易方达中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）

2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达中证全指证券公司指数（LOF）
场内简称	证券 LOF
基金主代码	502010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 8 日
报告期末基金份额总额	1,126,803,241.88 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，力争将年化跟踪误差控制在 4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在 0.35%以内，主要投

	资策略包括资产配置策略、权益类品种投资策略、金融衍生品的投资策略等。	
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×95%+同期银行活期存款利率(税后) ×5%	
风险收益特征	本基金为股票基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。长期而言，其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	易方达中证全指证券公司指数（LOF）A	易方达中证全指证券公司指数（LOF）C
下属分级基金的交易代码	502010	012874
报告期末下属分级基金的份额总额	720,654,125.97 份	406,149,115.91 份

注：自 2021 年 7 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2021 年 7 月 20 日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	易方达中证全指证券公司指数（LOF）A	易方达中证全指证券公司指数（LOF）C
1.本期已实现收益	5,023,934.73	2,188,137.11
2.本期利润	81,727,094.97	38,393,007.71

3.加权平均基金份额本期利润	0.1091	0.1053
4.期末基金资产净值	937,294,616.94	517,936,565.66
5.期末基金份额净值	1.3006	1.2752

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证全指证券公司指数（LOF）A

阶段	净值增长率①	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	8.96%	1.72%	8.27%	1.72%	0.69%	0.00%
过去六个月	-6.82%	1.51%	-7.42%	1.51%	0.60%	0.00%
过去一年	-0.35%	1.39%	-2.01%	1.39%	1.66%	0.00%
过去三年	27.69%	1.66%	22.27%	1.66%	5.42%	0.00%
过去五年	3.45%	1.59%	-4.39%	1.59%	7.84%	0.00%
过去七年	25.63%	1.67%	5.28%	1.68%	20.35%	-0.01%
过去十年	23.72%	1.67%	-6.82%	1.68%	30.54%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-11.05%	1.84%	-30.65%	1.89%	19.60%	-0.05%

易方达中证全指证券公司指数（LOF）C

阶段	净值增长率①	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	8.85%	1.72%	8.27%	1.72%	0.58%	0.00%
过去六个月	-7.01%	1.51%	-7.42%	1.51%	0.41%	0.00%

过去一年	-0.75%	1.39%	-2.01%	1.39%	1.26%	0.00%
过去三年	26.17%	1.66%	22.27%	1.66%	3.90%	0.00%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.27%	1.59%	-1.38%	1.59%	5.65%	0.00%

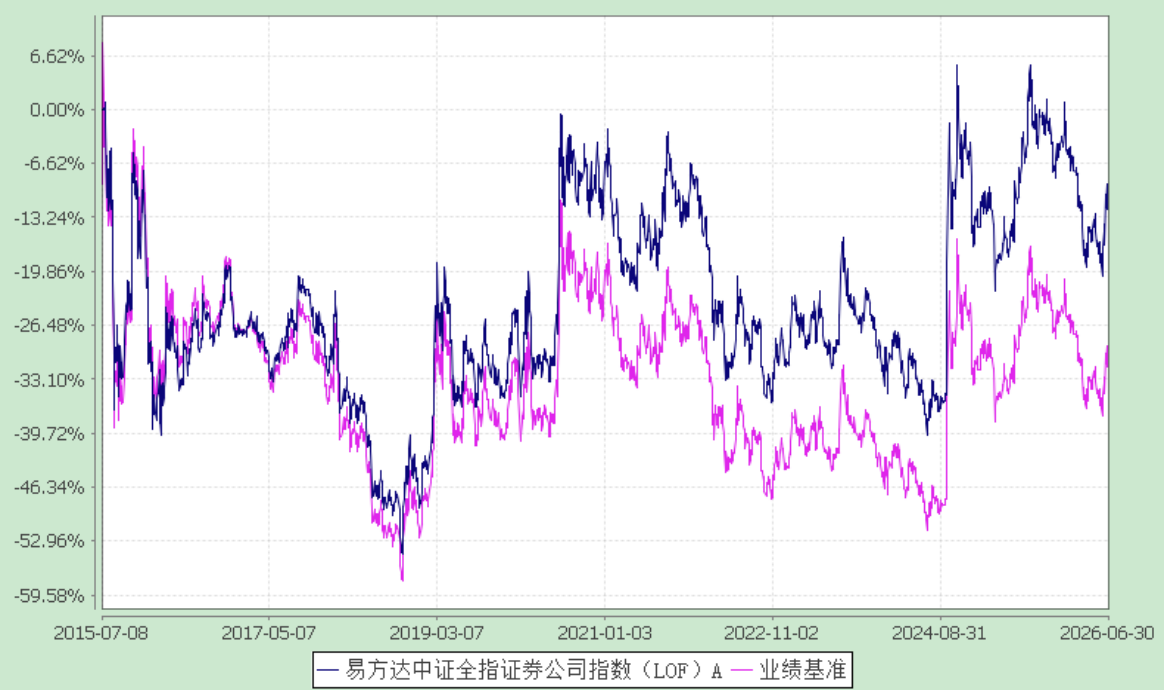
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

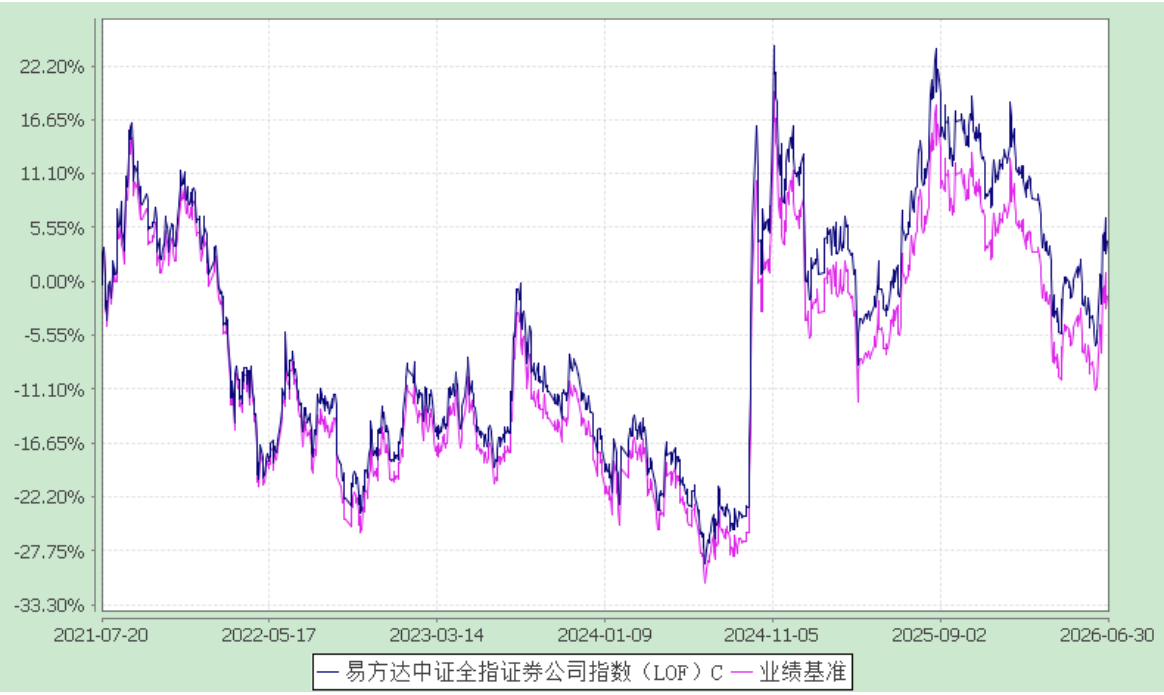
易方达中证全指证券公司指数（LOF）A

（2015 年 7 月 8 日至 2026 年 6 月 30 日）



易方达中证全指证券公司指数（LOF）C

（2021 年 7 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：自 2021 年 7 月 19 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2021 年 7 月 20 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余海燕	本基金的基金经理，易方达沪深 300 医药 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF 联接、易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企 ETF 联接（QDII）、易方达恒生国企（QDII-ETF）、易方达	2022-11-01	-	21 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理，易方达上证 50 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易

	中证海外中国互联网 50ETF 联接（QDII）、易方达中证 500ETF 联接、易方达奥明日经 225ETF（QDII）、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证军工 ETF、易方达上证 50 指数（LOF）的基金经理，指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员				方达黄金 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 30 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证全指证券公司指数，该指数在中证全指指数样本中选取中证行业分类为证券公司的全部证券作为样本，反映证券公司行业上市公司证券的整体表现。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2026 年二季度，中国经济在外部不确定性加剧与内需持续修复中保持稳健运行，宏观政策延续积极取向、精准发力，新质生产力加速释放，经济运行呈现稳中有进、进中提质的态势。面对全球贸易壁垒持续升级、地缘政治博弈复杂化，以及国内房地产市场持续调整、部分企业经营压力加大等困难挑战，中国政府保持战略定力，强化宏观政策跨周期调节，加快超长期特别国债与专项债落地见效，推动“两重”“两新”政策扩围加力，工业生产保持韧性，就业物价总体平稳，消费结构持续升级，有效投资稳步扩大，经济运行延续回升向好、质效双升的良好态势。经济结构加速优化，新质生产力加速形成。高技术制造业与装备制造业继续领跑，人工智能、人形机器人、低空经济等前沿领域加速突破，算力基础设施与数据要素市场建设提速，数字技术与传统产业深度融合，为经济高质量发展注入持续动力。

资本市场方面，二季度 A 股市场延续结构性行情主线，整体呈现“震荡分化、板块轮动加快”的格局。行业层面，一季度领涨的能源资源主线在二季度逐步降温，受益于人工智能大模型商业化加速落地及算力基建政策持续催化，电子、通信、半导体、人工智能等科技成长板块表现领先，成为二季度市场领涨主线；而煤炭、石油石化等上游资源品受大宗商品价格回落影响表现承压，房地产、商贸零售、食品饮料等板块仍受制于基本面压力而表现偏弱。从市场主流指数的表现来看，科创 50、创业板指等成长风格指数在科技行情驱动下表现领先，中证 500、中证 1000 等中小盘指数亦有较好表现，沪深 300 指数表现稳健，而上证 50、中证红利等价值风格指数表现则相对平淡。报告期内证券行业整体业绩延续增长态势，得益于投行注册制全面深化带来的 IPO 与再融资规模扩容，以及市场风险偏好阶段性提升，证券行业表现较好，报告期内中证全指证券公司指数上涨 8.67%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数

量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.3006 元，本报告期份额净值增长率为 8.96%，同期业绩比较基准收益率为 8.27%；C 类基金份额净值为 1.2752 元，本报告期份额净值增长率为 8.85%，同期业绩比较基准收益率为 8.27%。年化跟踪误差 0.68%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,382,451,682.76	93.60
	其中：股票	1,382,451,682.76	93.60
2	固定收益投资	30,213,720.63	2.05
	其中：债券	30,213,720.63	2.05
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	46,213,285.46	3.13
7	其他资产	18,096,720.58	1.23
8	合计	1,476,975,409.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.00
C	制造业	1,079,548.36	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	689,299.80	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,380,645,101.32	94.87
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,382,451,682.76	95.00

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	6,993,179	200,914,032.67	13.81
2	300059	东方财富	9,069,111	184,828,482.18	12.70
3	601211	国泰海通	8,095,183	147,332,330.60	10.12
4	601688	华泰证券	4,188,790	86,372,849.80	5.94

5	600999	招商证券	2,658,869	56,102,135.90	3.86
6	000776	广发证券	2,115,029	49,491,678.60	3.40
7	600958	东方证券	3,746,265	35,364,741.60	2.43
8	601995	中金公司	837,900	30,290,085.00	2.08
9	601377	兴业证券	4,950,071	29,898,428.84	2.05
10	000166	申万宏源	6,458,676	28,418,174.40	1.95

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,213,720.63	2.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,213,720.63	2.08

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	299,000	30,213,720.63	2.08

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的公开谴责。

本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金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。

5.11.2 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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	73,607.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,023,113.28
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	18,096,720.58

5.11.4报告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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证全指证券公司指数（LOF）A	易方达中证全指证券公司指数（LOF）C
报告期期初基金份额总额	728,678,220.69	346,908,463.32
报告期期间基金总申购份额	157,789,711.48	212,450,543.89
减：报告期期间基金总赎回份额	165,813,806.20	153,209,891.30
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	720,654,125.97	406,149,115.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会准予易方达证券公司指数分级证券投资基金募集注册的文件；

2.《易方达中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

3.《易方达中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

9.2存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

9.3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

二〇二六年七月二十一日