易方达中证 800 指数增强型证券投资基金

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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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 800 增强
基金主代码	026359
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 1 月 15 日
报告期末基金份额总额	299,036,028.93 份
投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 4%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争

	实现超越业绩比较基准的投资回报。股票投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型，在控制组合风险与交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优选股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。本基金通过采取多个定量投资模型，力争分散模型风险，提高投资组合表现。本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行。债券投资方面,本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资管理。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权，并可参与转融通证券出借业务、融资业务。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与

	香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 800 增强 A	易方达中证 800 增强 C
下属分级基金的交易代码	026359	026360
报告期末下属分级基金的份额总额	207,122,392.11 份	91,913,636.82 份

§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 800 增强 A	易方达中证 800 增强 C
1.本期已实现收益	47,824,119.50	13,334,648.84
2.本期利润	151,865,907.41	17,269,324.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.2325	0.1424
4.期末基金资产净值	224,402,890.46	99,401,595.74
5.期末基金份额净值	1.0834	1.0815

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 800 增强 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	14.50%	1.25%	13.02%	1.27%	1.48%	-0.02%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.34%	1.12%	6.03%	1.19%	2.31%	-0.07%

易方达中证 800 增强 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	14.38%	1.25%	13.02%	1.27%	1.36%	-0.02%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.15%	1.12%	6.03%	1.19%	2.12%	-0.07%

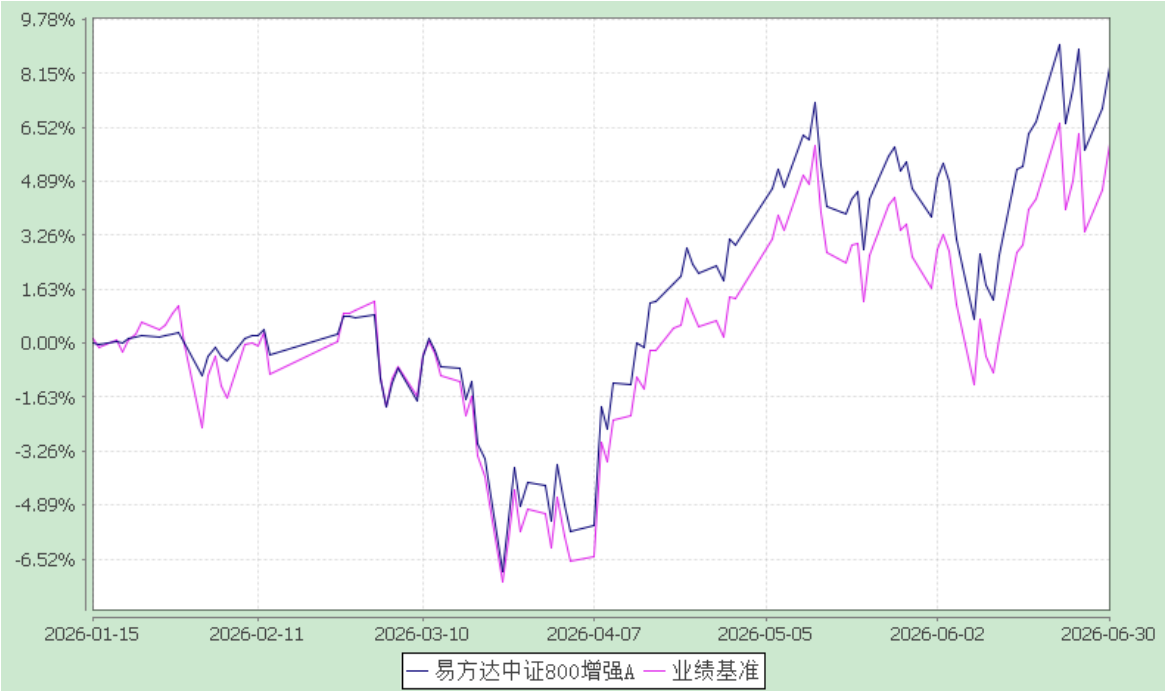
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中证 800 指数增强型证券投资基金

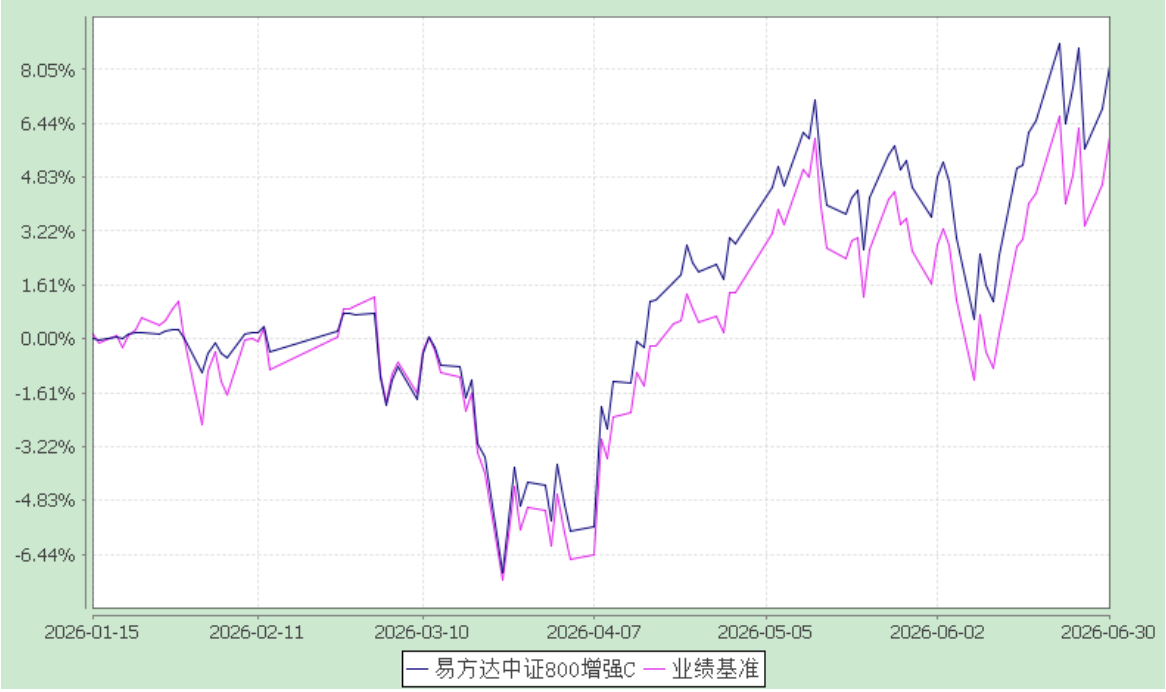
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2026 年 1 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日）

易方达中证 800 增强 A



易方达中证 800 增强 C



注：1.本基金合同于 2026 年 1 月 15 日生效，截至报告期末本基金合同生效

未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

§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		
刘文贵	本基金的基金经理，易方达中证 500 量化增强的基金经理，易方达丰惠混合的基金经理助理，投资经理	2026-01-15	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任松河资本管理公司量化研究员，上海泓信投资管理有限公司衍生品投资总监，深圳市弘源泰平资产管理有限公司量化投资总监。

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

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
刘文贵	公募基金	2	1,742,280,545.40	2023-11-09
	私募资产管理计划	2	2,341,042,678.16	2019-04-25
	其他组合	2	3,222,086,290.95	2026-02-06
	合计	6	7,305,409,514.51	-

注：1.“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2.报告期内，刘文贵曾兼任1个私募资产管理计划的投资经理，已于2026年6月30日离任。

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

经济在一季度"开门红"之后转入"高开后趋稳"的运行状态：4 月、5 月规模以上工业增加值同比分别为 4.1%和 4.5%，较一季度 1-2 月 6.3%的累计增速有所回落但仍处稳健区间；制造业 PMI 在 4 月、5 月、6 月分别录得 50.3%、50.0%、50.3%，全季稳定运行于扩张区间上方；年初增长动能的边际改善在二季度得到了确认与延续，但并未演化为总量意义上的全面加速。与一季度相比，二季度经济结构分化进一步加深，"新旧动能切换"这一主线不但没有弱化，反而更加清晰，出口链景气度不降反升，二季度宏观图景延续了一季度的判断——增长动能正从传统地产链、可选耐用品链条，加速切换至以出口高端制造、高技术制造、装备制造和"新质生产力"为代表的新经济链条，而这一结构性切换构成了二季度权益市场风格演绎最重要的宏观背景。

与一季度“1 月中旬天量见顶、其后成交持续萎缩”的路径不同，二季度成交额呈现“季初低位—逐级抬升—高位运行”的重新放量特征，交易主导逻辑也由一

季度后段的“存量博弈下的结构轮动”，切换为“增量资金支撑下的科技成长主线”；从风格表现来看，二季度延续并放大了一季度“成长跑赢价值”的特征，且演绎至极致的“科技成长领航、价值消费掉队”的结构分化格局。在这样风格分化严重的市场环境下，风格暴露对量化模型超额的影响显著提升，组合的风格暴露管理是二季度获取稳健超额的关键。

本基金为指数增强型基金，主要采用多因子量化选股模型作为投资策略。本基金管理人以基准指数的构成为基础，严格控制组合相对基准指数的行业与风格偏离，减少系统性风格冲击，通过对个股（相对基准）进行超低配调整，力求在跟踪指数的基础上，获取较为稳健的超额收益。

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 1.0834 元，本报告期份额净值增长率为 14.50%，同期业绩比较基准收益率为 13.02%；C 类基金份额净值为 1.0815 元，本报告期份额净值增长率为 14.38%，同期业绩比较基准收益率为 13.02%。年化跟踪误差 1.99%，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	274,099,721.25	82.08
	其中：股票	274,099,721.25	82.08
2	固定收益投资	23,000.88	0.01
	其中：债券	23,000.88	0.01
	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	45,307,223.53	13.57
7	其他资产	14,510,984.77	4.35
8	合计	333,940,930.43	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

5.2.1.1积极投资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	499,520.40	0.15
B	采矿业	195,018.82	0.06
C	制造业	16,997,125.54	5.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	276,372.22	0.09
E	建筑业	282,684.00	0.09
F	批发和零售业	552,348.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	224,788.00	0.07
H	住宿和餐饮业	9,108.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,381,219.36	0.43
J	金融业	27,867.00	0.01
K	房地产业	325,191.00	0.10
L	租赁和商务服务业	65,058.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	488,401.80	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	449,383.54	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	116,612.00	0.04

Q	卫生和社会工作	34,431.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	90,601.00	0.03
S	综合	16,790.00	0.01
	合计	22,032,519.68	6.80

5.2.1.2指数投资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	633,116.65	0.20
B	采矿业	9,939,143.95	3.07
C	制造业	167,351,158.20	51.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,208,499.58	1.61
E	建筑业	2,256,526.13	0.70
F	批发和零售业	3,047,376.05	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	5,444,752.48	1.68
H	住宿和餐饮业	233,870.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,970,930.54	4.31
J	金融业	37,435,526.09	11.56
K	房地产业	905,588.00	0.28
L	租赁和商务服务业	1,374,622.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	2,880,915.10	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	666,081.80	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	138,129.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	580,966.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	252,067,201.57	77.85

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 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	300308	中际旭创	8,200	10,414,000.00	3.22
2	300750	宁德时代	20,600	8,096,006.00	2.50
3	688256	寒武纪	3,084	4,920,676.20	1.52
4	300502	新易盛	7,393	4,487,551.00	1.39
5	600519	贵州茅台	3,658	4,336,522.42	1.34
6	601318	中国平安	78,600	3,752,364.00	1.16
7	603986	兆易创新	4,500	3,667,500.00	1.13
8	688012	中微公司	7,744	3,628,064.00	1.12
9	600036	招商银行	90,300	3,205,650.00	0.99
10	002371	北方华创	3,500	3,095,960.00	0.96

5.3.2 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前五名股票投资明细

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	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.17
2	688525	佰维存储	814	402,710.22	0.12
3	688766	普冉股份	489	374,867.40	0.12
4	688110	东芯股份	1,798	366,252.60	0.11
5	688416	恒烁股份	2,579	361,060.00	0.11

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	-	-
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）	23,000.88	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,000.88	0.01

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	113704	春风转债	190	19,000.83	0.01
2	118071	华峰转债	30	3,000.04	0.00
3	111025	圣泉转债	10	1,000.01	0.00

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2612	IC2612	5	8,542,400.00	376,800.00	在本报告期内，基金利用股指期货进行多头套保，以应对由于基金申购而带来的对基金净值及跟踪误差的影响。
IF2609	IF2609	1	1,454,940.00	118,111.37	在本报告期内，基金利用股指期货进行

					多头套保，以应对由于基金申购而带来的对基金净值及跟踪误差的影响。
IF2612	IF2612	12	17,141,040.00	125,580.00	在本报告期内，基金利用股指期货进行多头套保，以应对由于基金申购而带来的对基金净值及跟踪误差的影响。
公允价值变动总额合计(元)					620,491.37
股指期货投资本期收益(元)					7,632,945.71
股指期货投资本期公允价值变动(元)					7,811,146.89

5.9.2 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。

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，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。

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。

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	4,458,133.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	10,052,851.26
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	14,510,984.77

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

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	565,262.60	0.17	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证800增强A	易方达中证800增强C
报告期期初基金份额总额	1,707,175,689.84	143,905,575.13
报告期期间基金总申购份额	149,509,639.72	42,738,699.68
减：报告期期间基金总赎回份额	1,649,562,937.45	94,730,637.99
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	207,122,392.11	91,913,636.82

§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中证 800 指数增强型证券投资基金注册的文件；

2.《易方达中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3.《易方达中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

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