易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

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

2.1 基金产品概况

基金简称	易方达沪深 300ETF 联接
基金主代码	110020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 8 月 26 日
报告期末基金份额总额	11,083,755,912.69 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的最小化。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过

	上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。本基金可投资存托凭证。此外，为更好地实现投资目标，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，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金为沪深 300ETF 的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。		
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	易方达沪深 300ETF 联接 A	易方达沪深 300ETF 联接 C	易方达沪深 300ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	110020	007339	022928
报告期末下属分级基金的份额总额	7,017,164,631.32 份	3,936,274,019.72 份	130,317,261.65 份

注：1.自2019年4月25日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2019年4月26日。

2.自2024年12月13日起，本基金增设Y类份额类别，份额首次确认日为2024年12月16日。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金
基金主代码	510310
基金运作方式	交易型开放式（ETF）、发起式
基金合同生效日	2013 年 3 月 6 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 3 月 25 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
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（含存托凭证）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。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,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。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

§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)		
	易方达沪深 300ETF 联接 A	易方达沪深 300ETF 联接 C	易方达沪深 300ETF 联接 Y
1.本期已实现收益	154,876,240.54	79,498,780.17	2,692,227.73
2.本期利润	1,577,916,015.16	857,244,527.81	27,198,827.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.2214	0.2200	0.2202
4.期末基金资产净值	14,127,047,017.76	7,811,462,831.58	262,354,026.34
5.期末基金份额净值	2.0132	1.9845	2.0132

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

易方达沪深 300ETF 联接 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	12.20%	1.19%	11.30%	1.19%	0.90%	0.00%
过去六个月	8.28%	1.07%	7.20%	1.07%	1.08%	0.00%
过去一年	28.07%	0.97%	25.13%	0.97%	2.94%	0.00%
过去三年	37.24%	1.04%	28.26%	1.06%	8.98%	-0.02%
过去五年	7.47%	1.05%	-4.02%	1.06%	11.49%	-0.01%
过去七年	52.10%	1.10%	29.33%	1.11%	22.77%	-0.01%

过去十年	95.70%	1.08%	55.78%	1.09%	39.92%	-0.01%
自基金合同生效起至今	101.32%	1.27%	59.81%	1.30%	41.51%	-0.03%

易方达沪深 300ETF 联接 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	12.14%	1.19%	11.30%	1.19%	0.84%	0.00%
过去六个月	8.17%	1.07%	7.20%	1.07%	0.97%	0.00%
过去一年	27.82%	0.97%	25.13%	0.97%	2.69%	0.00%
过去三年	36.43%	1.04%	28.26%	1.06%	8.17%	-0.02%
过去五年	6.41%	1.05%	-4.02%	1.06%	10.43%	-0.01%
过去七年	50.01%	1.10%	29.33%	1.11%	20.68%	-0.01%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	47.32%	1.11%	25.74%	1.12%	21.58%	-0.01%

易方达沪深 300ETF 联接 Y：

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	12.20%	1.19%	11.30%	1.19%	0.90%	0.00%
过去六个月	8.28%	1.07%	7.20%	1.07%	1.08%	0.00%
过去一年	28.07%	0.97%	25.13%	0.97%	2.94%	0.00%
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	29.84%	0.96%	25.26%	0.96%	4.58%	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

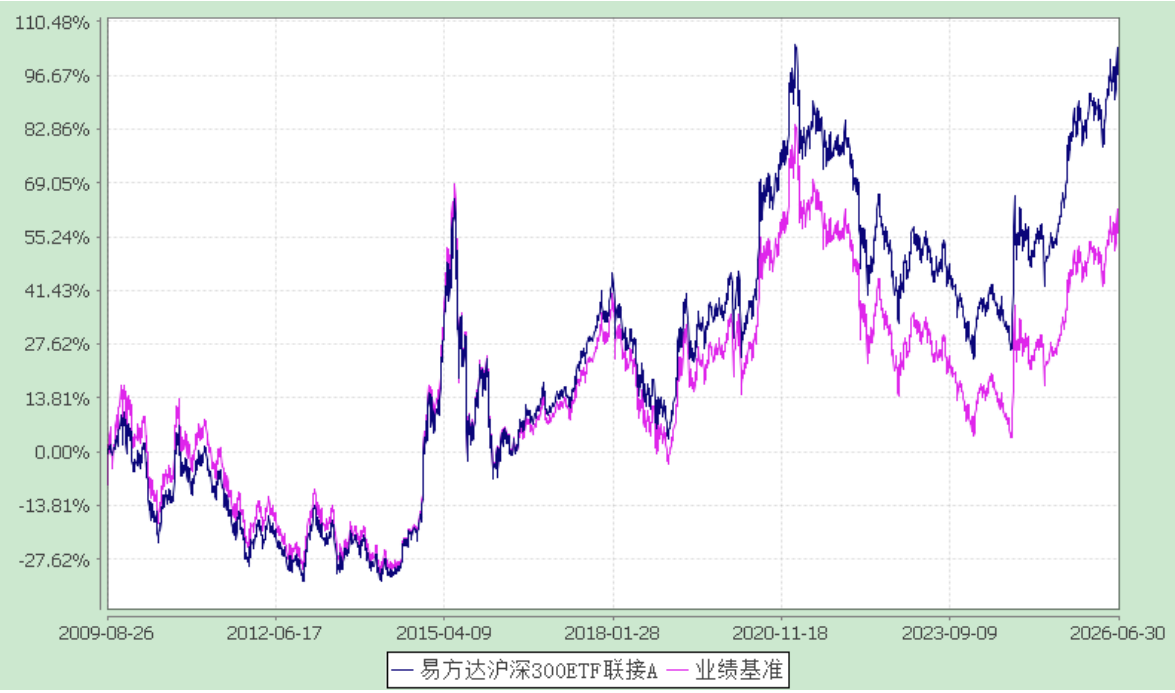
率变动的比较

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

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

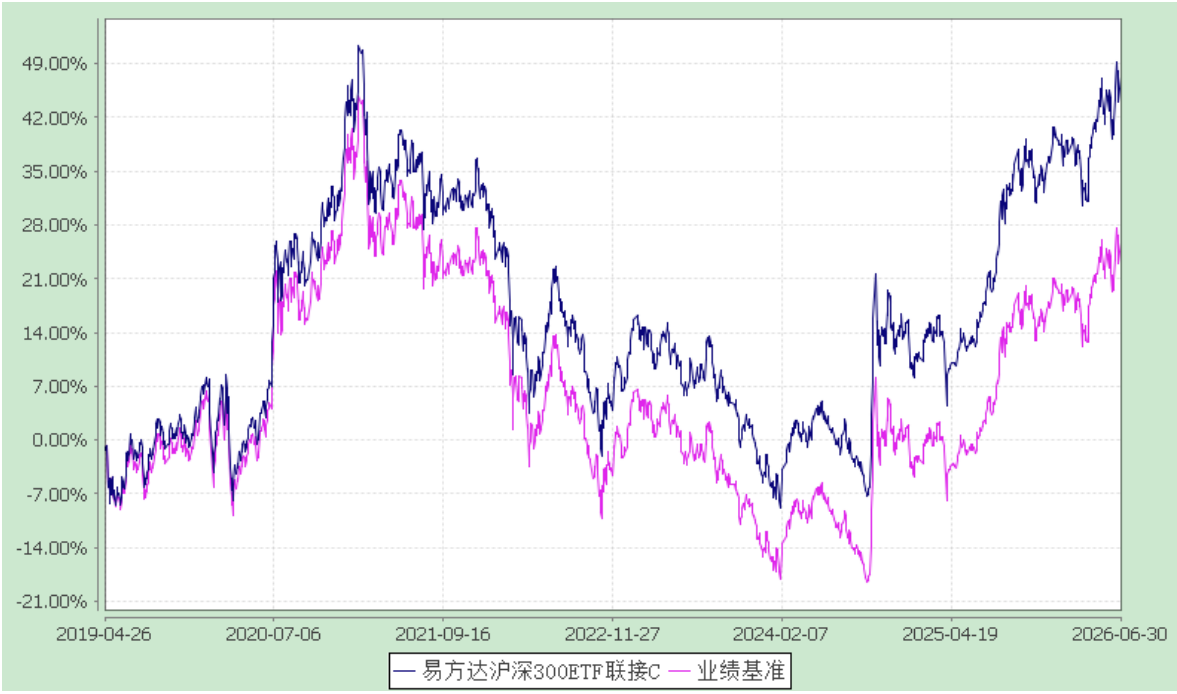
易方达沪深 300ETF 联接 A：

（2009 年 8 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日）



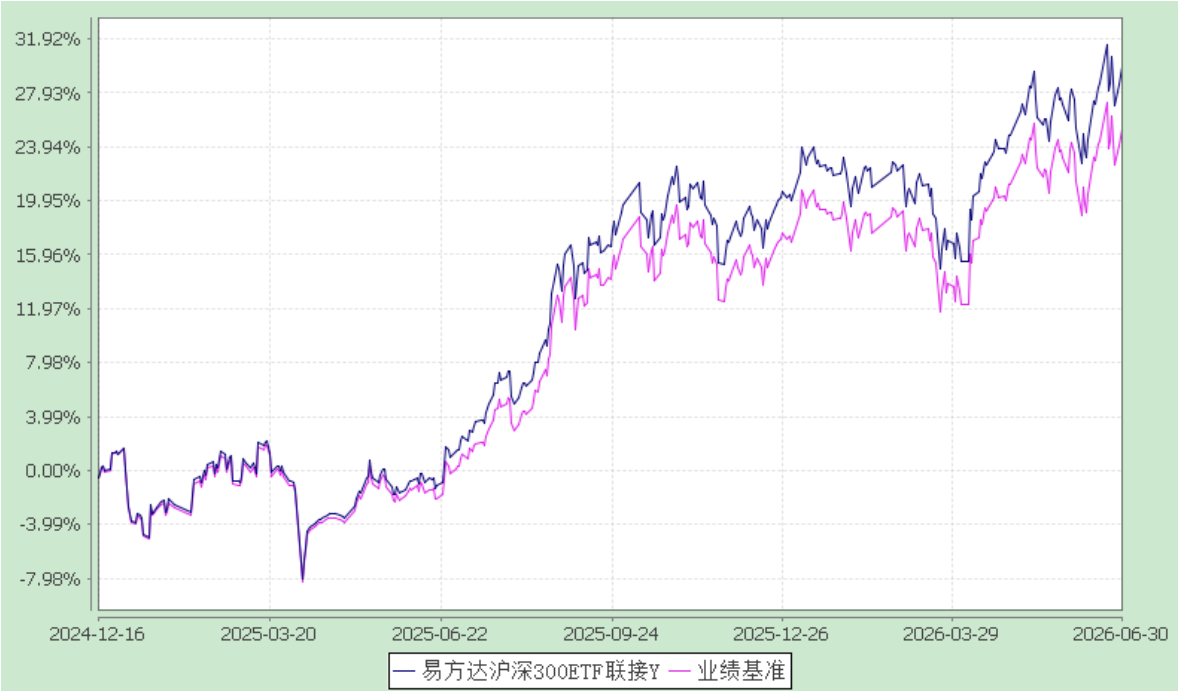
易方达沪深 300ETF 联接 C：

（2019 年 4 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日）



易方达沪深 300ETF 联接 Y

（2024 年 12 月 16 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：1.自 2019 年 4 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 4 月 26 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2.自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2024 年 12 月 16 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、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）、易方达中证全指证券公司指数（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	2016-04-16	-	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。
庞亚平	本基金的基金经理，易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF 联接、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引	2022-12-15	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管，华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量投资部总监，易方达基金管理有限公司易方达中证上海

	领 ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达中证 A500ETF 联接、易方达中证 A500ETF、易方达上证科创板综合 ETF 联接、易方达中证数字经济主题 ETF 的基金经理，指数研究发展部总经理、指数投资决策委员会委员				环交所碳中和 ETF、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达中证光伏产业指数发起式、易方达中证 A100ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达上证科创板成长 ETF、易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 100ETF 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

本基金为易方达沪深 300ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资易方达沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达沪深 300ETF 跟踪沪深 300 指数，该指数由沪深市场中规模大、流动性好的最具有代表性的 300 只证券组成，以综合反映沪深市场上市公司证券的整体表现。

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。

沪深 300 指数作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，聚集 A 股最核心的权益资产，涵盖了各行业龙头，指数表现跟中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关，与 A 股大盘走势基本保持一致。报告期内指数中的电子、通信、建筑材料、机械设备、计算机等行业的成份股涨幅居前，对沪深 300 指数收益

贡献较大，而食品饮料、银行、汽车、石油石化等行业的成份股表现相对落后。报告期内沪深 300 指数上涨 11.90%。

指数的长期收益表现取决于其成份股盈利的长期增长情况，沪深 300 指数作为 A 股市场的核心宽基指数，涵盖了中国经济中主要行业的龙头企业，这些企业的盈利会随着整体经济的增长而相应增长。长期来看沪深 300 指数表现与 GDP 增速基本一致，是分享中国经济增长的有效工具。

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，依据基金申赎变动等情况进行日常组合管理，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 2.0132 元，本报告期份额净值增长率为 12.20%，同期业绩比较基准收益率为 11.30%；C 类基金份额净值为 1.9845 元，本报告期份额净值增长率为 12.14%，同期业绩比较基准收益率为 11.30%；Y 类基金份额净值为 2.0132 元，本报告期份额净值增长率为 12.20%，同期业绩比较基准收益率为 11.30%。年化跟踪误差 0.42%，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	153,175,690.57	0.69
	其中：股票	153,175,690.57	0.69
2	基金投资	20,534,910,307.09	92.12
3	固定收益投资	512,897,534.25	2.30
	其中：债券	512,897,534.25	2.30

	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	931,320,786.88	4.18
8	其他资产	160,061,790.47	0.72
9	合计	22,292,366,109.26	100.00

5.2期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	股票型	交易型开放式（ETF）、发起式	易方达基金管理有限公司	20,534,910,307.09	92.50

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 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	780,956.00	0.00
B	采矿业	5,457,596.62	0.02
C	制造业	104,704,099.97	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,916,886.79	0.02
E	建筑业	1,339,126.28	0.01
F	批发和零售业	203,434.80	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,038,105.26	0.01

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,904,984.57	0.04
J	金融业	22,110,388.28	0.10
K	房地产业	465,551.00	0.00
L	租赁和商务服务业	580,500.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,394,512.00	0.01
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	187,502.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	92,047.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	153,175,690.57	0.69

5.4 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

5.4.1 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	300308	中际旭创	6,200	7,874,000.00	0.04
2	300750	宁德时代	17,000	6,681,170.00	0.03
3	300502	新易盛	8,820	5,353,740.00	0.02
4	688256	寒武纪	2,307	3,680,933.85	0.02
5	600519	贵州茅台	2,900	3,437,921.00	0.02
6	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.01
7	603986	兆易创新	3,200	2,608,000.00	0.01
8	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.01
9	002371	北方华创	2,750	2,432,540.00	0.01
10	000333	美的集团	31,500	2,379,195.00	0.01

5.5 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	512,897,534.25	2.31
	其中：政策性金融债	512,897,534.25	2.31
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	512,897,534.25	2.31

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	210208	21 国开 08	5,000,000	512,897,534.25	2.31

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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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
IF2609	IF2609	270	392,833,800.00	6,039,360.00	在本报告期内，基金利用股指期货进行套期保值操作，以应对基金由于大额净申赎等需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货

					套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求，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。
公允价值变动总额合计(元)					6,039,360.00
股指期货投资本期收益(元)					20,325,279.66
股指期货投资本期公允价值变动(元)					27,273,449.60

5.10.2 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。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。本基金在出现大额净申赎等需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。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。

5.11 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。

5.12投资组合报告附注

5.12.1 本基金目标 ETF 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。

本基金为目标 ETF 的联接基金，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目标 ETF 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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。

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。

5.12.2 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。

5.12.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	49,749,801.05
2	应收证券清算款	38,984,115.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	71,230,347.19
6	其他应收款	97,527.19
7	其他	-
8	合计	160,061,790.47

5.12.4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。

5.12.5报告期末前十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	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.01	新股流通受限
2	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.01	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达沪深300ETF联接A	易方达沪深300ETF联接C	易方达沪深300ETF联接Y
报告期期初基金份额	7,221,277,298.27	4,076,682,289.77	119,371,530.34

总额			
报告期期间基金总申购份额	1,024,985,155.95	1,106,784,522.00	30,950,809.39
减：报告期期间基金总赎回份额	1,229,097,822.90	1,247,192,792.05	20,005,078.08
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	7,017,164,631.32	3,936,274,019.72	130,317,261.65

§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.中国证监会核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的文件；

2.中国证监会《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；

3.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金合同》；

4.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金托管协议》；

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。

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