

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

2026 年中期报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
7.6 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	76
7.7 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	76
7.8 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	76
7.9 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	77
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	77
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77

7.12 投资组合报告附注	77
§ 8 基金份额持有人信息	78
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
8.3 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	78
§ 9 开放式基金份额变动	79
§ 10 重大事件揭示	79
10.1 基金份额持有人大会决议	79
10.2 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	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
10.4 基金投资策略的改变	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	79
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	80
10.8 其他重大事件	82
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	83
11.1 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	83
§ 12 备查文件目录	83
12.1 备查文件目录	83
12.2 存放地点	84
12.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	易方达中证 500 量化增强	
基金主代码	012080	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 15 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	962,839,547.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
下属分级基金的交易代码	012080	012081
报告期末下属分级基金的份额总额	431,427,905.89 份	531,411,641.54 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。股票投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报，在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。债券投资方面，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，并通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择等方面进行积极主动的债券投资管理。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书“风险揭示”部分。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路 21号52层；广东省广州市天河 区珠江东路30号42层；广东省 珠海市横琴新区荣粤道188号6 层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510627；510623；519031	100140
法定代表人		吴欣荣	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
本期已实现收益	78,047,369.94	100,911,776.38

本期利润	99,286,729.02	126,579,561.14
加权平均基金份额本期利润	0.2661	0.2538
本期加权平均净值利润率	19.60%	19.00%
本期基金份额净值增长率	21.84%	21.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
期末可供分配利润	149,579,834.40	173,429,264.27
期末可供分配基金份额利润	0.3467	0.3264
期末基金资产净值	640,882,127.51	777,593,931.69
期末基金份额净值	1.4855	1.4633
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
基金份额累计净值增长率	48.55%	46.33%

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

易方达中证 500 量化增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	18.34%	1.45%	17.61%	1.56%	0.73%	-0.11%
过去六个月	21.84%	1.45%	19.93%	1.58%	1.91%	-0.13%
过去一年	54.61%	1.25%	49.68%	1.35%	4.93%	-0.10%
过去三年	67.59%	1.35%	48.15%	1.41%	19.44%	-0.06%
过去五年	48.31%	1.23%	31.61%	1.30%	16.70%	-0.07%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	48.55%	1.22%	33.15%	1.29%	15.40%	-0.07%

易方达中证 500 量化增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	18.26%	1.45%	17.61%	1.56%	0.65%	-0.11%
过去六个月	21.67%	1.45%	19.93%	1.58%	1.74%	-0.13%
过去一年	54.15%	1.25%	49.68%	1.35%	4.47%	-0.10%
过去三年	66.10%	1.35%	48.15%	1.41%	17.95%	-0.06%
过去五年	46.11%	1.23%	31.61%	1.30%	14.50%	-0.07%
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	46.33%	1.22%	33.15%	1.29%	13.18%	-0.07%

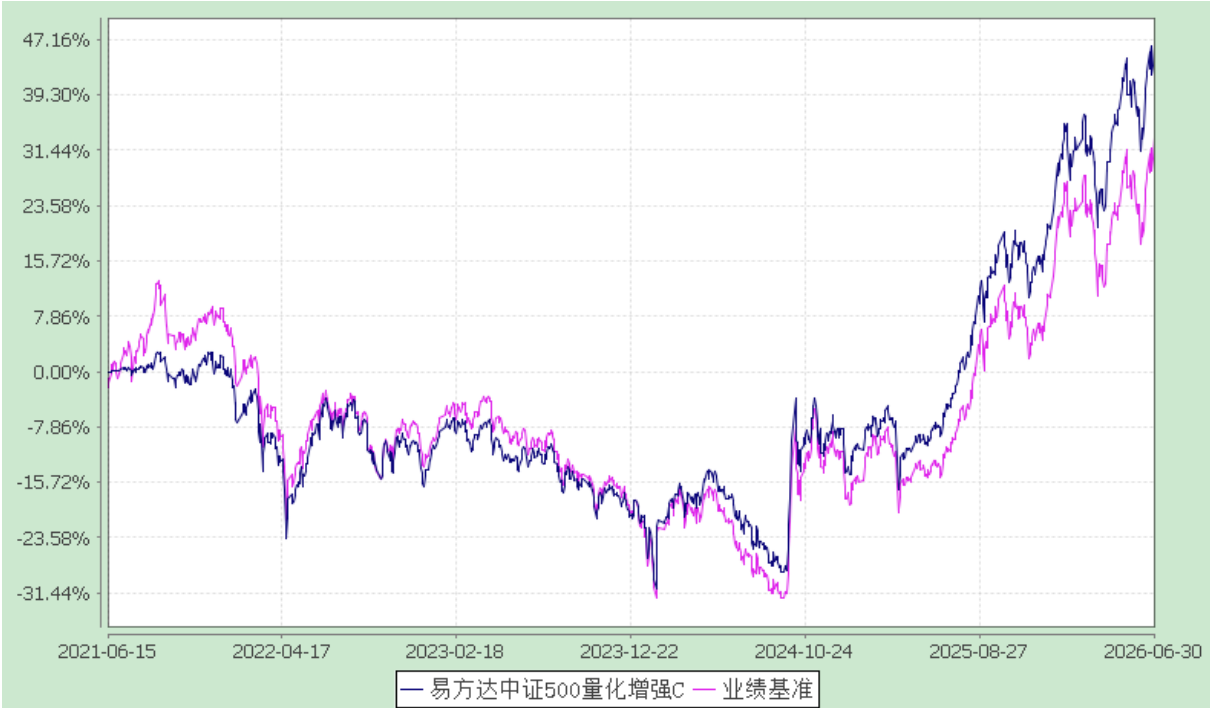
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021 年 6 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日)

易方达中证 500 量化增强 A



易方达中证 500 量化增强 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII 等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
官 泽 帆	本基金的基金经理，易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证 A500 量化增强、易方达中证港股通综合量化增强的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员	2021-06-15	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任招商基金管理有限公司投资开发工程师，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司数量化研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司量化研究员、投资经理、基金经理助理，易方达沪深 300 量化增强、易方达量化策略精选混合、易方达易百智能量化

					策略混合的基金经理。
刘文贵	本基金的基金经理,易方达中证 800 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	2023-11-09	-	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/基金经理助理, “任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
刘文贵	公募基金	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》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定, 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、规范化的投资研究和决策流程、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, 以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则, 通过投资交易系统内的公平交易模块, 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 64 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 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，从最新披露的经济数据来看，当前宏观形势主要呈现以下特征：（1）总量总体平稳，上半年 GDP 同比增长 4.7%，二季度增长动能较一季度有所减弱，但增速仍处于年度预期目标区间，经济整体保持韧性。（2）结构好于总量，供给强于需求，工业生产保持韧性，装备制造业和高技术制造业增长明显快于整体，科技创新与产业升级持续形成新增量，新旧动能中新经济部门明显强于旧经济部门；外贸表现亮眼，为经济运行提供重要支撑。（3）需求端修复偏弱且分化，消费向服务型和升级型需求转换，服务消费快于商品消费，但整体消费增速仍低、居民消费意愿偏谨慎；投资是主要拖累，固定资产投资同比下降，房地产开发投资降幅较大，投资内生动力不足是二季度动能减弱的重要原因。（4）物价温和回升，CPI、PPI 同比均转向正增长，工业品价格改善向企业盈利端传导，企业经营环境有所修复。整体而言，上半年经济呈现供给强于需求、结构好于总量、生产外贸稳健而投资消费偏弱的格局。

市场表现方面，2026 年上半年市场整体呈现震荡上行趋势，上证指数、沪深 300 的涨跌幅分别为 3.16%、7.55%，中小盘指数普遍涨幅更为突出，中证 500 上涨 20.97%，中证 1000 上涨 15.99%，而以科技成长为主的创业板指、科创 50 涨幅居前，分别上涨 35.58%、64.25%。从申万行业表现的角度来看，结构分化特征极为明显，电子、通信涨幅分别高达 86.29%、73.59%，建筑材料、机械设备等行业同样表现居前；但另一方面，商贸零售下跌 29.42%，领跌其他行业，农林牧渔、美容护理、食品饮料等消费类行业以及银行、非银金融、房地产等板块跌幅同样较大。从风格表现的角度来看，成长风格显著占优，而价值风格整体偏弱，成长与价值的分化较为极致。整体而言，上半年市场在成长与科技主线的带动下结构性行情突出，量化选股因子表现也出现分化，与成长风格相关的基本面类因子表现突出，与反转、低波风格相关的量价类因子则有不同程度的回撤。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.4855 元，本报告期份额净值增长率为 21.84%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%；C 类基金份额净值为 1.4633 元，本报告期份额净值增长率为

21.67%，同期业绩比较基准收益率为 19.93%。年化跟踪误差 3.83%，在合同约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

下阶段，外部因素对经济的冲击或已趋于缓和，三季度经济有望边际改善。6 月制造业景气回升更多源于需求端拉动，新订单强势反弹、高技术与装备制造等行业景气回暖；往后看，受益于 AI 革命和供给替代效应，叠加专项债发行提速，后续需求有望延续修复，经济结构转型趋势不改。市场方面，短期有争议的基本面展望与不稳定的微观结构相互叠加，偏悲观的叙事容易有所定价，市场内在稳定性偏弱；中期来看，AI 产业趋势仍是主战场，算力通胀是高弹性细分行业超额收益的主要来源；同时，市场调整充分后有望更多板块获得阶段性机会。整体而言，短期市场或有博弈性的结构冲高，但更大级别上涨行情的条件仍待进一步观察，中期则宜沿科技主线并兼顾结构性机会积极布局。

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

4.6 管理人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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达中证 500 量化增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 500 量化增强 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	142,508,147.72	93,838,945.20
结算备付金		16,109,342.41	20,465,659.24
存出保证金		8,560,842.12	7,176,899.72
交易性金融资产	6.4.7.2	1,248,199,522.65	794,912,543.65
其中：股票投资		1,247,939,513.44	794,912,543.65
基金投资		-	-

债券投资		260,009.21	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		221,435.77	40,825,625.43
应收股利		-	-
应收申购款		17,827,579.20	4,157,303.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,433,426,869.87	961,376,976.68
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,424,911.24	-
应付赎回款		7,375,693.21	50,744,236.22
应付管理人报酬		859,609.91	571,464.53
应付托管费		161,176.88	107,149.60
应付销售服务费		176,899.56	127,652.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		481,787.93	305,300.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	470,731.94	366,275.66
负债合计		14,950,810.67	52,222,079.14
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	962,839,547.43	751,655,338.06
未分配利润	6.4.7.8	455,636,511.77	157,499,559.48
净资产合计		1,418,476,059.20	909,154,897.54
负债和净资产总计		1,433,426,869.87	961,376,976.68

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.4855 元，C 类基金份额净值 1.4633 元；基金份额总额 962,839,547.43 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 431,427,905.89 份，C 类基金份额总额 531,411,641.54 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		232,502,514.46	36,914,184.64
1.利息收入		326,392.25	119,955.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	326,392.25	119,955.01
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）		184,313,507.87	28,861,010.61
其中：股票投资收益	6.4.7.10	161,755,837.04	23,685,991.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	92,569.41	66,667.72
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	14,335,752.11	553,983.52
股利收益	6.4.7.14	8,129,349.31	4,554,367.98
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	46,907,143.84	7,802,519.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	955,470.50	130,699.05
减：二、营业总支出		6,636,224.30	2,819,552.48
1. 管理人报酬		4,640,932.16	2,068,632.49
2. 托管费		870,174.86	387,868.62
3. 销售服务费		990,283.05	273,307.96
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		51,620.14	7,153.52
8. 其他费用	6.4.7.18	83,214.09	82,589.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		225,866,290.16	34,094,632.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		225,866,290.16	34,094,632.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		225,866,290.16	34,094,632.16

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	751,655,338.06	157,499,559.48	909,154,897.54
二、本期期初净资产	751,655,338.06	157,499,559.48	909,154,897.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	211,184,209.37	298,136,952.29	509,321,161.66
（一）、综合收益总额	-	225,866,290.16	225,866,290.16
（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）	211,184,209.37	72,270,662.13	283,454,871.50
其中：1.基金申购款	585,310,249.48	205,172,701.93	790,482,951.41
2.基金赎回款	-374,126,040.11	-132,902,039.80	-507,028,079.91
（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	962,839,547.43	455,636,511.77	1,418,476,059.20
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	550,921,975.92	-52,878,237.33	498,043,738.59
二、本期期初净资产	550,921,975.92	-52,878,237.33	498,043,738.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,225,943.95	29,816,289.93	14,590,345.98

(一)、综合收益总额	-	34,094,632.16	34,094,632.16
(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)	-15,225,943.95	-4,278,342.23	-19,504,286.18
其中: 1.基金申购款	215,439,750.27	-21,648,651.54	193,791,098.73
2.基金赎回款	-230,665,694.22	17,370,309.31	-213,295,384.91
(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	535,696,031.97	-23,061,947.40	512,634,084.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1043 号《关于准予易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,088,975,598.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 547,709.87 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。

本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和

财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部 税务总局公告 2021 年第 33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起,对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	142,508,147.72
等于：本金	142,495,494.12
加：应计利息	12,653.60
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	142,508,147.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,167,957,861.49	-	1,247,939,513.44	79,981,651.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	259,999.39	9.82	260,009.21	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	259,999.39	9.82	260,009.21	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,168,217,860.88	9.82	1,248,199,522.65	79,981,651.95

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	67,028,840.00	-	-	-
IC2612	67,028,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	67,028,840.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2612	IC2612	41	70,047,680.00	3,018,840.00
合计	-	-	-	3,018,840.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	3,018,840.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,281.76
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	384,115.14
其中：交易所市场	384,115.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,335.04
合计	470,731.94

6.4.7.7 实收基金

易方达中证 500 量化增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	311,303,082.37	311,303,082.37
本期申购	269,392,579.16	269,392,579.16
本期赎回（以“-”号填列）	-149,267,755.64	-149,267,755.64
本期末	431,427,905.89	431,427,905.89

易方达中证 500 量化增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	440,352,255.69	440,352,255.69
本期申购	315,917,670.32	315,917,670.32
本期赎回（以“-”号填列）	-224,858,284.47	-224,858,284.47
本期末	531,411,641.54	531,411,641.54

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达中证 500 量化增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,968,379.96	24,262,890.07	68,231,270.03
本期期初	43,968,379.96	24,262,890.07	68,231,270.03
本期利润	78,047,369.94	21,239,359.08	99,286,729.02
本期基金份额交易产生的变动数	27,564,084.50	14,372,138.07	41,936,222.57
其中：基金申购款	62,966,485.82	33,840,444.15	96,806,929.97
基金赎回款	-35,402,401.32	-19,468,306.08	-54,870,707.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	149,579,834.40	59,874,387.22	209,454,221.62

易方达中证 500 量化增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	55,401,966.07	33,866,323.38	89,268,289.45
本期期初	55,401,966.07	33,866,323.38	89,268,289.45

本期利润	100,911,776.38	25,667,784.76	126,579,561.14
本期基金份额交易产生的变动数	17,115,521.82	13,218,917.74	30,334,439.56
其中：基金申购款	66,298,385.11	42,067,386.85	108,365,771.96
基金赎回款	-49,182,863.29	-28,848,469.11	-78,031,332.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	173,429,264.27	72,753,025.88	246,182,290.15

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	208,877.31
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	112,357.13
其他	5,157.81
合计	326,392.25

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	161,755,837.04
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	161,755,837.04

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,122,346,010.56
减：卖出股票成本总额	2,957,964,806.63
减：交易费用	2,625,366.89
买卖股票差价收入	161,755,837.04

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	17.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	92,552.00
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	92,569.41

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	203,468.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	110,900.00
减：应计利息总额	8.61
减：交易费用	8.13
买卖债券差价收入	92,552.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	14,335,752.11

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,129,349.31
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	8,129,349.31

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	47,525,943.84
——股票投资	47,525,943.84
——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	-618,800.00
——权证投资	-
——期货投资	-618,800.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	46,907,143.84

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	955,470.50
合计	955,470.50

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	20,827.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,712.33
存托服务费	166.72
合计	83,214.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30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	4,192,634,697.69	64.68%	-	-

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30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	419,296.28	64.68%	155,111.39	40.38%
关联方名称	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
-	-	-	-	-

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.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,640,932.16	2,068,632.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,348,704.40	783,602.66
应支付基金管理人的净管理费	3,292,227.76	1,285,029.83

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

$$H=E\times 0.8\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	870,174.86	387,868.62

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证500量化增强A	易方达中证500量化增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	346,586.30	346,586.30
中国工商银行	-	58,638.69	58,638.69
广发证券	-	2,754.70	2,754.70
易方达财富	-	6,585.82	6,585.82
合计	-	414,565.51	414,565.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证500量化增强A	易方达中证500量化增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	17,130.32	17,130.32
中国工商银行	-	39,073.81	39,073.81
广发证券	-	1,684.16	1,684.16
合计	-	57,888.29	57,888.29

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对

一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达中证 500 量化增强 A

无。

易方达中证 500 量化增强 C

无。

6.4.10.6 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	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	142,508,147.72	208,877.31	48,021,564.14	92,060.51

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

6.4.10.7 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

2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达中证 500 量化增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 500 量化增强 C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-

				受限						
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	36,359	313,414.58	2,087,733.78	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	3,052	348,782.56	2,066,020.88	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
68880	沐曦	2025-1	9 个月	新股	104.66	768.89	2,197	229,93	1,689,	-

2	股份	2-09		流通受限				8.02	251.33	
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,790	35,227.20	253,267.10	-

6.4.12.1.2 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
113704	春风转债	2026-06-11	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	1,820	182,000.00	182,007.98	-
118070	南芯转债	2026-06-22	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.07	-
118071	华峰转债	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	760	76,000.00	76,001.16	-

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。

6.4.12.2 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
300333	天壕能	2026-06	重大事	4.30	2026-0	4.64	28,300	134,866.66	121,690.00	-

2	源	-26	项停牌		7-09					
688260	昀冢科技	2026-06-26	重大事项停牌	144.00	2026-07-01	132.00	233	8,702.61	33,552.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书“风险揭示”部分。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 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 2026 年 6 月 30 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 0.02%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 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 2026年6月30日	上年度末 2025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。

6.4.13.2.2 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 2026年6月30日	上年度末 2025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

6.4.13.2.3 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 2026年6月30日	上年度末 2025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

6.4.13.2.4 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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	260,009.21	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	260,009.21	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。

6.4.13.2.5 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 2026年6月30日	上年度末 2025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

6.4.13.2.6 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 2026年6月30日	上年度末 2025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

6.4.13.3 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 2026 年 6 月 30 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约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。

6.4.13.3.1 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,组合变现能力较好。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	142,508,147.72	-	-	-	142,508,147.72
结算备付金	16,109,342.41	-	-	-	16,109,342.41

存出保证金	8,560,842.12	-	-	-	8,560,842.12
交易性金融资产	-	-	260,009.21	1,247,939,513.44	1,248,199,522.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	221,435.77	221,435.77
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	17,827,579.20	17,827,579.20
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	167,178,332.25	-	260,009.21	1,265,988,528.41	1,433,426,869.87
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	-	-	-	5,424,911.24	5,424,911.24
应付赎回款	-	-	-	7,375,693.21	7,375,693.21
应付管理人报酬	-	-	-	859,609.91	859,609.91
应付托管费	-	-	-	161,176.88	161,176.88
应付销售服务费	-	-	-	176,899.56	176,899.56
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	481,787.93	481,787.93
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	470,731.94	470,731.94
负债总计	-	-	-	14,950,810.67	14,950,810.67
利率敏感度缺口	167,178,332.25	-	260,009.21	1,251,037,717.74	1,418,476,059.20
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
货币资金	93,838,945.20	-	-	-	93,838,945.20

结算备付金	20,465,659.24	-	-	-	20,465,659.24
存出保证金	7,176,899.72	-	-	-	7,176,899.72
交易性金融资产	-	-	-	794,912,543.65	794,912,543.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	40,825,625.43	40,825,625.43
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,157,303.44	4,157,303.44
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	121,481,504.16	-	-	839,895,472.52	961,376,976.68
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	50,744,236.22	50,744,236.22
应付管理人报酬	-	-	-	571,464.53	571,464.53
应付托管费	-	-	-	107,149.60	107,149.60
应付销售服务费	-	-	-	127,652.44	127,652.44
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	305,300.69	305,300.69
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	366,275.66	366,275.66
负债总计	-	-	-	52,222,079.14	52,222,079.14
利率敏感度缺口	121,481,504.16	-	-	787,673,393.38	909,154,897.54

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。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	1,247,939,513.44	87.98	794,912,543.65	87.43
交易性金融资产—债券投资	260,009.21	0.02	-	-
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	1,248,199,522.65	88.00	794,912,543.65	87.43

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

6.4.13.4.3.2 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	66,194,029.87	39,669,375.38
	2.业绩比较基准下降 5%	-66,194,029.87	-39,669,375.38

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**6.4.14.2.1 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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	1,238,922,322.00
第二层次	425,361.21
第三层次	8,851,839.44
合计	1,248,199,522.65

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,247,939,513.44	87.06
	其中：股票	1,247,939,513.44	87.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	260,009.21	0.02
	其中：债券	260,009.21	0.02
	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	158,617,490.13	11.07
8	其他各项资产	26,609,857.09	1.86
9	合计	1,433,426,869.87	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 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	3,481,820.00	0.25
B	采矿业	34,735,295.20	2.45
C	制造业	788,130,614.94	55.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,891,040.90	1.68
E	建筑业	8,168,412.00	0.58
F	批发和零售业	37,419,022.04	2.64
G	交通运输、仓储和邮政业	11,126,008.70	0.78

H	住宿和餐饮业	1,342,054.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,836,946.00	4.01
J	金融业	42,784,375.48	3.02
K	房地产业	2,865,704.00	0.20
L	租赁和商务服务业	8,879,694.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	6,678,854.48	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	9,402,603.60	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	935,253.64	0.07
R	文化、体育和娱乐业	5,869,244.00	0.41
S	综合	-	-
	合计	1,042,546,942.98	73.50

7.2.1.2 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	501,752.60	0.04
B	采矿业	5,812,005.82	0.41
C	制造业	165,859,594.14	11.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,153,616.10	0.15
E	建筑业	1,209,639.00	0.09
F	批发和零售业	2,111,772.58	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	2,710,474.94	0.19
H	住宿和餐饮业	32,383.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,447,456.31	1.02
J	金融业	2,960,225.20	0.21
K	房地产业	616,548.00	0.04
L	租赁和商务服务业	1,060,136.28	0.07
M	科学研究和技术服务业	3,245,892.33	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,564,007.16	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	817,816.00	0.06
Q	卫生和社会工作	32,956.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	256,295.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	205,392,570.46	14.48

7.3 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

7.3.1 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	688498	源杰科技	12,228	23,062,008.00	1.63
2	001309	德明利	20,400	19,235,160.00	1.36
3	300604	长川科技	55,500	18,948,810.00	1.34
4	300223	北京君正	69,473	17,291,829.70	1.22
5	300857	协创数据	47,220	16,050,078.00	1.13
6	300475	香农芯创	51,700	15,510,000.00	1.09
7	002008	大族激光	91,700	13,765,087.00	0.97
8	002281	光迅科技	49,700	12,769,918.00	0.90
9	688347	华虹宏力	36,838	12,388,619.40	0.87
10	300054	鼎龙股份	103,100	10,925,507.00	0.77
11	688200	华峰测控	20,058	10,532,455.80	0.74
12	688002	睿创微纳	65,770	10,173,961.30	0.72
13	300373	扬杰科技	62,100	9,763,983.00	0.69
14	600601	方正科技	662,800	9,173,152.00	0.65
15	301358	湖南裕能	117,500	8,914,725.00	0.63
16	002738	中矿资源	146,900	8,665,631.00	0.61
17	301536	星辰科技	64,836	8,345,041.56	0.59
18	002436	兴森科技	155,900	7,943,105.00	0.56
19	300548	长芯博创	27,500	7,645,000.00	0.54
20	600105	永鼎股份	110,600	7,463,288.00	0.53
21	300136	信维通信	62,400	7,441,200.00	0.52
22	300073	当升科技	154,878	7,440,339.12	0.52
23	688120	华海清科	22,886	7,373,411.48	0.52
24	002271	东方雨虹	614,000	7,288,180.00	0.51
25	002266	浙富控股	1,400,300	7,085,518.00	0.50
26	000703	恒逸石化	521,500	7,076,755.00	0.50
27	002273	水晶光电	193,200	6,854,736.00	0.48
28	600499	科达制造	487,000	6,720,600.00	0.47
29	688099	晶晨股份	63,068	6,489,697.20	0.46
30	002414	高德红外	482,090	6,392,513.40	0.45

31	002120	韵达股份	995,200	6,329,472.00	0.45
32	600988	赤峰黄金	233,800	6,153,616.00	0.43
33	601233	桐昆股份	284,169	6,152,258.85	0.43
34	603308	应流股份	101,000	6,100,400.00	0.43
35	603659	璞泰来	208,565	6,033,785.45	0.43
36	300458	全志科技	151,860	5,992,395.60	0.42
37	603345	安井食品	74,700	5,990,193.00	0.42
38	300037	新宙邦	63,100	5,858,835.00	0.41
39	600885	宏发股份	169,500	5,846,055.00	0.41
40	002064	华峰化学	610,000	5,788,900.00	0.41
41	688220	翱捷科技	46,418	5,770,685.76	0.41
42	688702	盛科通信	14,680	5,725,053.20	0.40
43	300432	富临精工	282,100	5,667,389.00	0.40
44	600595	中孚实业	997,900	5,608,198.00	0.40
45	000951	中国重汽	285,100	5,562,301.00	0.39
46	600166	福田汽车	1,900,000	5,529,000.00	0.39
47	600109	国金证券	626,600	5,501,548.00	0.39
48	601869	长飞光纤	9,900	5,404,410.00	0.38
49	300972	万辰集团	31,000	5,375,710.00	0.38
50	300953	震裕科技	40,198	5,374,472.60	0.38
51	002756	永兴材料	93,800	5,312,832.00	0.37
52	002465	海格通信	415,300	5,303,381.00	0.37
53	002850	科达利	27,299	5,167,700.70	0.36
54	000683	博源化工	894,200	5,150,592.00	0.36
55	300390	天华新能	55,000	5,143,050.00	0.36
56	300012	华测检测	370,800	5,139,288.00	0.36
57	300567	精测电子	16,045	5,095,892.00	0.36
58	002185	华天科技	227,265	5,070,282.15	0.36
59	002812	恩捷股份	75,300	5,038,323.00	0.36
60	300620	光库科技	13,100	4,954,420.00	0.35
61	002851	麦格米特	29,400	4,915,092.00	0.35
62	301606	绿联科技	80,100	4,887,702.00	0.34
63	688615	合合信息	41,880	4,736,628.00	0.33
64	603699	纽威股份	93,300	4,692,990.00	0.33
65	002841	视源股份	135,300	4,671,909.00	0.33
66	688629	华丰科技	24,911	4,671,061.61	0.33
67	688778	厦钨新能	84,594	4,601,913.60	0.32
68	601699	潞安环能	317,200	4,529,616.00	0.32
69	688361	中科飞测	10,328	4,441,040.00	0.31
70	002487	大金重工	76,600	4,440,502.00	0.31
71	600685	中船防务	173,700	4,418,928.00	0.31
72	001286	陕西能源	431,100	4,371,354.00	0.31
73	300346	南大光电	47,000	4,354,550.00	0.31
74	301377	鼎泰高科	7,900	4,352,110.00	0.31

75	001389	广合科技	17,300	4,104,425.00	0.29
76	688385	复旦微电	57,292	4,084,346.68	0.29
77	600606	绿地控股	3,362,800	4,068,988.00	0.29
78	603233	大参林	270,268	4,062,128.04	0.29
79	600711	盛屯矿业	370,000	4,058,900.00	0.29
80	603939	益丰药房	224,900	4,043,702.00	0.29
81	688313	仕佳光子	21,875	4,039,218.75	0.28
82	688578	艾力斯	36,403	3,975,207.60	0.28
83	002152	广电运通	414,300	3,886,134.00	0.27
84	000415	渤海租赁	941,400	3,831,498.00	0.27
85	600546	山煤国际	348,100	3,804,733.00	0.27
86	601108	财通证券	439,840	3,804,616.00	0.27
87	002603	以岭药业	252,600	3,789,000.00	0.27
88	002402	和而泰	143,900	3,716,937.00	0.26
89	002340	格林美	560,900	3,707,549.00	0.26
90	000783	长江证券	369,100	3,598,725.00	0.25
91	688692	达梦数据	14,706	3,592,528.74	0.25
92	600801	华新建材	229,800	3,584,880.00	0.25
93	300115	长盈精密	127,300	3,556,762.00	0.25
94	300207	欣旺达	184,900	3,511,251.00	0.25
95	603979	金诚信	59,300	3,500,479.00	0.25
96	688052	纳芯微	12,033	3,469,234.23	0.24
97	600535	天士力	261,600	3,460,968.00	0.24
98	600295	鄂尔多斯	318,700	3,416,464.00	0.24
99	603766	隆鑫通用	285,200	3,402,436.00	0.24
100	300957	贝泰妮	107,800	3,396,778.00	0.24
101	002407	多氟多	67,300	3,380,479.00	0.24
102	300395	菲利华	25,200	3,369,996.00	0.24
103	000027	深圳能源	533,700	3,308,940.00	0.23
104	600298	安琪酵母	90,900	3,290,580.00	0.23
105	300496	中科创达	53,250	3,290,317.50	0.23
106	600598	北大荒	303,500	3,289,940.00	0.23
107	600884	杉杉股份	242,700	3,288,585.00	0.23
108	688469	芯联集成	309,170	3,280,293.70	0.23
109	000800	一汽解放	542,200	3,226,090.00	0.23
110	000423	东阿阿胶	70,400	3,193,344.00	0.23
111	002130	沃尔核材	165,600	3,139,776.00	0.22
112	300919	中伟新材	71,200	3,115,000.00	0.22
113	688301	奕瑞科技	24,707	3,063,668.00	0.22
114	603129	春风动力	11,900	3,044,020.00	0.21
115	300474	景嘉微	49,400	2,987,712.00	0.21
116	300002	神州泰岳	380,700	2,973,267.00	0.21
117	688235	百济神州	11,580	2,948,383.80	0.21
118	301200	大族数控	8,100	2,921,265.00	0.21

119	688188	柏楚电子	27,328	2,915,897.60	0.21
120	300757	罗博特科	4,700	2,909,300.00	0.21
121	688017	绿的谐波	6,877	2,873,623.22	0.20
122	000893	亚钾国际	70,000	2,862,300.00	0.20
123	603077	和邦生物	1,212,200	2,812,304.00	0.20
124	002926	华西证券	344,200	2,812,114.00	0.20
125	600378	昊华科技	37,200	2,804,136.00	0.20
126	600995	南网储能	226,500	2,785,950.00	0.20
127	300454	深信服	28,800	2,770,560.00	0.20
128	688475	萤石网络	101,194	2,767,655.90	0.20
129	603444	吉比特	7,700	2,759,834.00	0.19
130	300679	电连技术	45,900	2,753,541.00	0.19
131	000983	山西焦煤	472,600	2,741,080.00	0.19
132	002265	建设工业	157,375	2,738,325.00	0.19
133	002299	圣农发展	172,400	2,613,584.00	0.18
134	600699	均胜电子	119,300	2,578,073.00	0.18
135	688777	中控技术	21,920	2,575,600.00	0.18
136	601608	中信重工	535,800	2,555,766.00	0.18
137	688676	金盘科技	30,128	2,550,033.92	0.18
138	300285	国瓷材料	24,700	2,548,546.00	0.18
139	000039	中集集团	311,500	2,526,265.00	0.18
140	600380	健康元	267,200	2,517,024.00	0.18
141	002131	利欧股份	523,400	2,486,150.00	0.18
142	000155	川能动力	205,000	2,455,900.00	0.17
143	000629	钒钛股份	724,800	2,420,832.00	0.17
144	002966	苏州银行	347,461	2,418,328.56	0.17
145	000062	深圳华强	76,000	2,418,320.00	0.17
146	002078	太阳纸业	193,400	2,415,566.00	0.17
147	003031	中瓷电子	13,300	2,397,990.00	0.17
148	603379	三美股份	31,533	2,393,039.37	0.17
149	603256	宏和科技	8,900	2,361,437.00	0.17
150	300748	金力永磁	76,300	2,353,855.00	0.17
151	600909	华安证券	207,900	2,309,769.00	0.16
152	600563	法拉电子	12,000	2,289,600.00	0.16
153	600486	扬农化工	45,118	2,287,482.60	0.16
154	600901	江苏金租	397,500	2,285,625.00	0.16
155	688728	格科微	108,228	2,277,117.12	0.16
156	600153	建发股份	283,000	2,244,190.00	0.16
157	300383	光环新网	179,200	2,229,248.00	0.16
158	688617	惠泰医疗	12,200	2,215,032.00	0.16
159	601555	东吴证券	279,300	2,212,056.00	0.16
160	003022	联泓新科	85,300	2,209,270.00	0.16
161	600566	济川药业	99,500	2,207,905.00	0.16
162	002153	石基信息	304,400	2,200,812.00	0.16

163	601212	白银有色	432,200	2,195,576.00	0.15
164	601139	深圳燃气	383,800	2,172,308.00	0.15
165	600927	永安期货	173,800	2,163,810.00	0.15
166	603338	浙江鼎力	50,400	2,142,000.00	0.15
167	002032	苏泊尔	54,000	2,138,400.00	0.15
168	601098	中南传媒	217,000	2,135,280.00	0.15
169	000959	首钢股份	593,900	2,084,589.00	0.15
170	688180	君实生物	61,535	2,081,113.70	0.15
171	600655	豫园股份	495,200	2,035,272.00	0.14
172	601019	山东出版	316,300	2,024,320.00	0.14
173	600143	金发科技	127,400	1,968,330.00	0.14
174	603786	科博达	47,800	1,955,498.00	0.14
175	601106	中国一重	591,000	1,950,300.00	0.14
176	600060	海信视像	69,500	1,936,965.00	0.14
177	603486	科沃斯	38,100	1,933,575.00	0.14
178	600765	中航重机	148,500	1,918,620.00	0.14
179	688295	中复神鹰	31,355	1,898,231.70	0.13
180	688336	三生国健	35,319	1,875,438.90	0.13
181	000034	神州数码	67,500	1,873,125.00	0.13
182	600332	白云山	93,200	1,867,728.00	0.13
183	001203	大中矿业	62,000	1,856,900.00	0.13
184	000709	河钢股份	954,100	1,850,954.00	0.13
185	688772	珠海冠宇	93,930	1,843,845.90	0.13
186	600316	洪都航空	65,700	1,835,658.00	0.13
187	601991	大唐发电	258,900	1,833,012.00	0.13
188	002430	杭氧股份	58,400	1,808,064.00	0.13
189	002683	广东宏大	61,200	1,792,548.00	0.13
190	300666	江丰电子	4,800	1,769,280.00	0.12
191	300718	长盛轴承	29,000	1,768,130.00	0.12
192	600390	五矿资本	380,300	1,734,168.00	0.12
193	000733	振华科技	30,600	1,733,184.00	0.12
194	600808	马钢股份	687,700	1,719,250.00	0.12
195	688065	凯赛生物	35,748	1,710,541.80	0.12
196	600967	内蒙一机	157,600	1,709,960.00	0.12
197	600299	安迪苏	215,300	1,690,105.00	0.12
198	002244	滨江集团	222,200	1,688,720.00	0.12
199	002423	中粮资本	203,400	1,673,982.00	0.12
200	689009	九号公司	43,844	1,672,648.60	0.12
201	000050	深天马 A	167,800	1,662,898.00	0.12
202	000729	燕京啤酒	163,300	1,654,229.00	0.12
203	000598	兴蓉环境	257,400	1,652,508.00	0.12
204	600352	浙江龙盛	135,500	1,640,905.00	0.12
205	601611	中国核建	145,900	1,626,785.00	0.11
206	688037	芯源微	3,705	1,626,680.25	0.11

207	600602	云赛智联	100,500	1,616,040.00	0.11
208	002831	裕同科技	45,237	1,608,627.72	0.11
209	000739	普洛药业	96,400	1,606,024.00	0.11
210	002126	银轮股份	32,200	1,603,560.00	0.11
211	600170	上海建工	718,600	1,595,292.00	0.11
212	601128	常熟银行	269,584	1,568,978.88	0.11
213	000997	新大陆	96,200	1,568,060.00	0.11
214	603899	晨光股份	75,800	1,563,754.00	0.11
215	000738	航发控制	82,400	1,507,096.00	0.11
216	603596	伯特利	60,384	1,499,938.56	0.11
217	600498	烽火通信	20,100	1,479,360.00	0.10
218	000830	鲁西化工	119,600	1,435,200.00	0.10
219	688166	博瑞医药	40,499	1,417,869.99	0.10
220	601399	国机重装	404,400	1,415,400.00	0.10
221	600339	中油工程	455,800	1,399,306.00	0.10
222	002410	广联达	169,800	1,385,568.00	0.10
223	688019	安集科技	4,032	1,368,702.72	0.10
224	600578	京能电力	211,400	1,363,530.00	0.10
225	600132	重庆啤酒	32,700	1,350,510.00	0.10
226	600754	锦江酒店	74,600	1,342,054.00	0.09
227	300627	华测导航	46,600	1,323,440.00	0.09
228	688172	燕东微	15,638	1,308,275.08	0.09
229	002568	百润股份	76,700	1,297,764.00	0.09
230	688322	奥比中光	9,934	1,296,883.70	0.09
231	002429	兆驰股份	124,500	1,293,555.00	0.09
232	601156	东航物流	78,900	1,271,868.00	0.09
233	688375	国博电子	12,103	1,262,342.90	0.09
234	600398	海澜之家	237,600	1,242,648.00	0.09
235	002138	顺络电子	16,900	1,235,390.00	0.09
236	688169	石头科技	13,003	1,234,894.91	0.09
237	300003	乐普医疗	102,900	1,219,365.00	0.09
238	000883	湖北能源	281,600	1,216,512.00	0.09
239	600098	广州发展	203,400	1,202,094.00	0.08
240	000932	华菱钢铁	341,300	1,184,311.00	0.08
241	601865	福莱特	111,900	1,176,069.00	0.08
242	300888	稳健医疗	41,700	1,167,183.00	0.08
243	688331	荣昌生物	8,933	1,163,612.58	0.08
244	688387	信科移动	58,363	1,157,921.92	0.08
245	688561	奇安信	47,588	1,141,160.24	0.08
246	000519	中兵红箭	53,900	1,135,673.00	0.08
247	300140	节能环保	225,800	1,122,226.00	0.08
248	601665	齐鲁银行	192,600	1,111,302.00	0.08
249	600521	华海药业	76,700	1,104,480.00	0.08
250	300763	锦浪科技	12,100	1,093,235.00	0.08

251	601997	贵阳银行	212,200	1,088,586.00	0.08
252	603806	福斯特	63,800	1,071,202.00	0.08
253	002155	湖南黄金	44,840	1,070,330.80	0.08
254	688297	中无人机	25,424	1,056,367.20	0.07
255	002195	岩山科技	161,300	1,054,902.00	0.07
256	603728	鸣志电器	17,300	1,053,916.00	0.07
257	603225	新凤鸣	53,500	1,051,275.00	0.07
258	002500	山西证券	198,500	1,024,260.00	0.07
259	300623	捷捷微电	22,700	1,021,273.00	0.07
260	002472	双环传动	24,500	1,016,995.00	0.07
261	603737	三棵树	41,980	1,011,718.00	0.07
262	600998	九州通	214,900	1,007,881.00	0.07
263	002461	珠江啤酒	129,900	983,343.00	0.07
264	300677	英科医疗	25,100	983,167.00	0.07
265	002444	巨星科技	31,000	964,100.00	0.07
266	000831	中国稀土	17,300	959,977.00	0.07
267	688281	华秦科技	19,106	959,694.38	0.07
268	000750	国海证券	260,500	958,640.00	0.07
269	601696	中银证券	75,000	948,750.00	0.07
270	688018	乐鑫科技	7,398	946,352.16	0.07
271	300017	网宿科技	71,000	923,710.00	0.07
272	600292	电投水电	75,200	905,408.00	0.06
273	300759	康龙化成	31,200	902,616.00	0.06
274	601577	长沙银行	103,200	898,872.00	0.06
275	600871	石化油服	439,900	892,997.00	0.06
276	600177	雅戈尔	117,300	883,269.00	0.06
277	601000	唐山港	209,500	869,425.00	0.06
278	000513	丽珠集团	30,000	866,700.00	0.06
279	600329	达仁堂	22,800	848,616.00	0.06
280	600100	同方股份	122,200	837,070.00	0.06
281	688608	恒玄科技	4,995	835,114.05	0.06
282	000528	柳工	108,100	816,155.00	0.06
283	000987	越秀资本	102,100	798,422.00	0.06
284	002797	第一创业	120,000	788,400.00	0.06
285	300001	特锐德	20,500	775,515.00	0.05
286	000786	北新建材	42,400	767,016.00	0.05
287	600511	国药股份	29,100	757,764.00	0.05
288	300142	沃森生物	58,300	757,317.00	0.05
289	600977	中国电影	58,400	754,528.00	0.05
290	688599	天合光能	51,759	730,837.08	0.05
291	000021	深科技	11,300	726,251.00	0.05
292	601298	青岛港	89,000	716,450.00	0.05
293	600497	驰宏锌锗	58,400	707,224.00	0.05
294	603529	爱玛科技	36,000	702,360.00	0.05

295	300146	汤臣倍健	76,100	687,944.00	0.05
296	300699	光威复材	23,900	684,735.00	0.05
297	600879	航天电子	31,300	666,377.00	0.05
298	603179	新泉股份	13,400	665,310.00	0.05
299	301526	国际复材	14,200	662,714.00	0.05
300	603858	步长制药	45,100	658,460.00	0.05
301	301498	乖宝宠物	16,200	657,558.00	0.05
302	600562	国睿科技	30,900	655,698.00	0.05
303	000878	云南铜业	41,200	654,256.00	0.05
304	688192	迪哲医药	16,355	653,055.15	0.05
305	600663	陆家嘴	102,300	642,444.00	0.05
306	300144	宋城演艺	108,300	629,223.00	0.04
307	603606	东方电缆	15,120	627,631.20	0.04
308	600348	华阳股份	81,700	625,005.00	0.04
309	600038	中直股份	24,200	612,018.00	0.04
310	600256	广汇能源	123,800	611,572.00	0.04
311	600062	华润双鹤	37,900	607,916.00	0.04
312	600312	平高电气	34,400	607,504.00	0.04
313	601198	东兴证券	44,200	600,678.00	0.04
314	002025	航天电器	7,800	594,516.00	0.04
315	002085	万丰奥威	53,400	592,206.00	0.04
316	603920	世运电路	12,200	586,088.00	0.04
317	600536	中国软件	20,500	576,460.00	0.04
318	600004	白云机场	79,245	575,318.70	0.04
319	002945	华林证券	42,800	574,804.00	0.04
320	300735	光弘科技	24,100	548,034.00	0.04
321	002065	东华软件	76,700	547,638.00	0.04
322	300751	迈为股份	1,900	536,674.00	0.04
323	000887	中鼎股份	29,900	534,911.00	0.04
324	688122	西部超导	8,440	530,116.40	0.04
325	300487	蓝晓科技	9,000	529,650.00	0.04
326	603658	安图生物	17,750	515,105.00	0.04
327	601615	明阳智能	43,900	507,923.00	0.04
328	603156	养元饮品	10,300	505,421.00	0.04
329	000937	冀中能源	122,130	486,077.40	0.03
330	002044	美年健康	96,500	485,395.00	0.03
331	300676	华大基因	13,600	476,816.00	0.03
332	002252	上海莱士	106,100	460,474.00	0.03
333	002673	西部证券	70,600	458,194.00	0.03
334	600763	通策医疗	13,278	449,858.64	0.03
335	600282	南钢股份	97,700	448,443.00	0.03
336	600970	中材国际	61,800	440,634.00	0.03
337	603298	杭叉集团	18,400	439,024.00	0.03
338	600642	申能股份	49,800	434,754.00	0.03

339	688343	云天励飞	5,269	430,266.54	0.03
340	002821	凯莱英	2,500	405,000.00	0.03
341	300724	捷佳伟创	5,600	395,360.00	0.03
342	300558	贝达药业	6,000	390,420.00	0.03
343	000825	太钢不锈	113,300	386,353.00	0.03
344	603160	汇顶科技	6,200	382,602.00	0.03
345	600637	东方明珠	45,700	379,767.00	0.03
346	600968	海油发展	114,000	379,620.00	0.03
347	601216	君正集团	84,400	376,424.00	0.03
348	600369	西南证券	91,000	365,820.00	0.03
349	600126	杭钢股份	59,300	363,509.00	0.03
350	688187	时代电气	5,290	363,211.40	0.03
351	600008	首创环保	131,900	358,768.00	0.03
352	600483	福能股份	35,010	356,751.90	0.03
353	688538	和辉光电	135,560	352,456.00	0.02
354	688234	天岳先进	2,027	351,704.77	0.02
355	600764	中国海防	19,800	345,114.00	0.02
356	600208	衢州发展	120,600	341,298.00	0.02
357	603087	甘李药业	6,000	340,560.00	0.02
358	603290	斯达半导	2,200	336,468.00	0.02
359	600704	物产中大	71,000	335,120.00	0.02
360	301301	川宁生物	40,300	319,982.00	0.02
361	002223	鱼跃医疗	12,400	318,184.00	0.02
362	300058	蓝色光标	23,100	317,856.00	0.02
363	002939	长城证券	36,900	307,746.00	0.02
364	601598	中国外运	61,800	306,528.00	0.02
365	002601	龙佰集团	18,500	304,880.00	0.02
366	002318	久立特材	12,700	303,530.00	0.02
367	600737	中粮糖业	23,900	294,687.00	0.02
368	603568	伟明环保	18,820	289,451.60	0.02
369	688349	三一重能	19,053	289,224.54	0.02
370	603688	石英股份	3,400	280,874.00	0.02
371	600820	隧道股份	50,300	262,063.00	0.02
372	002432	九安医疗	3,700	261,516.00	0.02
373	603833	欧派家居	8,500	255,935.00	0.02
374	600985	淮北矿业	17,200	241,660.00	0.02
375	688114	华大智造	4,694	239,769.52	0.02
376	601928	凤凰传媒	26,700	234,693.00	0.02
377	601228	广州港	80,700	227,574.00	0.02
378	603341	龙旗科技	5,300	225,197.00	0.02
379	601880	辽港股份	150,500	207,690.00	0.01
380	688318	财富趋势	2,890	206,085.90	0.01
381	688027	国盾量子	408	205,636.08	0.01
382	600131	国网信通	13,800	201,480.00	0.01

383	000960	锡业股份	4,700	200,643.00	0.01
384	601236	红塔证券	29,400	200,508.00	0.01
385	688411	海博思创	684	199,180.80	0.01
386	601567	三星电气	13,100	195,714.00	0.01
387	688363	华熙生物	5,432	194,302.64	0.01
388	600848	上海临港	25,800	193,242.00	0.01
389	601118	海南橡胶	39,000	191,880.00	0.01
390	688819	天能股份	8,561	190,054.20	0.01
391	600583	海油工程	37,500	188,625.00	0.01
392	600517	国网英大	40,000	187,200.00	0.01
393	002335	科华数据	4,200	178,290.00	0.01
394	000032	深桑达 A	7,000	174,650.00	0.01
395	600350	山东高速	15,300	170,289.00	0.01
396	000582	北部湾港	15,700	168,461.00	0.01
397	600392	盛和资源	5,500	163,735.00	0.01
398	603049	中策橡胶	3,600	161,316.00	0.01
399	688278	特宝生物	2,806	152,646.40	0.01
400	603589	口子窖	8,000	149,440.00	0.01
401	600095	湘财股份	19,500	146,835.00	0.01
402	600582	天地科技	32,800	145,960.00	0.01
403	603605	珀莱雅	2,400	143,808.00	0.01
404	000559	万向钱潮	11,100	143,523.00	0.01
405	000591	太阳能	30,000	138,000.00	0.01
406	600688	上海石化	46,800	137,124.00	0.01
407	600862	中航高科	7,600	137,028.00	0.01
408	002608	江苏国信	19,500	134,550.00	0.01
409	688563	航材股份	2,609	133,659.07	0.01
410	002984	森麒麟	10,000	130,700.00	0.01
411	601666	平煤股份	18,000	128,700.00	0.01
412	601808	中海油服	11,700	126,477.00	0.01
413	002007	华兰生物	10,300	125,557.00	0.01
414	600141	兴发集团	2,500	117,425.00	0.01
415	603175	超颖电子	1,300	115,817.00	0.01
416	601717	中创智领	7,800	108,498.00	0.01
417	002056	横店东磁	3,200	97,536.00	0.01
418	688520	神州细胞	2,780	95,103.80	0.01
419	000728	国元证券	12,196	91,348.04	0.01
420	002739	儒意电影	9,500	91,200.00	0.01
421	001696	宗申动力	4,300	89,483.00	0.01
422	003035	南网能源	15,200	88,464.00	0.01
423	601001	晋控煤业	4,900	85,211.00	0.01
424	001221	悍高集团	2,100	84,462.00	0.01
425	600435	北方导航	7,300	81,760.00	0.01
426	001386	马可波罗	5,700	80,712.00	0.01

427	688582	芯动联科	1,177	76,505.00	0.01
428	603119	浙江荣泰	1,140	75,627.60	0.01
429	603565	中谷物流	7,600	74,556.00	0.01
430	688248	南网科技	1,036	71,670.48	0.01
431	688568	中科星图	1,727	71,618.69	0.01
432	601099	太平洋	20,000	67,400.00	0.00
433	601958	金钼股份	2,200	61,842.00	0.00
434	000088	盐田港	14,700	60,123.00	0.00
435	603000	人民网	4,000	59,160.00	0.00
436	002262	恩华药业	3,100	58,125.00	0.00
437	002312	川发龙蟒	6,300	57,771.00	0.00
438	603885	吉祥航空	5,300	54,537.00	0.00
439	601966	玲珑轮胎	5,200	52,988.00	0.00
440	000429	粤高速 A	3,700	50,505.00	0.00
441	002508	老板电器	3,400	49,708.00	0.00
442	688709	成都华微	1,264	48,145.76	0.00
443	000400	许继电气	2,100	45,570.00	0.00
444	600873	梅花生物	6,000	44,100.00	0.00
445	002203	海亮股份	1,900	43,415.00	0.00
446	000921	海信家电	1,500	40,980.00	0.00
447	603092	德力佳	746	40,261.62	0.00
448	600906	财达证券	5,300	39,538.00	0.00
449	688708	佳驰科技	769	39,065.20	0.00
450	600161	天坛生物	3,100	35,898.00	0.00
451	002773	康弘药业	1,700	34,765.00	0.00
452	600021	上海电力	2,300	34,661.00	0.00
453	000661	长春高新	500	33,300.00	0.00
454	601162	天风证券	9,600	32,352.00	0.00
455	000723	美锦能源	9,300	31,155.00	0.00
456	688425	铁建重工	7,458	29,981.16	0.00
457	600171	上海贝岭	900	28,746.00	0.00
458	600516	方大炭素	4,600	28,382.00	0.00
459	601866	中远海发	11,700	25,857.00	0.00
460	000539	粤电力 A	3,700	25,197.00	0.00
461	000898	鞍钢股份	11,300	21,131.00	0.00
462	601016	节能风电	5,400	20,952.00	0.00
463	000537	绿发电力	2,400	17,544.00	0.00
464	003021	兆威机电	200	17,470.00	0.00
465	600377	宁沪高速	1,500	17,355.00	0.00
466	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
467	002670	国盛证券	1,000	11,000.00	0.00
468	600032	浙江新能	1,100	7,755.00	0.00

7.3.2 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	600549	厦门钨业	56,400	4,805,280.00	0.34
2	002080	中材科技	41,000	3,690,000.00	0.26
3	300750	宁德时代	7,800	3,065,478.00	0.22
4	688390	固德威	26,885	2,917,291.35	0.21
5	600487	亨通光电	25,300	2,766,302.00	0.20
6	300308	中际旭创	2,000	2,540,000.00	0.18
7	603061	金海通	4,880	2,450,833.60	0.17
8	003018	金富科技	30,600	2,332,638.00	0.16
9	600259	中稀有色	22,600	2,296,386.00	0.16
10	002993	奥海科技	30,100	2,155,461.00	0.15
11	688630	芯碁微装	3,885	2,134,380.15	0.15
12	301308	江波龙	3,000	2,111,400.00	0.15
13	688783	西安奕材	36,359	2,087,733.78	0.15
14	688795	摩尔线程	3,052	2,066,020.88	0.15
15	688503	聚和材料	14,541	1,929,590.70	0.14
16	688372	伟测科技	9,413	1,750,818.00	0.12
17	300489	光智科技	5,500	1,715,725.00	0.12
18	688388	嘉元科技	38,501	1,694,044.00	0.12
19	688802	沐曦股份	2,197	1,689,251.33	0.12
20	688536	思瑞浦	4,622	1,682,823.98	0.12
21	002484	江海股份	15,700	1,648,500.00	0.12
22	688275	万润新能	12,910	1,646,670.50	0.12
23	000933	神火股份	77,300	1,638,760.00	0.12
24	688256	寒武纪	1,013	1,616,292.15	0.11
25	300491	通合科技	40,600	1,550,514.00	0.11
26	002558	巨人网络	55,000	1,515,800.00	0.11
27	603713	密尔克卫	21,200	1,508,804.00	0.11
28	300382	斯莱克	65,000	1,502,150.00	0.11
29	300438	鹏辉能源	17,900	1,483,015.00	0.10
30	600150	中国船舶	43,700	1,476,623.00	0.10
31	002956	西麦食品	69,998	1,453,158.48	0.10
32	300671	富满微	16,700	1,438,872.00	0.10
33	603876	鼎胜新材	55,100	1,433,151.00	0.10
34	300584	海辰药业	38,600	1,398,478.00	0.10
35	601126	四方股份	22,100	1,396,720.00	0.10
36	300681	英搏尔	48,000	1,373,760.00	0.10
37	300900	广联航空	34,900	1,346,093.00	0.09
38	301031	中熔电气	11,123	1,328,642.35	0.09
39	002415	海康威视	38,500	1,316,700.00	0.09

40	688183	生益电子	9,842	1,303,080.80	0.09
41	002709	天赐材料	25,300	1,301,179.00	0.09
42	600522	中天科技	21,400	1,298,552.00	0.09
43	688807	优迅股份	3,182	1,280,532.26	0.09
44	002329	皇氏集团	477,500	1,274,925.00	0.09
45	603678	火炬电子	15,200	1,261,600.00	0.09
46	688700	东威科技	14,080	1,258,752.00	0.09
47	688090	瑞松科技	11,676	1,242,910.20	0.09
48	300745	欣锐科技	29,200	1,232,824.00	0.09
49	603826	坤彩科技	47,800	1,221,768.00	0.09
50	301592	六九一二	9,100	1,204,385.00	0.08
51	300547	川环科技	36,000	1,202,040.00	0.08
52	603886	元祖股份	93,600	1,196,208.00	0.08
53	603317	天味食品	91,600	1,191,716.00	0.08
54	002865	钧达股份	19,700	1,175,696.00	0.08
55	688661	和林微纳	7,362	1,170,410.76	0.08
56	605376	博迁新材	4,300	1,166,590.00	0.08
57	600343	航天动力	41,500	1,162,830.00	0.08
58	301511	德福科技	8,000	1,150,800.00	0.08
59	688160	步科股份	10,572	1,149,916.44	0.08
60	688110	东芯股份	5,590	1,138,683.00	0.08
61	688697	纽威数控	83,039	1,128,500.01	0.08
62	300693	盛弘股份	23,100	1,126,125.00	0.08
63	002452	长高电气	87,900	1,122,483.00	0.08
64	601168	西部矿业	41,000	1,112,740.00	0.08
65	300593	新雷能	36,800	1,106,208.00	0.08
66	002128	电投能源	47,400	1,095,888.00	0.08
67	002861	瀛通通讯	48,700	1,085,036.00	0.08
68	002975	博杰股份	7,600	1,079,200.00	0.08
69	300401	花园生物	49,300	1,079,177.00	0.08
70	688663	新风光	12,070	1,067,712.20	0.08
71	002048	宁波华翔	46,200	1,062,600.00	0.07
72	688551	科威尔	15,044	1,057,141.88	0.07
73	688775	影石创新	7,587	1,051,937.55	0.07
74	688662	富信科技	6,092	1,023,456.00	0.07
75	301196	唯科科技	8,110	1,017,156.20	0.07
76	002497	雅化集团	49,400	1,006,278.00	0.07
77	601963	重庆银行	98,800	995,904.00	0.07
78	300776	帝尔激光	4,600	988,816.00	0.07
79	300573	兴齐眼药	23,542	959,571.92	0.07
80	002294	信立泰	29,900	953,511.00	0.07
81	002832	比音勒芬	46,000	949,440.00	0.07
82	300014	亿纬锂能	14,600	949,438.00	0.07
83	688045	必易微	11,749	949,084.22	0.07

84	000973	佛塑科技	65,800	944,230.00	0.07
85	300870	欧陆通	2,700	933,363.00	0.07
86	688153	唯捷创芯	28,887	927,850.44	0.07
87	301162	国能日新	21,140	924,875.00	0.07
88	603315	福鞍股份	60,100	900,298.00	0.06
89	000807	云铝股份	40,500	896,670.00	0.06
90	688063	派能科技	15,989	851,734.03	0.06
91	688146	中船特气	2,370	829,476.30	0.06
92	688525	佰维存储	1,662	822,241.26	0.06
93	605098	行动教育	15,100	817,816.00	0.06
94	688486	龙迅股份	12,783	812,743.14	0.06
95	300502	新易盛	1,288	781,816.00	0.06
96	688766	普冉股份	1,017	779,632.20	0.05
97	002293	罗莱生活	67,000	662,630.00	0.05
98	688257	新锐股份	6,329	644,925.10	0.05
99	688221	前沿生物	28,649	641,737.60	0.05
100	300590	移为通信	44,700	641,445.00	0.05
101	601628	中国人寿	17,500	618,625.00	0.04
102	301529	福赛科技	6,340	610,922.40	0.04
103	301219	腾远钴业	10,590	580,332.00	0.04
104	603986	兆易创新	700	570,500.00	0.04
105	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
106	002039	黔源电力	29,800	560,836.00	0.04
107	600971	恒源煤电	78,000	538,200.00	0.04
108	000553	安道麦 A	99,400	531,790.00	0.04
109	002595	豪迈科技	11,345	528,677.00	0.04
110	688095	福昕软件	7,210	428,490.30	0.03
111	688059	华锐精密	2,101	419,590.71	0.03
112	688378	奥来德	6,366	394,692.00	0.03
113	688717	艾罗能源	4,678	386,262.46	0.03
114	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.03
115	603929	亚翔集成	1,400	380,828.00	0.03
116	000589	贵州轮胎	92,800	376,768.00	0.03
117	301110	青木科技	9,760	369,513.60	0.03
118	688311	盟升电子	13,829	362,181.51	0.03
119	002833	弘亚数控	18,300	353,007.00	0.02
120	002793	罗欣药业	90,400	347,136.00	0.02
121	301090	华润材料	55,000	344,850.00	0.02
122	002545	东方铁塔	20,600	334,132.00	0.02
123	300450	先导智能	7,700	313,544.00	0.02
124	301345	涛涛车业	1,300	300,300.00	0.02
125	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.02
126	002463	沪电股份	1,900	290,320.00	0.02
127	002468	申通快递	19,800	288,288.00	0.02

128	688111	金山办公	1,312	279,521.60	0.02
129	603223	恒通股份	21,400	279,270.00	0.02
130	688416	恒烁股份	1,965	275,100.00	0.02
131	300323	华灿光电	13,200	269,280.00	0.02
132	600590	泰豪科技	26,500	267,650.00	0.02
133	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
134	603390	通达电气	25,200	263,088.00	0.02
135	300358	楚天科技	32,800	262,400.00	0.02
136	002593	日上集团	64,800	258,552.00	0.02
137	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
138	688820	盛合晶微	1,790	253,267.10	0.02
139	600030	中信证券	8,800	252,824.00	0.02
140	301189	奥尼电子	4,180	246,327.40	0.02
141	603093	南华期货	13,200	239,580.00	0.02
142	603626	科森科技	12,700	234,950.00	0.02
143	601789	宁波建工	57,800	231,778.00	0.02
144	300511	雪榕生物	45,700	229,871.00	0.02
145	000408	藏格矿业	3,300	228,756.00	0.02
146	603178	圣龙股份	16,500	228,525.00	0.02
147	603707	健友股份	32,000	226,240.00	0.02
148	601728	中国电信	43,400	225,246.00	0.02
149	301608	博实结	4,480	225,164.80	0.02
150	000402	金融街	93,300	224,853.00	0.02
151	000565	渝三峡 A	38,700	219,816.00	0.02
152	300661	圣邦股份	1,500	215,220.00	0.02
153	600961	株冶集团	6,600	213,774.00	0.02
154	002562	兄弟科技	49,000	213,150.00	0.02
155	301101	明月镜片	7,800	212,472.00	0.01
156	002838	道恩股份	6,900	211,278.00	0.01
157	603893	瑞芯微	1,100	207,196.00	0.01
158	000938	紫光股份	7,100	204,906.00	0.01
159	000810	创维数字	15,300	202,725.00	0.01
160	002154	报喜鸟	56,200	200,072.00	0.01
161	605117	德业股份	1,800	191,124.00	0.01
162	002628	成都路桥	35,400	189,390.00	0.01
163	600216	浙江医药	16,600	189,240.00	0.01
164	000682	东方电子	14,600	184,398.00	0.01
165	002757	南兴股份	10,200	184,110.00	0.01
166	300442	润泽科技	2,200	182,754.00	0.01
167	002722	物产金轮	15,400	181,566.00	0.01
168	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
169	688719	爱科赛博	2,321	178,717.00	0.01
170	300613	富瀚微	2,200	176,176.00	0.01
171	688472	阿特斯	16,207	175,359.74	0.01

172	002115	三维通信	16,700	172,010.00	0.01
173	301232	飞沃科技	1,100	169,345.00	0.01
174	000676	智度股份	32,900	168,119.00	0.01
175	600176	中国巨石	2,300	167,624.00	0.01
176	300408	三环集团	1,000	166,900.00	0.01
177	301349	信德新材	2,260	166,336.00	0.01
178	301217	铜冠铜箔	1,000	165,070.00	0.01
179	603901	永创智能	14,800	160,876.00	0.01
180	300236	上海新阳	1,200	157,800.00	0.01
181	688143	长盈通	896	157,588.48	0.01
182	688102	斯瑞新材	3,339	157,534.02	0.01
183	300768	迪普科技	11,400	156,978.00	0.01
184	300789	唐源电气	8,800	156,376.00	0.01
185	688151	华强科技	10,404	154,707.48	0.01
186	688800	瑞可达	1,608	154,319.76	0.01
187	688809	强一股份	247	153,881.00	0.01
188	300233	金城医药	12,400	153,760.00	0.01
189	000779	甘咨询	19,700	153,463.00	0.01
190	688448	磁谷科技	2,412	153,306.72	0.01
191	603380	易德龙	3,400	153,306.00	0.01
192	300786	国林科技	6,100	152,927.00	0.01
193	002301	齐心集团	21,100	152,553.00	0.01
194	301048	金鹰重工	17,700	152,397.00	0.01
195	300596	利安隆	2,900	152,192.00	0.01
196	603025	大豪科技	11,100	151,404.00	0.01
197	603579	荣泰健康	8,900	151,033.00	0.01
198	002365	永安药业	14,900	150,788.00	0.01
199	603719	良品铺子	17,400	150,510.00	0.01
200	605136	丽人丽妆	21,100	150,443.00	0.01
201	603066	音飞储存	15,400	150,304.00	0.01
202	688553	汇宇制药	14,126	150,159.38	0.01
203	600333	长春燃气	29,900	150,098.00	0.01
204	600429	三元股份	37,100	149,884.00	0.01
205	600081	东风科技	16,500	149,820.00	0.01
206	605133	嵘泰股份	3,800	149,606.00	0.01
207	601121	宝地矿业	26,500	149,460.00	0.01
208	301136	招标股份	13,600	149,328.00	0.01
209	603071	物产环能	13,500	149,310.00	0.01
210	688396	华润微	1,530	149,251.50	0.01
211	300281	金明精机	24,700	148,941.00	0.01
212	603706	东方环宇	8,600	148,694.00	0.01
213	300865	大宏立	6,800	148,580.00	0.01
214	688041	海光信息	401	148,490.30	0.01
215	601368	绿城水务	36,300	148,467.00	0.01

216	002799	环球印务	24,500	148,225.00	0.01
217	300388	节能国祯	24,000	148,080.00	0.01
218	000626	远大控股	23,300	147,489.00	0.01
219	605138	盛泰集团	26,700	147,384.00	0.01
220	002274	华昌化工	31,800	147,234.00	0.01
221	301216	万凯新材	6,400	147,136.00	0.01
222	603076	乐惠国际	7,100	147,112.00	0.01
223	002863	今飞凯达	34,600	146,704.00	0.01
224	001313	粤海饲料	20,600	146,054.00	0.01
225	300079	数码视讯	34,700	145,740.00	0.01
226	688359	三孚新科	733	145,456.52	0.01
227	688716	中研股份	4,622	145,269.46	0.01
228	000570	苏常柴 A	31,100	145,237.00	0.01
229	603127	昭衍新药	3,800	145,236.00	0.01
230	600569	安阳钢铁	87,300	144,918.00	0.01
231	600325	华发股份	62,700	144,837.00	0.01
232	603799	华友钴业	3,000	144,780.00	0.01
233	300137	先河环保	8,300	144,752.00	0.01
234	600063	皖维高新	19,000	144,400.00	0.01
235	002876	三利谱	4,100	144,361.00	0.01
236	300327	中颖电子	4,500	144,225.00	0.01
237	600152	维科技术	14,400	143,856.00	0.01
238	603439	三力制药	11,400	143,754.00	0.01
239	688627	精智达	201	143,715.00	0.01
240	603191	望变电气	9,100	143,689.00	0.01
241	002108	沧州明珠	34,700	143,658.00	0.01
242	600717	天津港	36,900	143,541.00	0.01
243	001283	豪鹏科技	2,900	142,158.00	0.01
244	603686	福龙马	11,000	142,120.00	0.01
245	002666	德联集团	35,700	141,015.00	0.01
246	688678	福立旺	5,777	139,630.09	0.01
247	603063	禾望电气	2,600	137,514.00	0.01
248	300132	青松股份	24,000	136,320.00	0.01
249	300568	星源材质	7,200	134,784.00	0.01
250	301086	鸿富瀚	640	133,939.20	0.01
251	688008	澜起科技	432	133,876.80	0.01
252	300563	神宇股份	4,700	133,433.00	0.01
253	300580	贝斯特	6,600	132,726.00	0.01
254	688456	有研粉材	950	132,620.00	0.01
255	688545	兴福电子	994	132,261.64	0.01
256	688139	海尔生物	4,985	131,703.70	0.01
257	002843	泰嘉股份	6,100	130,967.00	0.01
258	688328	深科达	1,353	129,482.10	0.01
259	301368	丰立智能	3,100	129,053.00	0.01

260	600482	中国动力	3,900	127,920.00	0.01
261	688049	炬芯科技	2,713	127,266.83	0.01
262	688337	普源精电	1,698	127,231.14	0.01
263	688981	中芯国际	801	127,214.82	0.01
264	300963	中洲特材	9,400	126,242.00	0.01
265	002338	奥普光电	2,200	125,840.00	0.01
266	600460	士兰微	2,300	125,718.00	0.01
267	688610	埃科光电	476	125,378.40	0.01
268	688208	道通科技	4,974	125,295.06	0.01
269	002134	天津普林	4,100	124,722.00	0.01
270	300049	福瑞医科	3,200	124,416.00	0.01
271	688609	九联科技	11,266	124,038.66	0.01
272	600619	海立股份	7,800	123,630.00	0.01
273	002810	山东赫达	5,000	123,500.00	0.01
274	688247	宣泰医药	16,419	123,470.88	0.01
275	603868	飞科电器	4,000	123,200.00	0.01
276	002399	海普瑞	13,700	123,026.00	0.01
277	688050	爱博医疗	3,368	122,763.60	0.01
278	601360	三六零	14,100	122,529.00	0.01
279	603305	旭升集团	10,100	122,412.00	0.01
280	688215	瑞晟智能	3,047	122,367.52	0.01
281	605099	共创草坪	3,800	122,360.00	0.01
282	603158	腾龙股份	10,000	122,300.00	0.01
283	600577	精达股份	12,500	122,250.00	0.01
284	000989	九芝堂	15,700	121,989.00	0.01
285	300253	卫宁健康	18,100	121,813.00	0.01
286	300332	天壕能源	28,300	121,690.00	0.01
287	688389	普门科技	12,430	121,689.70	0.01
288	688108	赛诺医疗	6,563	121,612.39	0.01
289	300856	科思股份	11,400	121,524.00	0.01
290	600845	宝信软件	7,300	121,399.00	0.01
291	600233	圆通速递	7,700	121,275.00	0.01
292	605088	冠盛股份	4,300	121,174.00	0.01
293	688365	光云科技	7,682	121,145.14	0.01
294	600617	国新能源	45,200	121,136.00	0.01
295	002969	嘉美包装	8,600	121,088.00	0.01
296	002967	广电计量	6,700	120,935.00	0.01
297	300445	康斯特	5,800	120,756.00	0.01
298	688379	华光新材	1,435	120,583.05	0.01
299	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
300	001298	好上好	5,800	120,350.00	0.01
301	300277	汽轮科技	8,000	120,320.00	0.01
302	002488	金固股份	13,500	120,285.00	0.01
303	301613	新铝时代	3,300	120,219.00	0.01

304	301187	欧圣电气	8,400	120,204.00	0.01
305	603013	亚普股份	7,600	120,004.00	0.01
306	601136	首创证券	8,600	119,970.00	0.01
307	300153	科泰电源	5,300	119,886.00	0.01
308	301367	瑞迈特	3,100	119,846.00	0.01
309	600872	中炬高新	6,900	119,784.00	0.01
310	600662	外服控股	29,700	119,691.00	0.01
311	002328	新朋股份	16,300	119,642.00	0.01
312	600712	南宁百货	26,000	119,600.00	0.01
313	601677	明泰铝业	7,200	119,520.00	0.01
314	688228	开普云	1,545	119,490.30	0.01
315	300917	特发服务	4,900	119,462.00	0.01
316	300226	上海钢联	7,800	119,418.00	0.01
317	601086	国芳集团	18,000	119,340.00	0.01
318	300589	江龙船艇	10,100	119,180.00	0.01
319	603162	海通发展	13,284	119,157.48	0.01
320	002889	东方嘉盛	11,500	119,140.00	0.01
321	301517	陕西华达	2,400	119,112.00	0.01
322	300809	华辰装备	4,400	119,020.00	0.01
323	300047	天源迪科	13,400	118,992.00	0.01
324	301600	慧翰股份	1,300	118,820.00	0.01
325	603890	春秋电子	4,300	118,766.00	0.01
326	601969	海南矿业	15,000	118,650.00	0.01
327	300473	德尔股份	3,900	118,560.00	0.01
328	603507	振江股份	3,600	118,404.00	0.01
329	601100	恒立液压	1,100	118,316.00	0.01
330	002034	旺能环境	7,800	118,170.00	0.01
330	300946	恒而达	3,000	118,170.00	0.01
332	001236	弘业期货	17,000	118,150.00	0.01
333	300448	浩云科技	20,500	118,080.00	0.01
334	600158	中体产业	17,500	117,950.00	0.01
335	300030	阳普医疗	20,300	117,943.00	0.01
336	300490	华自科技	8,900	117,747.00	0.01
337	301268	铭利达	8,400	117,432.00	0.01
338	001337	四川黄金	3,200	117,312.00	0.01
339	000975	山金国际	6,900	117,300.00	0.01
340	301500	飞南资源	4,500	117,225.00	0.01
341	600361	创新新材	32,500	117,000.00	0.01
342	300732	设研院	21,000	116,970.00	0.01
343	600803	新奥股份	7,400	116,920.00	0.01
344	601838	成都银行	6,600	116,820.00	0.01
345	002677	浙江美大	21,100	116,683.00	0.01
346	600359	新农开发	21,600	116,640.00	0.01
347	600016	民生银行	36,200	116,564.00	0.01

348	601058	赛轮轮胎	10,100	116,453.00	0.01
349	000708	中信特钢	9,200	116,104.00	0.01
350	002532	天山铝业	10,800	115,884.00	0.01
351	300184	力源信息	6,600	115,830.00	0.01
352	002798	帝欧水华	23,200	115,768.00	0.01
353	002795	永和智控	17,300	115,737.00	0.01
354	002245	蔚蓝锂芯	6,180	115,627.80	0.01
355	600489	中金黄金	6,400	115,520.00	0.01
356	002737	葵花药业	10,300	115,463.00	0.01
357	603958	哈森股份	6,800	115,192.00	0.01
358	600963	岳阳林纸	37,800	114,912.00	0.01
359	601515	衢州东峰	35,900	114,880.00	0.01
360	002408	齐翔腾达	24,400	114,436.00	0.01
361	001211	双枪科技	4,800	114,432.00	0.01
362	601069	西部黄金	5,200	114,400.00	0.01
363	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
364	002454	松芝股份	23,900	114,242.00	0.01
365	301391	卡莱特	2,000	114,200.00	0.01
366	002483	润邦股份	23,100	114,114.00	0.01
367	002067	景兴纸业	31,000	114,080.00	0.01
368	002582	好想你	13,500	114,075.00	0.01
369	300510	金冠股份	36,500	113,880.00	0.01
370	300168	万达信息	24,800	113,832.00	0.01
371	002752	昇兴股份	20,600	113,712.00	0.01
372	000990	诚志股份	13,900	113,702.00	0.01
373	600418	江淮汽车	4,400	113,652.00	0.01
374	300365	恒华科技	24,800	113,584.00	0.01
375	600115	中国东航	29,800	113,538.00	0.01
376	600929	雪天盐业	25,000	113,500.00	0.01
377	600210	紫江企业	18,300	113,460.00	0.01
378	688238	和元生物	20,933	113,456.86	0.01
379	688633	星球石墨	3,813	113,360.49	0.01
380	600346	恒力石化	6,400	113,344.00	0.01
381	002206	海利得	21,900	113,223.00	0.01
382	601068	中铝国际	26,200	113,184.00	0.01
383	601828	美凯龙	55,400	113,016.00	0.01
384	300599	雄塑科技	11,200	112,784.00	0.01
385	300369	绿盟科技	20,700	112,608.00	0.01
386	600426	华鲁恒升	4,700	112,424.00	0.01
387	300232	洲明科技	19,600	112,308.00	0.01
388	603259	药明康德	900	112,059.00	0.01
389	002493	荣盛石化	10,400	111,800.00	0.01
390	000949	新乡化纤	17,600	111,584.00	0.01
391	002648	卫星化学	4,700	110,403.00	0.01

392	603588	高能环境	5,700	109,440.00	0.01
393	002437	誉衡药业	39,300	106,110.00	0.01
394	000599	青岛双星	24,700	104,234.00	0.01
395	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
396	688779	五矿新能	11,362	92,145.82	0.01
397	300933	中辰股份	15,000	91,200.00	0.01
398	605189	富春染织	7,500	90,375.00	0.01
399	300723	一品红	2,400	89,472.00	0.01
400	688082	盛美上海	201	86,832.00	0.01
401	002042	华孚时尚	24,500	83,545.00	0.01
402	603051	鹿山新材	4,300	82,904.00	0.01
403	603889	新澳股份	16,180	82,679.80	0.01
404	605016	百龙创园	3,100	80,135.00	0.01
405	001218	丽臣实业	3,600	79,416.00	0.01
406	000651	格力电器	2,100	78,750.00	0.01
407	600320	振华重工	18,800	77,644.00	0.01
408	605305	中际联合	1,800	75,456.00	0.01
409	601111	中国国航	12,200	73,810.00	0.01
410	000001	平安银行	7,300	73,365.00	0.01
411	688279	峰岬科技	326	73,167.44	0.01
412	603288	海天味业	2,200	72,952.00	0.01
413	688308	欧科亿	401	72,905.81	0.01
414	600887	伊利股份	3,000	71,880.00	0.01
415	002017	东信和平	4,900	71,687.00	0.01
416	688508	芯朋微	771	71,672.16	0.01
417	300331	苏大维格	1,000	71,110.00	0.01
418	002163	海南发展	8,500	70,890.00	0.00
419	300016	北陆药业	9,200	70,564.00	0.00
420	002602	世纪华通	5,000	70,500.00	0.00
421	002041	登海种业	8,900	70,043.00	0.00
422	002045	国光电器	8,900	69,865.00	0.00
423	000617	中油资本	10,600	69,854.00	0.00
424	002961	瑞达期货	3,500	68,530.00	0.00
425	002283	天润工业	7,000	67,550.00	0.00
426	002001	新和成	2,300	65,366.00	0.00
427	603198	迎驾贡酒	2,200	65,120.00	0.00
428	002557	洽洽食品	3,600	64,656.00	0.00
429	601988	中国银行	11,200	64,064.00	0.00
430	002674	兴业科技	2,200	62,766.00	0.00
431	002847	盐津铺子	1,400	62,440.00	0.00
432	301109	军信股份	5,000	62,300.00	0.00
433	002049	紫光国微	700	62,125.00	0.00
434	600066	宇通客车	2,300	61,663.00	0.00
435	300814	中富电路	300	61,350.00	0.00

436	688595	芯海科技	1,392	61,053.12	0.00
437	603301	振德医疗	700	61,012.00	0.00
438	002780	三夫户外	5,000	60,700.00	0.00
439	002946	新乳业	4,300	60,544.00	0.00
440	300443	金雷股份	2,800	60,424.00	0.00
441	002398	垒知集团	15,800	59,250.00	0.00
442	688360	德马科技	3,303	59,123.70	0.00
443	002587	奥拓电子	7,400	57,794.00	0.00
444	688087	英科再生	1,707	57,047.94	0.00
445	688173	希荻微	2,957	56,596.98	0.00
446	301160	翔楼新材	1,205	56,213.25	0.00
447	603059	倍加洁	2,300	55,775.00	0.00
448	688179	阿拉丁	1,987	55,059.77	0.00
449	300130	新国都	2,600	54,704.00	0.00
450	688689	银河微电	844	54,623.68	0.00
451	603188	亚邦股份	13,700	54,252.00	0.00
452	603511	爱慕股份	4,700	54,050.00	0.00
453	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
454	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
455	601336	新华保险	900	53,694.00	0.00
456	301206	三元生物	2,400	53,352.00	0.00
457	603207	小方制药	2,385	53,328.60	0.00
458	300665	飞鹿股份	5,200	53,196.00	0.00
459	300846	首都在线	2,500	53,025.00	0.00
460	603836	海程邦达	6,700	52,930.00	0.00
461	688721	龙图光罩	904	52,775.52	0.00
462	301135	瑞德智能	3,200	52,704.00	0.00
463	301115	联检科技	1,500	52,590.00	0.00
464	603010	万盛股份	2,900	52,548.00	0.00
465	002599	盛通股份	10,300	52,530.00	0.00
466	301098	金埔园林	6,400	52,480.00	0.00
467	300664	鹏鹞环保	12,300	52,152.00	0.00
468	688557	兰剑智能	1,666	51,695.98	0.00
469	688443	智翔金泰	2,216	51,522.00	0.00
470	300131	英唐智控	2,700	51,381.00	0.00
471	300525	博思软件	6,900	51,336.00	0.00
472	002862	实丰文化	4,000	51,320.00	0.00
473	301208	中亦科技	1,800	51,282.00	0.00
474	301055	张小泉	1,200	50,964.00	0.00
475	688133	泰坦科技	2,404	50,796.52	0.00
476	300951	博硕科技	1,000	50,500.00	0.00
477	003816	中国广核	12,800	50,048.00	0.00
478	002741	光华科技	1,400	50,036.00	0.00
479	300922	天秦装备	3,300	49,995.00	0.00

480	300825	阿尔特	3,500	49,980.00	0.00
481	688515	裕太微	200	49,752.00	0.00
482	301522	上大股份	1,900	49,723.00	0.00
483	300587	天铁科技	12,900	49,665.00	0.00
484	301275	汉朔科技	1,100	49,390.00	0.00
485	603057	紫燕食品	2,200	49,060.00	0.00
486	002864	盘龙药业	1,900	49,020.00	0.00
487	300904	威力传动	1,200	48,708.00	0.00
488	603681	永冠新材	2,100	47,985.00	0.00
489	300785	值得买	1,300	47,671.00	0.00
490	301173	毓恬冠佳	1,600	47,536.00	0.00
491	301096	百诚医药	800	45,752.00	0.00
492	301393	昊帆生物	700	45,339.00	0.00
493	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
494	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
495	603124	江南新材	200	37,396.00	0.00
496	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
497	002991	甘源食品	900	35,559.00	0.00
498	605338	巴比食品	1,900	34,010.00	0.00
499	603190	亚通精工	1,500	33,930.00	0.00
500	301456	盘古智能	1,500	33,870.00	0.00
501	603860	中公高科	1,400	33,866.00	0.00
502	301223	中荣股份	2,100	33,852.00	0.00
503	603948	建业股份	1,400	33,740.00	0.00
504	603048	浙江黎明	1,900	33,706.00	0.00
505	002127	南极电商	12,300	33,702.00	0.00
506	300915	海融科技	1,700	33,660.00	0.00
507	603217	元利科技	1,500	33,645.00	0.00
508	300476	胜宏科技	97	33,603.71	0.00
509	300694	蠡湖股份	3,500	33,600.00	0.00
510	001358	兴欣新材	1,300	33,592.00	0.00
511	300971	博亚精工	1,800	33,588.00	0.00
512	605089	味知香	1,600	33,584.00	0.00
513	301130	西点药业	1,400	33,572.00	0.00
514	688260	昀冢科技	233	33,552.00	0.00
515	002609	捷顺科技	4,400	33,528.00	0.00
516	002887	绿茵生态	3,200	33,504.00	0.00
517	300851	交大思诺	1,500	33,375.00	0.00
518	300841	康华生物	700	33,292.00	0.00
519	605033	美邦股份	2,000	33,280.00	0.00
520	300387	富邦科技	4,900	33,271.00	0.00
521	301163	宏德股份	1,500	33,270.00	0.00
522	300783	三只松鼠	2,100	33,180.00	0.00
523	002746	仙坛股份	6,500	33,150.00	0.00

524	688613	奥精医疗	2,347	33,116.17	0.00
525	301469	恒达新材	1,200	33,096.00	0.00
526	603333	福华尚纬	4,100	33,046.00	0.00
527	002996	顺博合金	5,600	33,040.00	0.00
528	300803	指南针	360	33,001.20	0.00
529	603153	上海建科	2,600	32,968.00	0.00
530	301103	何氏眼科	2,200	32,956.00	0.00
531	603116	红蜻蜓	5,800	32,944.00	0.00
532	001368	通达创智	1,600	32,912.00	0.00
533	603518	锦泓集团	4,600	32,890.00	0.00
534	601500	通用股份	9,000	32,850.00	0.00
535	001231	农心科技	1,800	32,832.00	0.00
536	603848	好太太	2,400	32,784.00	0.00
537	600351	亚宝药业	5,700	32,775.00	0.00
538	002820	桂发祥	3,900	32,760.00	0.00
538	600865	百大集团	4,000	32,760.00	0.00
540	301339	通行宝	3,200	32,736.00	0.00
541	002899	英派斯	1,500	32,700.00	0.00
542	301060	兰卫医学	4,000	32,680.00	0.00
542	600843	上工申贝	3,800	32,680.00	0.00
544	600628	新世界	5,800	32,654.00	0.00
545	600469	风神股份	6,000	32,640.00	0.00
546	000605	渤海股份	6,100	32,635.00	0.00
547	002391	长青股份	6,700	32,629.00	0.00
548	605577	龙版传媒	3,700	32,597.00	0.00
549	002481	双塔食品	8,600	32,594.00	0.00
550	600829	人民同泰	4,200	32,592.00	0.00
551	301215	中汽股份	6,276	32,572.44	0.00
552	601008	连云港	8,100	32,562.00	0.00
553	000407	胜利股份	8,800	32,560.00	0.00
554	600419	天润乳业	4,300	32,551.00	0.00
555	002998	优彩资源	5,000	32,550.00	0.00
555	301032	新柴股份	3,500	32,550.00	0.00
557	300945	曼卡龙	3,000	32,490.00	0.00
557	301126	达嘉维康	3,800	32,490.00	0.00
559	603101	汇嘉时代	5,200	32,448.00	0.00
560	603909	建发合诚	3,800	32,414.00	0.00
561	600694	大商股份	2,450	32,413.50	0.00
562	002494	华斯股份	7,300	32,412.00	0.00
563	300906	日月明	1,300	32,409.00	0.00
564	002026	山东威达	3,000	32,400.00	0.00
564	300407	凯发电气	3,000	32,400.00	0.00
566	688203	海正生材	3,246	32,395.08	0.00
567	601007	金陵饭店	5,300	32,383.00	0.00

568	002712	思美传媒	7,800	32,370.00	0.00
569	301370	国科恒泰	4,000	32,360.00	0.00
570	301122	采纳股份	1,100	32,351.00	0.00
571	600638	新黄浦	7,400	32,338.00	0.00
572	603310	巍华新材	2,200	32,318.00	0.00
573	600681	百川能源	10,000	32,300.00	0.00
573	601366	利群股份	10,000	32,300.00	0.00
575	002187	广百股份	6,900	32,292.00	0.00
576	688395	正弦电气	1,461	32,288.10	0.00
577	601700	风范股份	7,400	32,264.00	0.00
578	300662	科锐国际	1,900	32,262.00	0.00
579	000059	华锦股份	8,600	32,250.00	0.00
580	600496	精工钢构	10,400	32,240.00	0.00
581	002376	新北洋	5,600	32,200.00	0.00
581	600883	博闻科技	4,600	32,200.00	0.00
583	603817	海峡环保	6,300	32,193.00	0.00
584	688236	春立医疗	2,226	32,187.96	0.00
585	603291	联合水务	4,000	32,160.00	0.00
586	603276	恒兴新材	2,100	32,151.00	0.00
587	688211	中科微至	934	32,148.28	0.00
588	002419	天虹股份	7,600	32,148.00	0.00
589	002578	闽发铝业	10,200	32,130.00	0.00
589	603126	中材节能	5,100	32,130.00	0.00
591	300439	美康生物	4,000	32,120.00	0.00
592	300213	佳讯飞鸿	5,300	32,118.00	0.00
593	600558	大西洋	6,500	32,110.00	0.00
594	002390	信邦制药	12,300	32,103.00	0.00
595	603900	莱绅通灵	5,700	32,091.00	0.00
596	002327	富安娜	5,400	32,076.00	0.00
596	603818	曲美家居	10,800	32,076.00	0.00
598	301190	善水科技	2,000	32,060.00	0.00
599	300512	中亚股份	4,700	32,054.00	0.00
600	001209	洪兴股份	2,000	32,040.00	0.00
600	002702	海欣食品	7,200	32,040.00	0.00
602	002040	南京港	4,300	32,035.00	0.00
603	002404	嘉欣丝绸	5,600	32,032.00	0.00
604	002166	莱茵生物	5,100	32,028.00	0.00
604	300517	海波重科	3,400	32,028.00	0.00
606	000419	通程控股	7,100	32,021.00	0.00
607	600796	钱江生化	6,900	32,016.00	0.00
608	002566	益盛药业	5,300	32,012.00	0.00
609	002644	佛慈制药	4,700	32,007.00	0.00
610	600894	广日股份	4,200	32,004.00	0.00
611	002016	世荣兆业	8,000	32,000.00	0.00

612	002479	富春环保	7,600	31,996.00	0.00
613	300771	智莱科技	3,100	31,992.00	0.00
614	300575	中旗股份	6,500	31,980.00	0.00
615	603266	天龙股份	1,900	31,977.00	0.00
616	603966	法兰泰克	3,920	31,948.00	0.00
617	688575	亚辉龙	3,644	31,921.44	0.00
618	002054	德美化工	4,800	31,920.00	0.00
618	300107	建新股份	5,700	31,920.00	0.00
618	300230	永利股份	7,600	31,920.00	0.00
621	600467	好当家	16,200	31,914.00	0.00
622	688285	高铁电气	4,451	31,913.67	0.00
623	600824	益民集团	9,700	31,913.00	0.00
624	002412	汉森制药	5,800	31,900.00	0.00
625	002337	赛象科技	7,200	31,896.00	0.00
626	001378	德冠新材	1,780	31,879.80	0.00
627	002688	金河生物	6,900	31,878.00	0.00
627	603689	皖天然气	4,600	31,878.00	0.00
629	003016	欣贺股份	5,200	31,876.00	0.00
630	688681	科汇股份	2,280	31,874.40	0.00
631	688370	丛麟科技	1,523	31,861.16	0.00
632	003003	天元股份	3,200	31,840.00	0.00
633	600650	锦江在线	3,300	31,812.00	0.00
634	300425	中建环能	8,500	31,790.00	0.00
635	002495	佳隆股份	15,500	31,775.00	0.00
636	600218	全柴动力	4,400	31,768.00	0.00
637	688113	联测科技	905	31,765.50	0.00
638	603506	南都物业	3,400	31,756.00	0.00
639	002573	清新环境	10,800	31,752.00	0.00
639	601968	宝钢包装	8,100	31,752.00	0.00
641	603648	畅联股份	3,700	31,746.00	0.00
641	603708	家家悦	3,700	31,746.00	0.00
643	000421	南京公用	6,400	31,744.00	0.00
644	600814	杭州解百	5,200	31,720.00	0.00
644	603815	交建股份	6,100	31,720.00	0.00
646	600790	轻纺城	9,700	31,719.00	0.00
647	300406	九强生物	2,900	31,697.00	0.00
648	600262	北方股份	1,600	31,664.00	0.00
649	600523	贵航股份	3,000	31,650.00	0.00
650	002949	华阳国际	3,200	31,648.00	0.00
651	002727	一心堂	3,300	31,647.00	0.00
652	000045	深纺织 A	3,000	31,620.00	0.00
652	600479	千金药业	3,400	31,620.00	0.00
654	688199	久日新材	915	31,594.95	0.00
655	600833	第一医药	3,500	31,570.00	0.00

656	002942	新农股份	2,200	31,526.00	0.00
657	002111	威海广泰	3,500	31,500.00	0.00
657	600232	金鹰股份	5,000	31,500.00	0.00
659	603214	爱婴室	2,600	31,486.00	0.00
660	300381	溢多利	5,600	31,472.00	0.00
661	603321	梅轮电梯	5,500	31,460.00	0.00
662	603018	华设集团	6,120	31,456.80	0.00
663	300800	力合科技	3,400	31,450.00	0.00
663	600880	博瑞传播	8,500	31,450.00	0.00
665	300583	赛托生物	2,800	31,444.00	0.00
666	002748	世龙实业	3,000	31,440.00	0.00
667	688293	奥浦迈	754	31,434.26	0.00
668	603329	上海雅仕	3,500	31,430.00	0.00
668	605268	王力安防	3,500	31,430.00	0.00
670	000554	泰山石油	5,600	31,416.00	0.00
670	603309	维力医疗	2,800	31,416.00	0.00
672	001379	腾达科技	2,000	31,400.00	0.00
673	600279	重庆港	8,600	31,390.00	0.00
674	000652	泰达股份	9,200	31,372.00	0.00
675	603332	苏州龙杰	3,100	31,341.00	0.00
676	002811	郑中设计	2,800	31,332.00	0.00
677	603209	兴通股份	2,500	31,325.00	0.00
678	002968	新大正	3,700	31,302.00	0.00
679	002763	汇洁股份	4,600	31,234.00	0.00
680	603172	万丰股份	1,900	31,217.00	0.00
681	603980	吉华集团	4,700	31,208.00	0.00
682	002140	东华科技	3,400	31,178.00	0.00
683	603839	安正时尚	5,400	31,158.00	0.00
684	002184	海得控制	3,400	31,144.00	0.00
685	603365	水星家纺	2,000	31,140.00	0.00
686	603739	蔚蓝生物	2,700	31,131.00	0.00
687	002576	通达动力	2,200	31,130.00	0.00
688	600356	恒丰纸业	4,200	31,122.00	0.00
689	600128	苏豪弘业	4,100	31,119.00	0.00
690	603041	美思德	3,000	31,110.00	0.00
691	603587	地素时尚	2,800	31,108.00	0.00
691	603711	香飘飘	2,800	31,108.00	0.00
693	600697	欧亚集团	3,200	31,104.00	0.00
694	603558	健盛集团	2,800	31,052.00	0.00
695	603967	中创物流	3,000	31,050.00	0.00
696	603600	永艺股份	3,500	31,045.00	0.00
697	603768	常青股份	3,400	31,042.00	0.00
698	603020	爱普股份	2,200	31,020.00	0.00
699	001219	青岛食品	2,700	30,942.00	0.00

700	002090	金智科技	3,500	30,940.00	0.00
701	300908	仲景食品	1,400	30,856.00	0.00
702	001336	楚环科技	1,400	30,828.00	0.00
703	603381	永臻股份	2,000	30,820.00	0.00
704	300519	新光药业	2,600	30,810.00	0.00
705	300898	熊猫乳品	1,700	30,804.00	0.00
706	300826	测绘股份	2,200	30,800.00	0.00
707	605007	五洲特纸	2,300	30,797.00	0.00
708	605266	健之佳	2,100	30,744.00	0.00
709	001230	劲旅环境	2,000	30,720.00	0.00
709	300860	锋尚文化	1,200	30,720.00	0.00
711	300577	开润股份	2,100	30,681.00	0.00
712	002772	众兴菌业	2,700	30,672.00	0.00
712	603630	拉芳家化	2,400	30,672.00	0.00
714	300075	数字政通	3,000	30,660.00	0.00
715	300823	建科智能	2,100	30,618.00	0.00
716	301283	聚胶股份	1,250	30,600.00	0.00
717	600969	郴电国际	4,000	30,520.00	0.00
718	002695	煌上煌	3,000	30,450.00	0.00
719	001366	播恩集团	2,800	30,352.00	0.00
720	301388	欣灵电气	1,300	30,316.00	0.00
721	603926	铁流股份	1,700	30,073.00	0.00
722	600980	北矿科技	1,600	30,000.00	0.00
723	605151	西上海	1,700	29,937.00	0.00
724	603656	泰禾智能	1,700	29,886.00	0.00
725	300988	津荣天宇	1,900	29,697.00	0.00
726	002760	凤形股份	1,800	29,556.00	0.00
727	300672	国科微	100	29,500.00	0.00
728	603409	汇通控股	1,600	29,360.00	0.00
729	603307	扬州金泉	1,250	29,187.50	0.00
730	301392	汇成真空	100	28,864.00	0.00
731	301210	金杨精密	960	28,800.00	0.00
732	001288	运机集团	1,200	28,548.00	0.00
733	688699	明微电子	348	28,518.60	0.00
734	603489	八方股份	1,000	27,960.00	0.00
735	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
736	688789	宏华数科	516	27,435.72	0.00
737	600893	航发动力	700	26,838.00	0.00
738	688103	国力电子	347	25,820.27	0.00
739	603324	盛剑科技	500	25,630.00	0.00
740	603083	剑桥科技	100	25,487.00	0.00
741	688271	联影医疗	240	24,295.20	0.00
742	301282	金禄电子	820	24,181.80	0.00
743	300976	达瑞电子	300	23,895.00	0.00

744	300420	五洋自控	2,500	23,650.00	0.00
745	001339	智微智能	230	23,524.40	0.00
746	301376	致欧科技	1,300	23,036.00	0.00
747	300166	东方国信	1,300	23,023.00	0.00
748	002728	特一药业	2,500	22,875.00	0.00
749	002947	恒铭达	300	22,815.00	0.00
750	688181	八亿时空	364	22,786.40	0.00
751	301197	工大科雅	600	22,692.00	0.00
752	603316	诚邦股份	1,100	22,649.00	0.00
753	688148	芳源股份	2,635	22,608.30	0.00
754	688097	博众精工	358	22,571.90	0.00
755	688106	金宏气体	544	22,565.12	0.00
756	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
757	301179	泽宇智能	1,100	22,506.00	0.00
758	300709	精研科技	400	22,500.00	0.00
759	688136	科兴制药	1,085	22,470.35	0.00
760	300907	康平科技	400	22,400.00	0.00
761	300195	长荣股份	3,800	22,306.00	0.00
762	603271	永杰新材	500	22,225.00	0.00
763	300337	银邦股份	1,900	22,154.00	0.00
764	688231	隆达股份	602	22,111.46	0.00
765	300299	富春股份	4,500	22,050.00	0.00
766	688358	祥生医疗	719	21,979.83	0.00
767	688591	泰凌微	639	21,968.82	0.00
768	300182	捷成股份	4,600	21,850.00	0.00
769	600567	山鹰国际	15,900	21,783.00	0.00
770	688156	路德科技	720	21,780.00	0.00
771	603337	杰克科技	600	21,738.00	0.00
772	301025	读客文化	2,800	21,728.00	0.00
773	000725	京东方 A	2,500	21,700.00	0.00
774	301001	凯淳股份	1,000	21,670.00	0.00
775	300713	英可瑞	1,700	21,658.00	0.00
776	002837	英维克	270	21,481.20	0.00
777	300749	顶固集创	800	21,480.00	0.00
778	300433	蓝思科技	400	21,464.00	0.00
779	002606	大连电瓷	1,600	21,456.00	0.00
780	300761	立华股份	1,300	21,333.00	0.00
781	601686	友发集团	4,400	21,252.00	0.00
782	601633	长城汽车	1,400	21,126.00	0.00
783	603098	森特股份	2,000	21,100.00	0.00
784	300893	松原安全	1,300	21,060.00	0.00
785	688116	天奈科技	543	20,742.60	0.00
786	688428	诺诚健华	720	20,498.40	0.00
787	688084	晶品特装	407	20,463.96	0.00

788	301193	家联科技	1,100	20,394.00	0.00
789	300628	亿联网络	600	20,292.00	0.00
790	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
791	603068	博通集成	500	20,115.00	0.00
792	301042	安联锐视	300	20,010.00	0.00
792	688757	胜科纳米	300	20,010.00	0.00
794	688350	富淼科技	579	19,992.87	0.00
795	300890	翔丰华	600	19,902.00	0.00
796	301580	爱迪特	300	19,299.00	0.00
797	300033	同花顺	80	19,280.00	0.00
798	001388	信通电子	700	19,229.00	0.00
799	300698	万马科技	700	19,040.00	0.00
800	300811	铂科新材	200	18,978.00	0.00
801	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
802	301633	港迪技术	400	18,724.00	0.00
803	301387	光大同创	200	18,484.00	0.00
804	301366	一博科技	300	18,351.00	0.00
805	603285	键邦股份	400	17,924.00	0.00
806	688513	苑东生物	406	17,847.76	0.00
807	600183	生益科技	100	17,340.00	0.00
808	301428	世纪恒通	500	17,285.00	0.00
809	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
810	300622	博士眼镜	1,200	16,728.00	0.00
811	300738	奥飞数据	800	16,176.00	0.00
812	301228	实朴检测	200	15,632.00	0.00
813	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
814	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
815	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
816	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
817	301598	博科测试	300	14,856.00	0.00
818	603228	景旺电子	200	14,482.00	0.00
819	601138	工业富联	200	14,430.00	0.00
820	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
821	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
822	002264	新华都	2,300	12,972.00	0.00
823	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
824	301165	锐捷网络	140	11,263.00	0.00
825	301568	思泰克	100	11,160.00	0.00
826	300990	同飞股份	100	10,507.00	0.00
827	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.00
828	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
829	001331	胜通能源	145	8,175.10	0.00
830	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
831	603014	威高血净	205	6,709.65	0.00

832	301005	超捷股份	60	6,693.60	0.00
833	002151	北斗星通	200	6,350.00	0.00
834	301360	荣旗科技	90	6,164.10	0.00
835	688606	奥泰生物	150	6,162.00	0.00
836	603193	润本股份	303	5,620.65	0.00
837	300866	安克创新	50	5,225.00	0.00
838	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
839	301150	中一科技	60	3,786.60	0.00
840	002202	金风科技	154	3,680.60	0.00
841	688429	时创能源	346	3,525.74	0.00
842	600580	卧龙电驱	100	3,310.00	0.00
843	002645	华宏科技	120	3,301.20	0.00
844	603334	丰倍生物	88	3,126.64	0.00
845	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
846	300781	因赛集团	98	2,583.28	0.00
847	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
848	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
849	301363	美好医疗	124	2,272.92	0.00
850	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
851	301596	瑞迪智驱	40	2,016.00	0.00
852	301505	苏州规划	125	2,012.50	0.00
853	603067	振华股份	40	1,851.60	0.00
854	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
855	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
856	300970	华绿生物	70	1,279.60	0.00
857	301479	弘景光电	20	1,204.00	0.00
858	300981	中红医疗	120	1,148.40	0.00
859	300932	三友联众	96	1,017.60	0.00
860	300938	信测标准	20	997.60	0.00
861	603883	老百姓	48	526.08	0.00
862	600720	中交设计	30	144.60	0.00
863	600959	江苏有线	30	86.70	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	688498	源杰科技	20,609,376.64	2.27
2	001309	德明利	17,517,171.95	1.93
3	601233	桐昆股份	16,478,643.20	1.81
4	002532	天山铝业	16,283,657.00	1.79
5	002738	中矿资源	15,625,576.14	1.72

6	300857	协创数据	15,327,345.40	1.69
7	002558	巨人网络	14,383,950.00	1.58
8	600499	科达制造	13,956,364.00	1.54
9	300223	北京君正	13,172,531.99	1.45
10	000703	恒逸石化	12,893,548.57	1.42
11	002152	广电运通	12,829,376.00	1.41
12	300136	信维通信	12,800,362.00	1.41
13	002130	沃尔核材	12,638,229.00	1.39
14	301358	湖南裕能	12,580,039.31	1.38
15	600601	方正科技	12,564,042.00	1.38
16	688778	厦钨新能	12,410,413.66	1.37
17	300604	长川科技	12,400,211.24	1.36
18	002064	华峰化学	11,941,935.00	1.31
19	300475	香农芯创	11,493,187.68	1.26
20	301536	星辰科技	11,488,940.00	1.26

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。

7.4.2 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	600487	亨通光电	26,413,791.02	2.91
2	688525	佰维存储	18,711,788.20	2.06
3	000657	中钨高新	18,094,938.00	1.99
4	002156	通富微电	17,462,995.72	1.92
5	301308	江波龙	16,780,295.37	1.85
6	601918	新集能源	16,568,372.00	1.82
7	600549	厦门钨业	16,277,123.00	1.79
8	600096	云天化	15,986,213.44	1.76
9	002532	天山铝业	14,975,335.00	1.65
10	002436	兴森科技	14,736,184.04	1.62
11	000933	神火股份	14,714,753.37	1.62
12	002281	光迅科技	14,195,775.00	1.56
13	002558	巨人网络	13,295,575.00	1.46
14	300450	先导智能	13,137,656.00	1.45
15	300604	长川科技	12,931,231.00	1.42
16	300857	协创数据	12,919,059.40	1.42
17	688301	奕瑞科技	12,548,181.07	1.38
18	002138	顺络电子	11,938,483.00	1.31
19	601168	西部矿业	11,637,466.00	1.28
20	002294	信立泰	11,501,786.00	1.27

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。

7.4.3 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	3,363,465,832.58
卖出股票收入（成交）总额	3,122,346,010.56

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。

7.5 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）	260,009.21	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	260,009.21	0.02

7.6 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	113704	春风转债	1,820	182,007.98	0.01
2	118071	华峰转债	760	76,001.16	0.01
3	118070	南芯转债	20	2,000.07	0.00

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 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	8,560,842.12
2	应收清算款	221,435.77
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,827,579.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,609,857.09

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达中证 500 量化增强 A	14,437	29,883.49	94,123,200.27	21.82%	337,304,705.62	78.18%
易方达中证 500 量化增强 C	19,788	26,855.25	270,518,571.95	50.91%	260,893,069.59	49.09%
合计	34,225	28,132.64	364,641,772.22	37.87%	598,197,775.21	62.13%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达中证 500 量化增强 A	1,255,064.06	0.2909%
	易方达中证 500 量化增强 C	42,274.53	0.0080%
	合计	1,297,338.59	0.1347%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达中证 500 量化增强 A	0
	易方达中证 500 量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证 500 量化增强 A	50~100

	易方达中证 500 量化增强 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 15 日）基金份额总额	777,613,734.55	311,361,864.27
本报告期期初基金份额总额	311,303,082.37	440,352,255.69
本报告期基金总申购份额	269,392,579.16	315,917,670.32
减：本报告期基金总赎回份额	149,267,755.64	224,858,284.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	431,427,905.89	531,411,641.54

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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 2026 年 1 月 5 日发布公告，自 2026 年 1 月 3 日起高松凡先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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、基金财产的诉讼事项；本报告期内无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	1,157,205,543.47	17.85%	115,733.43	17.85%	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	4,192,634,697.69	64.68%	419,296.28	64.68%	-
国金证券	2	1,132,702,667.46	17.47%	113,270.32	17.47%	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为华安证券股份有限公司、江海证券有限公司，无新增交易单元。

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。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

- 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。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	201,590.06	99.08%	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	1,878.68	0.92%	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

山西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
3	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-15
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2026-01-22
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
6	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-21
7	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
8	关于易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金 2026 年因港股通不提供服务暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
9	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 7 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
10	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（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报	2026-03-31

12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2026-04-22
13	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
14	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
15	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
16	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
17	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-19
19	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23
20	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日