,656.00	0.01
229	688396	华润微	1,847	97,632.42	0.01
230	688187	时代电气	1,453	74,524.37	0.01
231	688009	中国通号	13,341	72,975.27	0.01
232	601818	光大银行	20,200	70,498.00	0.01
233	000002	万科 A	15,000	69,750.00	0.01
234	601916	浙商银行	22,200	67,488.00	0.01
235	688472	阿特斯	4,384	65,365.44	0.01
236	300628	亿联网络	1,800	64,170.00	0.01
237	300122	智飞生物	3,400	64,158.00	0.01
238	000938	紫光股份	2,400	59,040.00	0.01
239	600061	国投资本	7,700	58,905.00	0.01
240	000625	长安汽车	4,800	56,928.00	0.01
241	688126	沪硅产业	2,531	54,770.84	0.01
242	002352	顺丰控股	1,400	53,648.00	0.01
243	000596	古井贡酒	400	53,040.00	0.01
244	601058	赛轮轮胎	3,100	50,158.00	0.00
245	601669	中国电建	8,900	46,280.00	0.00
246	600588	用友网络	3,400	45,084.00	0.00
247	002466	天齐锂业	800	44,304.00	0.00
248	600905	三峡能源	10,100	41,309.00	0.00
249	600085	同仁堂	1,200	38,712.00	0.00
250	000983	山西焦煤	5,900	37,878.00	0.00
251	002601	龙佰集团	1,400	27,412.00	0.00
252	600018	上港集团	5,000	27,100.00	0.00
253	601618	中国中冶	8,500	25,245.00	0.00
254	002179	中航光电	700	24,808.00	0.00
255	002648	卫星化学	1,300	22,984.00	0.00
256	600426	华鲁恒升	600	18,858.00	0.00

257	600515	海南机场	3,500	18,655.00	0.00
258	002422	科伦药业	600	17,610.00	0.00
259	688036	传音控股	255	16,870.80	0.00
260	003816	中国广核	4,300	16,168.00	0.00
261	001965	招商公路	1,600	16,128.00	0.00
262	000768	中航西飞	600	15,228.00	0.00
263	601698	中国卫通	400	14,292.00	0.00
264	600886	国投电力	1,000	13,120.00	0.00
265	603195	公牛集团	300	12,249.00	0.00
266	600025	华能水电	1,300	11,804.00	0.00
267	688223	晶科能源	1,459	8,228.76	0.00
268	002459	晶澳科技	700	8,015.00	0.00
269	601238	广汽集团	800	6,528.00	0.00
270	600845	宝信软件	300	6,213.00	0.00
271	600600	青岛啤酒	100	6,120.00	0.00
272	601021	春秋航空	100	5,950.00	0.00
273	300979	华利集团	100	5,021.00	0.00
274	300413	芒果超媒	200	4,884.00	0.00
275	600377	宁沪高速	400	4,844.00	0.00
276	000876	新希望	400	3,688.00	0.00
277	600161	天坛生物	200	3,268.00	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	占基金资产净值比例（%）
1	301387	光大同创	85,300	4,725,620.00	0.46
2	002138	顺络电子	121,000	4,299,130.00	0.42
3	300709	精研科技	87,200	4,112,352.00	0.40
4	600988	赤峰黄金	123,300	3,851,892.00	0.37
5	600507	方大特钢	622,880	3,668,763.20	0.36
6	601965	中国汽研	218,400	3,625,440.00	0.35
7	300699	光威复材	76,900	3,034,474.00	0.30
8	601156	东航物流	160,100	2,947,441.00	0.29
9	002839	张家港行	626,700	2,864,019.00	0.28
10	601128	常熟银行	394,760	2,779,110.40	0.27
11	603323	苏农银行	549,000	2,772,450.00	0.27
12	600195	中牧股份	346,600	2,727,742.00	0.27
13	002807	江阴银行	593,000	2,710,010.00	0.26
14	600863	内蒙华电	601,900	2,696,512.00	0.26
15	002258	利尔化学	200,000	2,610,000.00	0.25
16	000783	长江证券	313,300	2,553,395.00	0.25
17	002410	广联达	201,400	2,533,612.00	0.25

18	600369	西南证券	565,400	2,532,992.00	0.25
19	300454	深信服	21,600	2,487,456.00	0.24
20	688480	赛恩斯	46,237	2,380,743.13	0.23
21	002152	广电运通	167,800	2,317,318.00	0.23
22	600575	淮河能源	619,400	2,105,960.00	0.21
23	601665	齐鲁银行	363,000	2,083,620.00	0.20
24	000712	锦龙股份	171,400	2,060,228.00	0.20
25	601162	天风证券	493,500	2,052,960.00	0.20
26	603786	科博达	25,600	1,999,360.00	0.19
27	001376	百通能源	114,300	1,924,812.00	0.19
28	300170	汉得信息	100,400	1,899,568.00	0.18
29	002315	焦点科技	40,500	1,853,280.00	0.18
30	002756	永兴材料	32,700	1,773,975.00	0.17
31	688795	摩尔线程	3,937	1,637,870.74	0.16
32	601019	山东出版	189,000	1,632,960.00	0.16
33	601975	招商南油	525,100	1,585,802.00	0.15
34	002244	滨江集团	155,200	1,559,760.00	0.15
35	002824	和胜股份	72,700	1,410,380.00	0.14
36	301662	宏工科技	11,543	1,388,392.04	0.14
37	002281	光迅科技	19,600	1,371,020.00	0.13
38	002240	盛新锂能	39,600	1,363,428.00	0.13
39	688387	信科移动	105,287	1,358,202.30	0.13
40	300136	信维通信	21,700	1,345,400.00	0.13
41	000600	建投能源	152,600	1,301,678.00	0.13
42	002870	香山股份	32,600	1,281,832.00	0.12
43	688561	奇安信	35,396	1,259,389.68	0.12
44	600536	中国软件	27,172	1,258,063.60	0.12
45	688596	正帆科技	39,555	1,251,124.65	0.12
46	600850	电科数字	38,600	1,144,104.00	0.11
47	000915	华特达因	34,300	1,133,272.00	0.11
48	688802	沐曦股份	2,795	1,116,323.00	0.11
49	688120	华海清科	7,098	1,065,267.84	0.10
50	300017	网宿科技	102,800	1,053,700.00	0.10
51	002158	汉钟精机	39,100	978,673.00	0.10
52	300748	金力永磁	27,300	931,203.00	0.09
53	000603	盛达资源	29,000	897,840.00	0.09
54	002966	苏州银行	104,700	867,963.00	0.08
55	300438	鹏辉能源	15,900	846,198.00	0.08
56	601865	福莱特	52,500	822,675.00	0.08
57	688783	西安奕材	44,370	815,964.30	0.08
58	002948	青岛银行	180,100	806,848.00	0.08
59	600642	申能股份	101,700	791,226.00	0.08
60	300049	福瑞医科	10,100	711,141.00	0.07
61	605338	巴比食品	21,600	676,512.00	0.07

62	002847	盐津铺子	9,900	676,269.00	0.07
63	300953	震裕科技	4,000	672,080.00	0.07
64	605189	富春染织	42,300	662,841.00	0.06
65	002991	甘源食品	11,600	660,156.00	0.06
66	601187	厦门银行	88,900	652,526.00	0.06
67	603345	安井食品	8,200	650,096.00	0.06
68	600096	云天化	19,400	648,154.00	0.06
69	000039	中集集团	64,000	645,760.00	0.06
70	000034	神州数码	16,300	634,233.00	0.06
71	603027	千禾味业	64,200	631,086.00	0.06
72	600298	安琪酵母	14,300	625,482.00	0.06
73	603730	岱美股份	70,500	617,580.00	0.06
74	300432	富临精工	36,900	616,230.00	0.06
75	603659	璞泰来	22,300	609,682.00	0.06
76	600373	中文传媒	64,100	598,694.00	0.06
77	300212	易华录	33,900	591,555.00	0.06
78	600884	杉杉股份	43,700	590,387.00	0.06
79	001311	多利科技	18,000	577,440.00	0.06
80	002293	罗莱生活	55,900	574,093.00	0.06
81	688403	汇成股份	35,005	573,381.90	0.06
82	688210	统联精密	10,289	569,187.48	0.06
83	300791	仙乐健康	21,900	566,334.00	0.06
84	300762	上海瀚讯	13,400	558,512.00	0.05
85	300207	欣旺达	20,800	543,920.00	0.05
86	300751	迈为股份	2,600	535,574.00	0.05
87	605090	九丰能源	12,200	525,820.00	0.05
88	603179	新泉股份	7,100	524,548.00	0.05
89	301061	匠心家居	5,500	521,400.00	0.05
90	603697	有友食品	42,500	520,625.00	0.05
91	300450	先导智能	10,400	519,792.00	0.05
92	600332	白云山	19,000	489,060.00	0.05
93	605116	奥锐特	19,500	488,475.00	0.05
94	002787	华源控股	39,100	486,795.00	0.05
95	002701	奥瑞金	81,800	486,710.00	0.05
96	001215	千味央厨	12,500	481,250.00	0.05
97	688050	爱博医疗	7,357	446,275.62	0.04
98	601231	环旭电子	14,300	429,000.00	0.04
99	603063	禾望电气	12,700	419,989.00	0.04
100	300604	长川科技	4,098	415,168.38	0.04
101	688253	英诺特	13,101	395,388.18	0.04
102	300529	健帆生物	17,700	348,159.00	0.03
103	002056	横店东磁	17,800	347,100.00	0.03
104	688136	科兴制药	10,956	346,976.52	0.03
105	300482	万孚生物	17,300	341,675.00	0.03

106	301096	百诚医药	5,900	337,126.00	0.03
107	300776	帝尔激光	5,300	329,342.00	0.03
108	600598	北大荒	21,600	322,920.00	0.03
109	002738	中矿资源	4,100	322,055.00	0.03
110	603806	福斯特	23,000	321,080.00	0.03
111	688759	必贝特	12,552	315,431.76	0.03
112	300003	乐普医疗	19,600	309,876.00	0.03
113	300763	锦浪科技	4,300	307,063.00	0.03
114	300357	我武生物	10,700	303,345.00	0.03
115	000028	国药一致	11,700	287,352.00	0.03
116	002980	华盛昌	13,600	286,552.00	0.03
117	600848	上海临港	24,400	285,480.00	0.03
118	600549	厦门钨业	6,800	279,208.00	0.03
119	688717	艾罗能源	4,529	278,986.40	0.03
120	002271	东方雨虹	20,400	277,236.00	0.03
121	600839	四川长虹	30,300	275,730.00	0.03
122	002755	奥赛康	16,700	272,711.00	0.03
123	688790	昂瑞微	2,319	271,485.33	0.03
124	002841	视源股份	6,800	269,484.00	0.03
125	601108	财通证券	30,900	269,448.00	0.03
126	688692	达梦数据	1,031	269,369.37	0.03
127	688183	生益电子	2,746	262,764.74	0.03
128	300972	万辰集团	1,300	261,391.00	0.03
129	300073	当升科技	4,500	260,100.00	0.03
130	688347	华虹公司	2,346	253,063.02	0.02
131	688235	百济神州	904	242,814.40	0.02
132	002653	海思科	4,700	241,204.00	0.02
133	300146	汤臣倍健	19,900	238,999.00	0.02
134	301606	绿联科技	4,000	234,960.00	0.02
135	688220	翱捷科技	2,751	227,260.11	0.02
136	301308	江波龙	925	226,477.00	0.02
137	301358	湖南裕能	3,400	219,844.00	0.02
138	300570	太辰光	1,900	219,545.00	0.02
139	603606	东方电缆	3,600	215,100.00	0.02
140	605369	拱东医疗	11,400	212,724.00	0.02
141	601963	重庆银行	19,500	211,185.00	0.02
142	000612	焦作万方	18,800	207,176.00	0.02
143	300224	正海磁材	13,300	205,618.00	0.02
144	000933	神火股份	7,300	200,531.00	0.02
145	601311	骆驼股份	21,500	197,155.00	0.02
146	688599	天合光能	11,773	194,843.15	0.02
147	300360	炬华科技	11,200	194,768.00	0.02
148	002546	新联电子	27,300	190,827.00	0.02
149	688513	苑东生物	3,092	190,312.60	0.02

150	301200	大族数控	1,600	190,032.00	0.02
151	301439	泓淋电力	12,700	189,357.00	0.02
152	000049	德赛电池	6,900	185,472.00	0.02
153	600208	衢州发展	47,800	184,986.00	0.02
154	603381	永臻股份	9,300	184,698.00	0.02
155	600389	江山股份	7,300	184,544.00	0.02
156	688363	华熙生物	4,223	184,460.64	0.02
157	002452	长高电新	21,700	178,591.00	0.02
158	601958	金铂股份	11,300	176,054.00	0.02
159	301656	联合动力	6,711	170,862.06	0.02
160	600166	福田汽车	57,800	168,776.00	0.02
161	002414	高德红外	11,200	164,304.00	0.02
162	603368	柳药集团	9,100	162,162.00	0.02
163	600366	宁波韵升	11,100	153,069.00	0.01
164	000800	一汽解放	21,600	146,448.00	0.01
165	002945	华林证券	8,400	128,772.00	0.01
166	002129	TCL 中环	14,000	119,980.00	0.01
167	301489	思泉新材	600	119,400.00	0.01
168	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.01
169	300573	兴齐眼药	1,400	98,406.00	0.01
170	603596	伯特利	1,800	92,286.00	0.01
171	601216	君正集团	17,700	85,314.00	0.01
172	688677	海泰新光	1,972	85,111.52	0.01
173	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.01
174	688011	新光光电	1,205	76,927.20	0.01
175	688131	皓元医药	1,060	76,404.80	0.01
176	301397	溯联股份	2,100	73,143.00	0.01
177	002759	天际股份	1,400	65,002.00	0.01
178	002497	雅化集团	2,600	64,350.00	0.01
179	688758	赛分科技	3,624	64,253.52	0.01
180	002340	格林美	7,500	62,700.00	0.01
181	688236	春立医疗	2,469	56,490.72	0.01
182	688073	毕得医药	900	54,945.00	0.01
183	600601	方正科技	4,500	52,740.00	0.01
184	688809	强一股份	259	52,657.29	0.01
185	300254	仟源医药	5,000	50,600.00	0.00
186	301345	涛涛车业	200	50,264.00	0.00
187	688328	深科达	1,703	49,693.54	0.00
188	300928	华安鑫创	1,500	46,725.00	0.00
189	300609	汇纳科技	1,200	46,284.00	0.00
190	605589	圣泉集团	1,600	45,280.00	0.00
191	600391	航发科技	1,200	44,520.00	0.00
192	002080	中材科技	1,200	43,608.00	0.00
193	688720	艾森股份	609	42,861.42	0.00

194	600487	亨通光电	1,600	39,568.00	0.00
195	603700	宁水集团	2,800	38,052.00	0.00
196	601699	潞安环能	3,200	37,760.00	0.00
197	688221	前沿生物	1,947	35,143.35	0.00
198	688311	盟升电子	767	34,975.20	0.00
199	600699	均胜电子	1,100	34,496.00	0.00
200	603092	德力佳	546	33,122.36	0.00
201	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
202	301191	菲菱科思	300	32,256.00	0.00
203	600869	远东股份	3,900	31,395.00	0.00
204	688548	广钢气体	2,133	31,013.82	0.00
205	002976	瑞玛精密	1,100	30,833.00	0.00
206	300489	光智科技	600	30,480.00	0.00
207	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
208	300084	海默科技	3,000	29,970.00	0.00
209	688691	灿芯股份	286	29,166.28	0.00
210	688321	微芯生物	996	29,103.12	0.00
211	002097	山河智能	2,300	28,543.00	0.00
212	600686	金龙汽车	1,600	28,384.00	0.00
213	300549	优德精密	1,500	28,290.00	0.00
214	603300	海南华铁	3,600	28,260.00	0.00
215	688301	奕瑞科技	277	28,007.47	0.00
216	603202	天有为	305	28,002.05	0.00
217	300964	本川智能	500	27,800.00	0.00
218	002943	宇晶股份	700	27,720.00	0.00
219	300657	弘信电子	1,000	27,660.00	0.00
220	002591	恒大高新	3,400	27,608.00	0.00
221	688085	三友医疗	1,515	27,300.30	0.00
222	688035	德邦科技	558	26,923.50	0.00
223	301106	骏成科技	900	26,793.00	0.00
224	300304	云意电气	2,300	26,772.00	0.00
225	603350	安乃达	700	26,663.00	0.00
226	301165	锐捷网络	300	26,640.00	0.00
227	002582	好想你	2,400	26,520.00	0.00
228	301022	海泰科	800	26,472.00	0.00
229	301281	科源制药	900	26,370.00	0.00
230	301512	智信精密	600	26,244.00	0.00
231	001228	永泰运	1,000	26,240.00	0.00
232	603115	海星股份	1,400	26,194.00	0.00
233	688237	超卓航科	533	25,983.75	0.00
234	688678	福立旺	1,071	25,896.78	0.00
235	603305	旭升集团	1,600	25,888.00	0.00
236	600676	交运股份	4,400	25,872.00	0.00
237	605155	西大门	1,500	25,800.00	0.00

238	603076	乐惠国际	1,100	25,784.00	0.00
239	688005	容百科技	728	25,771.20	0.00
240	301065	本立科技	1,200	25,620.00	0.00
241	300328	宜安科技	1,500	25,605.00	0.00
242	301418	协昌科技	700	25,550.00	0.00
243	002921	联诚精密	1,500	25,530.00	0.00
244	001324	长青科技	1,400	25,256.00	0.00
245	603866	桃李面包	4,800	25,248.00	0.00
246	300828	锐新科技	1,500	25,245.00	0.00
247	002012	凯恩股份	3,900	25,155.00	0.00
248	001278	一彬科技	1,300	25,142.00	0.00
249	300784	利安科技	500	25,110.00	0.00
250	300616	尚品宅配	1,800	25,074.00	0.00
251	301287	康力源	600	25,032.00	0.00
252	301197	工大科雅	1,200	25,008.00	0.00
253	601007	金陵饭店	3,200	24,992.00	0.00
254	300778	新城市	1,800	24,984.00	0.00
255	300670	大烨智能	3,500	24,885.00	0.00
256	688038	中科通达	1,408	24,879.36	0.00
257	300853	申昊科技	1,200	24,864.00	0.00
258	603320	迪贝电气	1,300	24,778.00	0.00
259	002696	百洋股份	3,500	24,745.00	0.00
260	688369	致远互联	972	24,717.96	0.00
261	688553	汇宇制药	1,388	24,692.52	0.00
262	603022	新通联	2,400	24,648.00	0.00
263	301272	英华特	600	24,630.00	0.00
264	001256	炜冈科技	1,100	24,574.00	0.00
265	600833	第一医药	1,900	24,567.00	0.00
266	002723	小崧股份	2,900	24,563.00	0.00
267	301395	仁信新材	2,000	24,520.00	0.00
268	300804	广康生化	700	24,500.00	0.00
269	300599	雄塑科技	3,000	24,450.00	0.00
270	603073	彩蝶实业	1,300	24,427.00	0.00
271	301167	建研设计	1,500	24,375.00	0.00
272	002576	通达动力	1,400	24,360.00	0.00
273	300931	通用电梯	2,200	24,354.00	0.00
274	688681	科汇股份	1,384	24,330.72	0.00
275	300713	英可瑞	1,400	24,220.00	0.00
276	001260	坤泰股份	1,200	24,144.00	0.00
277	301131	聚赛龙	500	24,135.00	0.00
278	603272	联翔股份	1,200	24,132.00	0.00
279	300851	交大思诺	900	24,111.00	0.00
280	300635	中达安	1,500	24,045.00	0.00
281	688565	力源科技	2,148	24,036.12	0.00

282	301353	普莱得	900	23,940.00	0.00
283	301125	腾亚精工	1,300	23,894.00	0.00
284	000978	桂林旅游	3,300	23,892.00	0.00
285	605228	神通科技	1,600	23,888.00	0.00
286	301313	凡拓数创	900	23,859.00	0.00
287	301520	万邦医药	600	23,838.00	0.00
288	301331	恩威医药	900	23,796.00	0.00
289	300417	南华仪器	1,700	23,783.00	0.00
290	300930	屹通新材	800	23,760.00	0.00
291	603029	天鹅股份	1,300	23,712.00	0.00
292	003008	开普检测	1,100	23,705.00	0.00
293	301578	辰奕智能	700	23,646.00	0.00
294	688275	万润新能	313	23,600.20	0.00
295	688163	赛伦生物	1,084	23,598.68	0.00
296	688517	金冠电气	1,513	23,587.67	0.00
297	603307	扬州金泉	600	23,586.00	0.00
298	001378	德冠新材	1,000	23,580.00	0.00
298	603045	福达合金	1,200	23,580.00	0.00
298	605186	健麾信息	1,200	23,580.00	0.00
301	688528	秦川物联	2,185	23,532.45	0.00
302	002753	永东股份	3,300	23,529.00	0.00
303	688695	中创股份	856	23,480.08	0.00
304	688058	宝兰德	859	23,390.57	0.00
305	600455	博通股份	900	23,373.00	0.00
306	002982	湘佳股份	1,700	23,358.00	0.00
307	301390	经纬股份	700	23,345.00	0.00
308	603161	科华控股	1,700	23,341.00	0.00
309	300886	华业香料	900	23,319.00	0.00
310	002795	永和智控	3,700	23,310.00	0.00
311	688203	海正生材	1,821	23,272.38	0.00
312	603117	万林物流	4,900	23,128.00	0.00
313	300912	凯龙高科	1,400	23,100.00	0.00
314	301571	国科天成	400	23,072.00	0.00
315	000619	海螺新材	3,700	22,977.00	0.00
315	300923	研奥股份	900	22,977.00	0.00
317	002780	三夫户外	1,600	22,976.00	0.00
318	300694	蠡湖股份	1,900	22,952.00	0.00
319	301359	东南电子	1,200	22,944.00	0.00
320	688218	江苏北人	1,003	22,888.46	0.00
321	688118	普元信息	896	22,865.92	0.00
322	002661	克明食品	2,500	22,850.00	0.00
323	300717	华信新材	1,200	22,848.00	0.00
323	301203	国泰环保	700	22,848.00	0.00
325	301130	西点药业	800	22,832.00	0.00

326	301222	浙江恒威	800	22,816.00	0.00
327	300746	汉嘉设计	1,800	22,806.00	0.00
327	603089	正裕工业	1,800	22,806.00	0.00
329	301429	森泰股份	1,200	22,800.00	0.00
330	688216	气派科技	1,023	22,792.44	0.00
331	001218	丽臣实业	1,000	22,780.00	0.00
332	301290	东星医疗	900	22,743.00	0.00
333	001366	播恩集团	1,700	22,729.00	0.00
334	301378	通达海	800	22,720.00	0.00
335	301059	金三江	1,800	22,680.00	0.00
336	605151	西上海	1,200	22,668.00	0.00
337	603096	新经典	1,300	22,646.00	0.00
338	300371	汇中股份	1,800	22,626.00	0.00
339	000705	浙江震元	2,500	22,625.00	0.00
340	603617	君禾股份	3,000	22,620.00	0.00
341	688113	联测科技	572	22,611.16	0.00
342	002495	佳隆股份	8,500	22,610.00	0.00
343	301198	喜悦智行	1,800	22,608.00	0.00
344	002715	登云股份	1,300	22,568.00	0.00
345	603729	龙韵股份	1,400	22,526.00	0.00
346	301072	中捷精工	1,000	22,520.00	0.00
347	603139	康惠股份	1,100	22,517.00	0.00
348	002887	绿茵生态	2,400	22,464.00	0.00
349	300514	友讯达	1,700	22,457.00	0.00
350	300665	飞鹿股份	2,300	22,448.00	0.00
351	300069	金利华电	1,300	22,425.00	0.00
352	301309	万得凯	800	22,416.00	0.00
353	600476	湘邮科技	1,400	22,414.00	0.00
354	002802	洪汇新材	1,800	22,392.00	0.00
355	688310	迈得医疗	1,459	22,366.47	0.00
356	301170	锡南科技	800	22,360.00	0.00
357	688132	邦彦技术	1,212	22,325.04	0.00
358	002963	豪尔赛	1,500	22,320.00	0.00
359	603289	泰瑞机器	2,200	22,264.00	0.00
360	688571	杭华股份	2,987	22,253.15	0.00
361	603326	我乐家居	2,500	22,250.00	0.00
362	688096	京源环保	2,814	22,230.60	0.00
363	688573	信宇人	975	22,220.25	0.00
364	605060	联德股份	600	22,176.00	0.00
365	301298	东利机械	1,400	22,148.00	0.00
365	603182	嘉华股份	1,400	22,148.00	0.00
367	301115	联检科技	1,400	22,134.00	0.00
368	605001	威奥股份	2,900	22,127.00	0.00
369	301515	港通医疗	1,100	22,066.00	0.00

370	301320	豪江智能	1,300	22,061.00	0.00
371	300564	筑博设计	1,400	22,050.00	0.00
372	603137	恒尚节能	1,600	21,984.00	0.00
373	600128	苏豪弘业	2,000	21,980.00	0.00
374	002890	弘宇股份	1,500	21,900.00	0.00
375	300854	中兰环保	1,300	21,892.00	0.00
376	688616	西力科技	1,789	21,879.47	0.00
377	300823	建科智能	1,400	21,868.00	0.00
378	300987	川网传媒	1,300	21,840.00	0.00
379	688737	中自科技	973	21,834.12	0.00
380	301588	美新科技	1,200	21,804.00	0.00
381	001230	劲旅环境	1,000	21,790.00	0.00
382	300385	雪浪环境	3,500	21,770.00	0.00
383	600235	民丰特纸	3,200	21,760.00	0.00
384	603578	三星新材	1,800	21,744.00	0.00
385	688355	明志科技	1,221	21,733.80	0.00
386	688338	赛科希德	839	21,713.32	0.00
387	300405	科隆股份	3,400	21,692.00	0.00
388	603041	美思德	1,800	21,690.00	0.00
389	301032	新柴股份	1,800	21,654.00	0.00
390	301503	智迪科技	600	21,636.00	0.00
391	300883	龙利得	3,200	21,600.00	0.00
391	301037	保立佳	1,500	21,600.00	0.00
393	603937	丽岛新材	1,800	21,582.00	0.00
394	002144	宏达高科	1,700	21,573.00	0.00
394	603188	亚邦股份	4,700	21,573.00	0.00
396	300614	百川畅银	1,700	21,556.00	0.00
397	600689	上海三毛	1,600	21,504.00	0.00
398	001333	光华股份	1,000	21,500.00	0.00
399	301519	舜禹股份	1,600	21,472.00	0.00
400	600359	新农开发	3,000	21,450.00	0.00
401	300501	海顺新材	1,400	21,448.00	0.00
402	603318	水发燃气	3,200	21,440.00	0.00
403	301006	迈拓股份	1,300	21,437.00	0.00
404	301163	宏德股份	800	21,432.00	0.00
405	300845	捷安高科	1,900	21,413.00	0.00
406	002775	文科股份	5,000	21,400.00	0.00
406	300126	锐奇股份	2,500	21,400.00	0.00
408	002913	奥士康	500	21,370.00	0.00
409	688067	爱威科技	870	21,367.20	0.00
410	603172	万丰股份	1,200	21,360.00	0.00
410	605177	东亚药业	1,200	21,360.00	0.00
412	688597	煜邦电力	2,592	21,280.32	0.00
413	603725	天安新材	2,300	21,275.00	0.00

414	688530	欧莱新材	1,294	21,273.36	0.00
415	002687	乔治白	4,400	21,208.00	0.00
416	301273	瑞晨环保	800	21,192.00	0.00
417	002999	天禾股份	3,100	21,173.00	0.00
418	002486	嘉麟杰	6,800	21,148.00	0.00
419	002998	优彩资源	2,800	21,140.00	0.00
420	300633	开立医疗	800	21,136.00	0.00
421	600051	宁波联合	2,800	21,112.00	0.00
422	688466	金科环境	1,297	21,102.19	0.00
423	300958	建工修复	1,700	21,097.00	0.00
424	002381	双箭股份	3,200	21,088.00	0.00
425	603488	展鹏科技	2,700	21,060.00	0.00
426	688026	洁特生物	1,306	21,039.66	0.00
427	002494	华斯股份	3,900	21,021.00	0.00
428	603797	联泰环保	4,500	21,015.00	0.00
429	300575	中旗股份	3,600	20,988.00	0.00
430	600883	博闻科技	2,600	20,956.00	0.00
431	300800	力合科技	1,800	20,934.00	0.00
432	688659	元琛科技	2,214	20,922.30	0.00
433	600847	万里股份	1,800	20,916.00	0.00
434	600099	林海股份	2,000	20,900.00	0.00
434	603329	上海雅仕	1,900	20,900.00	0.00
434	605567	春雪食品	1,900	20,900.00	0.00
437	603768	常青股份	1,800	20,880.00	0.00
438	300412	迦南科技	3,900	20,865.00	0.00
439	300243	瑞丰高材	2,000	20,860.00	0.00
440	000159	国际实业	3,600	20,808.00	0.00
441	301166	优宁维	700	20,776.00	0.00
442	300335	迪森股份	3,600	20,736.00	0.00
442	600561	江西长运	3,200	20,736.00	0.00
444	688468	科美诊断	2,823	20,720.82	0.00
445	000153	丰原药业	3,300	20,691.00	0.00
446	603183	建研院	4,800	20,688.00	0.00
447	300112	万讯自控	2,400	20,664.00	0.00
448	000573	粤宏远 A	5,000	20,650.00	0.00
449	300977	深圳瑞捷	1,200	20,628.00	0.00
450	600303	曙光股份	6,300	20,538.00	0.00
451	300583	赛托生物	1,500	20,535.00	0.00
452	000856	冀东装备	2,000	20,520.00	0.00
452	002817	黄山胶囊	2,700	20,520.00	0.00
452	603385	惠达卫浴	3,000	20,520.00	0.00
455	600661	昂立教育	2,000	20,500.00	0.00
456	600448	华纺股份	6,500	20,475.00	0.00
457	600854	春兰股份	4,100	20,459.00	0.00

458	000757	浩物股份	4,200	20,454.00	0.00
459	603378	亚士创能	3,000	20,430.00	0.00
460	300929	华骐环保	1,900	20,425.00	0.00
461	300387	富邦科技	2,400	20,424.00	0.00
462	300721	怡达股份	1,600	20,368.00	0.00
463	300597	吉大通信	2,200	20,328.00	0.00
464	002809	红墙股份	1,900	20,311.00	0.00
465	300246	宝莱特	2,500	20,250.00	0.00
466	000605	渤海股份	3,000	20,130.00	0.00
467	000548	湖南投资	3,700	20,128.00	0.00
468	000790	华神科技	5,200	20,124.00	0.00
469	603968	醋化股份	1,800	20,106.00	0.00
470	002377	国创高新	7,000	20,020.00	0.00
471	600149	廊坊发展	4,000	19,960.00	0.00
472	300517	海波重科	1,800	19,908.00	0.00
473	603818	曲美家居	5,500	19,855.00	0.00
474	002873	新天药业	2,000	19,840.00	0.00
475	000637	茂化实华	4,600	19,780.00	0.00
476	301098	金埔园林	2,300	19,734.00	0.00
477	603335	迪生力	3,500	19,705.00	0.00
478	002883	中设股份	1,800	19,692.00	0.00
479	600801	华新建材	800	19,632.00	0.00
480	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
481	603717	天域生物	2,500	19,600.00	0.00
482	688701	卓锦股份	2,403	19,584.45	0.00
483	300334	津膜科技	2,800	19,488.00	0.00
484	300621	维业股份	2,300	19,343.00	0.00
485	300422	博世科	4,200	19,278.00	0.00
486	301081	严牌股份	1,900	19,247.00	0.00
487	601996	丰林集团	8,500	19,125.00	0.00
488	001233	海安集团	367	19,039.96	0.00
489	300074	华平股份	4,100	18,901.00	0.00
490	600082	海泰发展	4,600	18,676.00	0.00
491	002821	凯莱英	200	18,586.00	0.00
492	002667	威领股份	1,400	18,326.00	0.00
493	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
494	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
495	002444	巨星科技	500	17,010.00	0.00
496	688676	金盘科技	182	16,441.88	0.00
497	002850	科达利	100	15,786.00	0.00
498	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
499	600928	西安银行	4,100	15,170.00	0.00
500	603409	汇通控股	400	14,892.00	0.00
501	688295	中复神鹰	449	14,731.69	0.00

502	601717	中创智领	600	14,730.00	0.00
503	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
504	603298	杭叉集团	500	13,285.00	0.00
505	301590	优优绿能	73	12,942.90	0.00
506	603379	三美股份	200	12,144.00	0.00
507	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
508	002318	久立特材	400	11,580.00	0.00
509	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
510	002223	鱼跃医疗	300	11,463.00	0.00
511	000403	派林生物	830	11,362.70	0.00
512	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
513	600562	国睿科技	400	11,304.00	0.00
514	002939	长城证券	1,100	11,220.00	0.00
515	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
516	600563	法拉电子	100	10,495.00	0.00
517	600867	通化东宝	1,200	9,804.00	0.00
518	002518	科士达	200	9,704.00	0.00
519	002262	恩华药业	400	9,652.00	0.00
520	002472	双环传动	200	9,482.00	0.00
521	688375	国博电子	100	9,311.00	0.00
522	600109	国金证券	1,000	9,300.00	0.00
523	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
524	601928	凤凰传媒	900	9,036.00	0.00
525	001289	龙源电力	600	9,024.00	0.00
526	603650	彤程新材	200	8,828.00	0.00
527	603939	益丰药房	400	8,688.00	0.00
528	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
529	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
530	301611	珂玛科技	100	8,573.00	0.00
531	688488	艾迪药业	521	8,507.93	0.00
532	002595	豪迈科技	100	8,451.00	0.00
533	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
534	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
535	002051	中工国际	900	8,163.00	0.00
536	603766	隆鑫通用	500	8,055.00	0.00
537	603858	步长制药	500	7,820.00	0.00
538	300001	特锐德	300	7,704.00	0.00
539	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
540	603979	金诚信	100	7,615.00	0.00
541	002156	通富微电	200	7,540.00	0.00
542	600012	皖通高速	500	7,410.00	0.00
543	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
544	605128	上海沿浦	200	7,372.00	0.00
545	601880	辽港股份	4,500	7,200.00	0.00

546	601990	南京证券	900	7,128.00	0.00
547	600862	中航高科	300	7,089.00	0.00
548	000887	中鼎股份	300	6,963.00	0.00
549	002903	宇环数控	300	6,900.00	0.00
550	000559	万向钱潮	400	6,880.00	0.00
551	600906	财达证券	1,000	6,670.00	0.00
552	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
553	600363	联创光电	100	6,306.00	0.00
554	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
555	688373	盟科药业	1,025	6,191.00	0.00
556	300487	蓝晓科技	100	6,175.00	0.00
557	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
558	002007	华兰生物	400	6,052.00	0.00
559	301536	星辰科技	100	5,991.00	0.00
560	003022	联泓新科	300	5,943.00	0.00
561	000528	柳工	500	5,935.00	0.00
562	688475	萤石网络	197	5,931.67	0.00
563	688819	天能股份	175	5,813.50	0.00
564	601966	玲珑轮胎	400	5,812.00	0.00
565	688428	诺诚健华	276	5,663.52	0.00
566	600885	宏发股份	180	5,472.00	0.00
567	600909	华安证券	800	5,424.00	0.00
568	688308	欧科亿	169	5,347.16	0.00
569	603207	小方制药	185	5,294.70	0.00
570	600566	济川药业	200	5,260.00	0.00
571	000733	振华科技	100	5,241.00	0.00
572	603833	欧派家居	100	5,209.00	0.00
573	002294	信立泰	100	4,955.00	0.00
574	300144	宋城演艺	600	4,914.00	0.00
575	300679	电连技术	100	4,868.00	0.00
576	600131	国网信通	300	4,842.00	0.00
577	300558	贝达药业	100	4,669.00	0.00
578	688608	恒玄科技	20	4,538.80	0.00
579	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
580	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
581	300458	全志科技	100	4,203.00	0.00
582	000728	国元证券	500	4,175.00	0.00
583	300850	新强联	100	4,137.00	0.00
584	002572	索菲亚	300	4,083.00	0.00
585	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
586	301607	富特科技	100	4,011.00	0.00
587	002432	九安医疗	100	4,004.00	0.00
588	600529	山东药玻	200	3,986.00	0.00
589	600765	中航重机	200	3,832.00	0.00

590	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
591	300765	新诺威	100	3,607.00	0.00
592	688563	航材股份	61	3,565.45	0.00
593	603658	安图生物	100	3,542.00	0.00
594	601099	太平洋	800	3,288.00	0.00
595	603885	吉祥航空	200	2,976.00	0.00
596	688416	恒烁股份	53	2,921.89	0.00
597	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
598	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
599	002831	裕同科技	100	2,851.00	0.00
600	000997	新大陆	100	2,832.00	0.00
601	601168	西部矿业	100	2,764.00	0.00
602	300623	捷捷微电	100	2,717.00	0.00
603	000404	长虹华意	400	2,708.00	0.00
604	002130	沃尔核材	100	2,632.00	0.00
605	003020	立方制药	100	2,588.00	0.00
606	603568	伟明环保	100	2,538.00	0.00
607	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
608	002202	金风科技	100	2,040.00	0.00
609	600707	彩虹股份	300	1,947.00	0.00
610	600582	天地科技	300	1,749.00	0.00
611	600737	中粮糖业	100	1,721.00	0.00
612	002603	以岭药业	100	1,707.00	0.00
613	600258	首旅酒店	100	1,675.00	0.00
614	688212	澳华内镜	38	1,660.98	0.00
615	000830	鲁西化工	100	1,657.00	0.00
616	603125	常青科技	96	1,620.48	0.00
617	002532	天山铝业	100	1,618.00	0.00
618	002085	万丰奥威	100	1,601.00	0.00
619	600859	王府井	100	1,553.00	0.00
620	600177	雅戈尔	200	1,520.00	0.00
621	601061	中信金属	100	1,440.00	0.00
622	000922	佳电股份	100	1,376.00	0.00
623	603056	德邦股份	100	1,367.00	0.00
624	600995	南网储能	100	1,257.00	0.00
625	600295	鄂尔多斯	100	1,236.00	0.00
626	000429	粤高速 A	100	1,178.00	0.00
627	000729	燕京啤酒	100	1,123.00	0.00
628	600710	苏美达	100	1,081.00	0.00
629	301187	欧圣电气	40	1,076.40	0.00
630	600352	浙江龙盛	100	1,066.00	0.00
631	600873	梅花生物	100	1,013.00	0.00
632	600546	山煤国际	100	1,009.00	0.00
633	600004	白云机场	100	946.00	0.00

634	001286	陕西能源	100	931.00	0.00
635	002926	华西证券	100	928.00	0.00
636	600299	安迪苏	100	897.00	0.00
637	601158	重庆水务	200	894.00	0.00
638	603086	先达股份	100	822.00	0.00
639	601666	平煤股份	100	787.00	0.00
640	600497	驰宏锌锗	100	731.00	0.00
641	600956	新天绿能	100	725.00	0.00
642	601139	深圳燃气	100	660.00	0.00
643	600820	隧道股份	100	649.00	0.00
644	002035	华帝股份	100	620.00	0.00
645	002500	山西证券	100	599.00	0.00
646	000937	冀中能源	100	538.00	0.00
647	000883	湖北能源	100	454.00	0.00
647	600925	苏能股份	100	454.00	0.00
649	601333	广深铁路	100	304.00	0.00
650	688002	睿创微纳	1	100.80	0.00
651	688568	中科星图	1	59.00	0.00
652	688425	铁建重工	1	5.07	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	600660	福耀玻璃	40,204,191.76	2.79
2	002594	比亚迪	38,073,578.68	2.65
3	300750	宁德时代	37,909,919.20	2.63
4	603986	兆易创新	36,100,257.60	2.51
5	600900	长江电力	33,940,615.60	2.36
6	600519	贵州茅台	33,584,316.00	2.33
7	000333	美的集团	33,280,917.00	2.31
8	002371	北方华创	32,562,258.55	2.26
9	600104	上汽集团	31,859,826.55	2.21
10	601127	赛力斯	31,754,383.00	2.21
11	601009	南京银行	31,486,914.42	2.19
12	601328	交通银行	31,323,487.68	2.18
13	601138	工业富联	30,869,893.00	2.15
14	600031	三一重工	30,760,695.00	2.14
15	300274	阳光电源	29,786,180.84	2.07
16	601398	工商银行	29,256,142.00	2.03

17	000425	徐工机械	29,086,381.00	2.02
18	000858	五粮液	29,041,022.00	2.02
19	601229	上海银行	27,320,849.00	1.90
20	002714	牧原股份	27,073,804.00	1.88

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	300750	宁德时代	68,658,044.00	4.77
2	600519	贵州茅台	61,995,220.00	4.31
3	600660	福耀玻璃	44,835,018.00	3.12
4	002594	比亚迪	44,359,201.00	3.08
5	600036	招商银行	43,882,629.00	3.05
6	000333	美的集团	42,892,771.31	2.98
7	000858	五粮液	42,016,120.00	2.92
8	300308	中际旭创	40,341,865.06	2.80
9	603986	兆易创新	40,101,379.88	2.79
10	002475	立讯精密	39,831,307.61	2.77
11	601138	工业富联	36,852,329.00	2.56
12	600919	江苏银行	36,205,388.00	2.52
13	002371	北方华创	36,048,335.90	2.51
14	300274	阳光电源	35,135,185.73	2.44
15	600031	三一重工	35,092,491.00	2.44
16	601127	赛力斯	34,996,315.96	2.43
17	300502	新易盛	34,373,823.60	2.39
18	601318	中国平安	34,300,623.96	2.38
19	601009	南京银行	33,181,047.38	2.31
20	601166	兴业银行	32,210,781.00	2.24
21	601688	华泰证券	31,374,105.00	2.18
22	600900	长江电力	30,746,235.00	2.14
23	002463	沪电股份	30,674,615.04	2.13
24	002714	牧原股份	29,184,842.00	2.03
25	600030	中信证券	29,057,176.80	2.02

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	6,096,182,246.30
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	6,749,100,620.91
--------------	------------------

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,000.02	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.02	0.00

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118063	金 05 转债	10	1,000.02	0.00

#### 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，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到福建省龙岩市上杭县住房和城乡建设局的处罚。

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	202,960.83
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,656,082.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,859,043.65

#### 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

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
42,635	7,754.89	19,323,094.91	5.84%	311,306,671.94	94.16%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	517,988.13	0.1567%

### 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

### 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

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）
王建军	公募基金	10~50
	私募资产管理计划	0

	合计	10~50
--	----	-------

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

基金合同生效日(2012年7月5日)基金份额总额	248,871,987.37
本报告期期初基金份额总额	567,359,008.38
本报告期基金总申购份额	177,855,188.54
减：本报告期基金总赎回份额	414,584,430.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	330,629,766.85

## § 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。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### 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 14 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 85,100.00 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率	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	681,699,765.89	5.31%	68,174.44	5.31%	-
东方财富	1	4,404,230,025.23	34.32%	440,423.73	34.32%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	1,566,714,628.30	12.21%	156,671.62	12.21%	-
广发证券	3	988,086,217.68	7.70%	98,812.32	7.70%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	2,120,315,098.08	16.52%	212,036.39	16.52%	-
国投证券	2	546,203,160.89	4.26%	54,626.25	4.26%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	2,286,392,287.21	17.82%	228,651.95	17.82%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-

中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	239,715,994.56	1.87%	23,971.64	1.87%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为国泰海通证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为华源证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司。国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司合并为国泰海通证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本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
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	241,114.16	38.75%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	188,163.83	30.24%	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	120,881.91	19.42%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	72,145.40	11.59%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

### 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关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-01-15
2	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	上海证券报	2025-01-21
3	关于易方达基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同、托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-20
4	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
8	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-25
9	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（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
10	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	上海证券报	2025-03-31
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	上海证券报	2025-04-22
12	易方达基金管理有限公司关于恢复北京加和基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-10
13	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-17
14	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报	2025-07-21
18	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-08-14
19	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	上海证券报	2025-08-30
20	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-05

21	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-30
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	上海证券报	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-28
25	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-19
26	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与基金投顾业务迁移安排的联合公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-23
27	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-25
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-25

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025年01月01日~2025年08月20日	139,116,202.63	0.00	139,116,202.63	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》；
- 3.《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

### 13.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

### 13.3 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