

易方达中证 800 指数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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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 15 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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	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	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
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	82
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	82
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	83
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	83
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	83
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83

7.12 投资组合报告附注	83
§ 8 基金份额持有人信息	84
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
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	85
§ 9 开放式基金份额变动	85
§ 10 重大事件揭示	85
10.1 基金份额持有人大会决议	85
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	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
10.4 基金投资策略的改变	86
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	86
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	86
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	86
10.8 其他重大事件	87
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	88
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	88
§ 12 备查文件目录	88
12.1 备查文件目录	88
12.2 存放地点	89
12.3 查阅方式	89

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 800 指数增强型证券投资基金	
基金简称	易方达中证 800 增强	
基金主代码	026359	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 15 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	299,036,028.93 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 800 增强 A	易方达中证 800 增强 C
下属分级基金的交易代码	026359	026360
报告期末下属分级基金的份额总额	207,122,392.11 份	91,913,636.82 份

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。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 4%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。股票投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型，在控制组合风险与交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优选股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。本基金通过采取多个定量投资模型，力争分散模型风险，提高投资组合表现。本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行。债券投资方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资管理。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权，并可参与转融通证券出借业务、融资业务。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互

	联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。
--	---

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	张立学
	联系电话	020-85102688	010-68858126
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95580
传真		020-38798812	010-86353609
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层	北京市西城区金融大街 3 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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		510627；510623；519031	100808
法定代表人		吴欣荣	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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 15 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日)
---------------	--

	易方达中证 800 增强 A	易方达中证 800 增强 C
本期已实现收益	40,743,230.58	12,750,286.34
本期利润	60,200,969.69	8,894,975.55
加权平均基金份额本期利润	0.0509	0.0612
本期加权平均净值利润率	5.12%	6.07%
本期基金份额净值增长率	8.34%	8.15%
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 800 增强 A	易方达中证 800 增强 C
期末可供分配利润	17,280,498.35	7,487,958.92
期末可供分配基金份额利润	0.0834	0.0815
期末基金资产净值	224,402,890.46	99,401,595.74
期末基金份额净值	1.0834	1.0815
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达中证 800 增强 A	易方达中证 800 增强 C
基金份额累计净值增长率	8.34%	8.15%

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。

4.本基金合同于 2026 年 1 月 15 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

易方达中证 800 增强 C

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

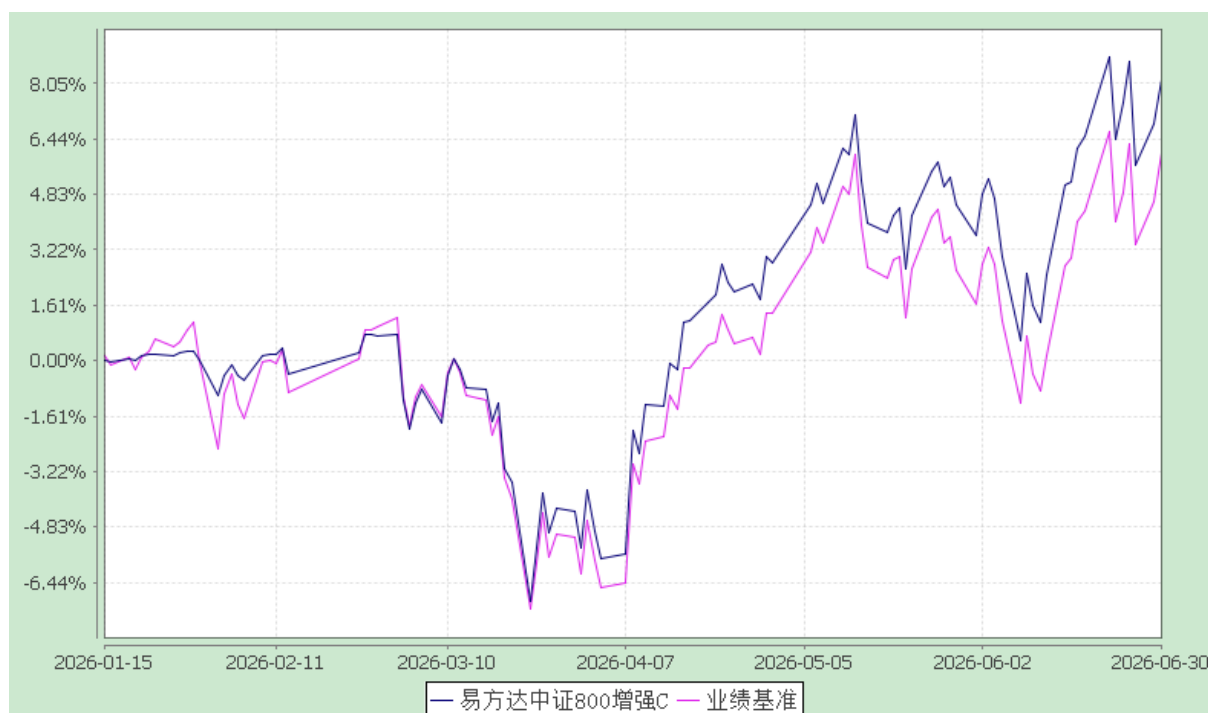
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中证 800 指数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
(2026 年 1 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日)

易方达中证 800 增强 A



易方达中证 800 增强 C



注：1.本基金合同于 2026 年 1 月 15 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

§ 4 管理人报告

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

					资总监，深圳市弘源泰平资产管理有限公司量化投资总监。
--	--	--	--	--	----------------------------

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

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，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 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 2026 年上半年，宏观经济整体延续了一季度“开局好于 2025 年末”的修复态势，但增长斜率在二季度出现边际放缓，全年“前高后稳”的节奏基本确立。制造业 PMI 在 4-6 月分别为 50.3%、50.0%、50.3%，全程站稳荣枯线上方但扩张力度温和，印证了经济处于“弱扩张”区间而非全面顺周期加速。与生产端的韧性形成鲜明对比的是需求端的持续偏弱——上半年社会消费品零售总额累计同比仅增长 1.3%，居民商品消费内生弹性不足、地产与民间投资偏弱的结构性矛盾并未实质性缓解。

因此，上半年宏观主线延续并强化了一季度我们判断的核心逻辑：经济的驱动力并非来自“总量强弱”的简单摆动，而是增长动能持续由传统地产链、可选耐用品链条，向高技术制造、装备制造与 AI 算力产业链切换，这一结构性切换，构成了理解本报告期权益市场极致风格演绎的根本宏观背景。

报告期内科技成长表现非常强劲，且在二季度演绎至极致的“科技成长领航、价值消费掉队”的结构分化格局，这一极致风格演化的原因有 AI 板块的发展超预期，但不可忽视经济增长动能结构性切换的这一大的宏观背景。在这样风格分化严重的市场环境下，风格暴露对量化模型超额的影响显著提升，报告期内量化基金的超额收益差异较大，为了获取相对稳定的超额收益，本基金在报告期对组合风格的暴露持续保持较为严格的控制。

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 1.0834 元，本报告期份额净值增长率为 8.34%，同期业绩比较基准收益率为 6.03%；C 类基金份额净值为 1.0815 元，本报告期份额净值增长率为 8.15%，同期业绩比较基准收益率为 6.03%。年化跟踪误差 4.41%，超过目标控制范围，因本报告期包含了建仓期，故跟踪误差等指标在调整之中。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济结构转型还在进行中，国内经济总体平稳、结构分化的背景应该还会延续，上半年证券市场对这一经济主线已经有了一定的演绎，在上半年市场风格分化较为极致的背景下，下半年市场风格可能会出现阶段性的调整，但在宏观经济总体平稳、经济驱动力转型成果显著的大背景下，预计市场整体还会延续景气行情。

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

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 800 增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 800 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达中证 800 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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 800 指数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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	38,566,245.33
结算备付金		6,740,978.20
存出保证金		4,458,133.51
交易性金融资产	6.4.7.2	274,122,722.13
其中：股票投资		274,099,721.25
基金投资		-
债券投资		23,000.88
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		-
应收股利		-
应收申购款		10,052,851.26
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		333,940,930.43
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		7,415,769.51

应付赎回款		2,127,766.01
应付管理人报酬		224,906.30
应付托管费		42,169.92
应付销售服务费		35,487.64
应付投资顾问费		-
应交税费		37,349.61
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	252,995.24
负债合计		10,136,444.23
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	299,036,028.93
未分配利润	6.4.7.8	24,768,457.27
净资产合计		323,804,486.20
负债和净资产总计		333,940,930.43

注：1.本基金合同生效日为 2026 年 1 月 15 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 1 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0834 元，C 类基金份额净值 1.0815 元；基金份额总额 299,036,028.93 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 207,122,392.11 份，C 类基金份额总额 91,913,636.82 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 800 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		75,168,494.28
1.利息收入		2,006,562.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,132,740.87
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		873,821.57
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		57,539,379.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	47,136,882.51
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	7,625.10

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	6,664,983.65
股利收益	6.4.7.14	3,729,888.67
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	15,602,428.32
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	20,123.59
减：二、营业总支出		6,072,549.04
1. 管理人报酬		4,844,115.38
2. 托管费		908,271.65
3. 销售服务费		267,123.70
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		24,060.96
8. 其他费用	6.4.7.18	28,977.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		69,095,945.24
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		69,095,945.24
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		69,095,945.24

注：本基金合同生效日为 2026 年 1 月 15 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 1 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 800 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 15 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	2,150,185,530.27	-	2,150,185,530.27

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,851,149,501.34	24,768,457.27	-1,826,381,044.07
（一）、综合收益总额	-	69,095,945.24	69,095,945.24
（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）	-1,851,149,501.34	-44,327,487.97	-1,895,476,989.31
其中：1.基金申购款	220,232,839.95	8,935,592.88	229,168,432.83
2.基金赎回款	-2,071,382,341.29	-53,263,080.85	-2,124,645,422.14
（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	299,036,028.93	24,768,457.27	323,804,486.20

注：本基金合同生效日为 2026 年 1 月 15 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 1 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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 800 指数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[2025]2746 号《关于准予易方达中证 800 指数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 800 指数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 800 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2026 年 1 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,150,185,530.27 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,117,972.15 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2025 年 12 月 24 日至 2026 年 1 月 13 日，募集金额总额为人民币 2,150,185,530.27 元，其中：有效净认购金额为人民币 2,149,067,558.12 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 1,117,972.15 元，经安永华明(2026)验字第 70013033_G01 号验资报告予以审验。

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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2026 年 1 月 15 日(基金合同生效日)至 2026 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊

余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该

限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其

处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人履行适当程序后，可调整基金收益的分配原则和支付方式；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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》、国务院令第 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	38,566,245.33
等于：本金	38,559,876.37
加：应计利息	6,368.96
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	38,566,245.33

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		259,117,784.30	-	274,099,721.25	14,981,936.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	22,999.95	0.93	23,000.88	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	22,999.95	0.93	23,000.88	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	259,140,784.25	0.93	274,122,722.13	14,981,936.95

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	26,517,888.63	-	-	-
IC2612	8,165,600.00	-	-	-
IF2609	1,336,828.63	-	-	-
IF2612	17,015,460.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	26,517,888.63	-	-	-

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	5	8,542,400.00	376,800.00
IF2609	IF2609	1	1,454,940.00	118,111.37
IF2612	IF2612	12	17,141,040.00	125,580.00
合计	-	-	-	620,491.37
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	620,491.37
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	616.93
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	223,831.33
其中：交易所市场	223,831.33
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	28,546.98
合计	252,995.24

6.4.7.7 实收基金

易方达中证 800 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月15日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,954,701,316.29	1,954,701,316.29
本期申购	160,150,620.75	160,150,620.75
本期赎回（以“-”号填列）	-1,907,729,544.93	-1,907,729,544.93
本期末	207,122,392.11	207,122,392.11

易方达中证 800 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月15日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	195,484,213.98	195,484,213.98
本期申购	60,082,219.20	60,082,219.20

本期赎回（以“-”号填列）	-163,652,796.36	-163,652,796.36
本期末	91,913,636.82	91,913,636.82

注：1.本基金合同于 2026 年 1 月 15 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,150,185,530.27 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,117,972.15 份基金份额。

2.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 800 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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	40,743,230.58	19,457,739.11	60,200,969.69
本期基金份额交易产生的变动数	-18,364,490.40	-24,555,980.94	-42,920,471.34
其中：基金申购款	12,777,315.71	-5,192,967.16	7,584,348.55
基金赎回款	-31,141,806.11	-19,363,013.78	-50,504,819.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,378,740.18	-5,098,241.83	17,280,498.35

易方达中证 800 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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	12,750,286.34	-3,855,310.79	8,894,975.55
本期基金份额交易产生的变动数	-3,001,137.58	1,594,120.95	-1,407,016.63
其中：基金申购款	1,986,961.65	-635,717.32	1,351,244.33
基金赎回款	-4,988,099.23	2,229,838.27	-2,758,260.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,749,148.76	-2,261,189.84	7,487,958.92

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,046,104.51
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	85,072.10
其他	1,564.26
合计	1,132,740.87

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 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	47,136,882.51
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	47,136,882.51

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 15 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,647,621,855.02
减：卖出股票成本总额	2,598,257,904.03
减：交易费用	2,227,068.48
买卖股票差价收入	47,136,882.51

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15日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,623.57
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	7,625.10

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15日（基金合同生效日）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	16,624.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,999.98
减：应计利息总额	0.67
减：交易费用	0.66
买卖债券差价收入	7,623.57

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15日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股指期货投资收益	6,664,983.65

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月15日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,729,888.67
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	3,729,888.67

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15日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1.交易性金融资产	14,981,936.95
——股票投资	14,981,936.95
——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	620,491.37
——权证投资	-
——期货投资	620,491.37
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	15,602,428.32

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月15日（基金合同生效日）至2026年6月30日
基金赎回费收入	15,322.88
其他	4,800.71
合计	20,123.59

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15日（基金合同生效日）至2026年6月30日
审计费用	28,546.98
信息披露费	-
证券出借违约金	-
存托服务费	30.37
其他	400.00
合计	28,977.35

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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
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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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15日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,844,115.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,396,704.50
应支付基金管理人的净管理费	2,447,410.88

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月15日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	908,271.65

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

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15日（基金合同生效日）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800增强A	易方达中证800增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,861.90	1,861.90
中国邮政储蓄银行	-	14,727.01	14,727.01
易方达财富	-	2,985.03	2,985.03
合计	-	19,573.94	19,573.94

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 0.40%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计提，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，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系基金托管人协商解决。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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 800 增强 A

无。

易方达中证 800 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 2026年1月15日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行-活期存款	38,566,245.33	1,046,104.51

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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15日（基金合同生效日）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

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 800 增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 800 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
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	2026-06-24	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	5,550	56,110.50	56,110.50	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	12,952	130,944.72	130,944.72	-
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	-
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	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-

				受限						
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	154	6,862.24	72,175.18	-
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	有研复材	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	-
68882	盛合	2026-0	6 个月	新股	19.68	141.49	2,391	47,054	338,30	-

0	晶微	4-13		流通受限				.88	2.59	
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月以内	新股流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
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
111025	圣泉转债	2026-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.01	-
113704	春风转债	2026-06-11	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	190	19,000.00	19,000.83	-
118071	华峰转债	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.04	-

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
300214	日科化学	2026-06-29	重大事项停牌	10.25	2026-07-13	12.30	800	6,458.00	8,200.00	-
300332	天壕能源	2026-06-26	重大事项停牌	4.30	2026-07-09	4.64	1,600	8,427.90	6,880.00	-
603137	恒尚节能	2026-06-16	重大事项停牌	12.94	2026-07-01	14.23	1,100	14,053.00	14,234.00	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	2,238	1,453,427.46	1,968,388.14	-

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。

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

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。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 0.01%。

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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
AAA	0.00
AAA 以下	23,000.88
未评级	0.00
合计	23,000.88

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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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	38,566,245.33	-	-	-	38,566,245.33
结算备付金	6,740,978.20	-	-	-	6,740,978.20
存出保证金	4,458,133.51	-	-	-	4,458,133.51
交易性金融资产	-	-	23,000.88	274,099,721.25	274,122,722.13
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	10,052,851.26	10,052,851.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	49,765,357.04	-	23,000.88	284,152,572.51	333,940,930.43
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	-	-	-	7,415,769.51	7,415,769.51
应付赎回款	-	-	-	2,127,766.01	2,127,766.01
应付管理人报酬	-	-	-	224,906.30	224,906.30
应付托管费	-	-	-	42,169.92	42,169.92
应付销售服务费	-	-	-	35,487.64	35,487.64
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	37,349.61	37,349.61
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	252,995.24	252,995.24
负债总计	-	-	-	10,136,444.23	10,136,444.23
利率敏感度缺口	49,765,357.04	-	23,000.88	274,016,128.28	323,804,486.20

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	274,099,721.25	84.65
交易性金融资产—债券投资	23,000.88	0.01
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	274,122,722.13	84.66

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
	1.业绩比较基准上升 5%	15,254,502.20
	2.业绩比较基准下降 5%	-15,254,502.20

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	269,974,234.60
第二层次	2,210,314.24
第三层次	1,938,173.29
合计	274,122,722.13

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	274,099,721.25	82.08
	其中：股票	274,099,721.25	82.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,000.88	0.01
	其中：债券	23,000.88	0.01
	资产支持证券	-	-
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	45,307,223.53	13.57
8	其他各项资产	14,510,984.77	4.35
9	合计	333,940,930.43	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	633,116.65	0.20
B	采矿业	9,939,143.95	3.07
C	制造业	167,351,158.20	51.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,208,499.58	1.61
E	建筑业	2,256,526.13	0.70
F	批发和零售业	3,047,376.05	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	5,444,752.48	1.68
H	住宿和餐饮业	233,870.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,970,930.54	4.31
J	金融业	37,435,526.09	11.56
K	房地产业	905,588.00	0.28
L	租赁和商务服务业	1,374,622.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	2,880,915.10	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	666,081.80	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	138,129.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	580,966.00	0.18
S	综合	-	-

	合计	252,067,201.57	77.85
--	----	----------------	-------

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	499,520.40	0.15
B	采矿业	195,018.82	0.06
C	制造业	16,997,125.54	5.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	276,372.22	0.09
E	建筑业	282,684.00	0.09
F	批发和零售业	552,348.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	224,788.00	0.07
H	住宿和餐饮业	9,108.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,381,219.36	0.43
J	金融业	27,867.00	0.01
K	房地产业	325,191.00	0.10
L	租赁和商务服务业	65,058.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	488,401.80	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	449,383.54	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	116,612.00	0.04
Q	卫生和社会工作	34,431.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	90,601.00	0.03
S	综合	16,790.00	0.01
	合计	22,032,519.68	6.80

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	300308	中际旭创	8,200	10,414,000.00	3.22
2	300750	宁德时代	20,600	8,096,006.00	2.50

3	688256	寒武纪	3,084	4,920,676.20	1.52
4	300502	新易盛	7,393	4,487,551.00	1.39
5	600519	贵州茅台	3,658	4,336,522.42	1.34
6	601318	中国平安	78,600	3,752,364.00	1.16
7	603986	兆易创新	4,500	3,667,500.00	1.13
8	688012	中微公司	7,744	3,628,064.00	1.12
9	600036	招商银行	90,300	3,205,650.00	0.99
10	002371	北方华创	3,500	3,095,960.00	0.96
11	688008	澜起科技	8,845	2,741,065.50	0.85
12	000333	美的集团	35,816	2,705,182.48	0.84
13	601899	紫金矿业	103,000	2,589,420.00	0.80
14	600030	中信证券	86,045	2,472,072.85	0.76
15	002475	立讯精密	34,600	2,435,840.00	0.75
16	688981	中芯国际	14,413	2,289,072.66	0.71
17	603259	药明康德	18,000	2,241,180.00	0.69
18	002384	东山精密	8,200	2,151,270.00	0.66
19	601138	工业富联	28,700	2,070,705.00	0.64
20	601166	兴业银行	122,600	2,030,256.00	0.63
21	600183	生益科技	11,400	1,976,760.00	0.61
22	688072	拓荆科技	2,238	1,968,388.14	0.61
23	688041	海光信息	4,938	1,828,541.40	0.56
24	600900	长江电力	65,374	1,730,449.78	0.53
25	300408	三环集团	10,350	1,727,415.00	0.53
26	601398	工商银行	230,500	1,629,635.00	0.50
27	601328	交通银行	245,300	1,577,279.00	0.49
28	300604	长川科技	4,400	1,502,248.00	0.46
29	000725	京东方 A	171,400	1,487,752.00	0.46
30	600150	中国船舶	43,100	1,456,349.00	0.45
31	600887	伊利股份	59,500	1,425,620.00	0.44
32	688521	芯原股份	3,838	1,424,435.32	0.44
33	002463	沪电股份	8,900	1,359,920.00	0.42
34	601211	国泰海通	74,300	1,352,260.00	0.42
35	301308	江波龙	1,900	1,337,220.00	0.41
36	000338	潍柴动力	49,000	1,335,250.00	0.41
37	002415	海康威视	38,000	1,299,600.00	0.40
38	300223	北京君正	5,200	1,294,280.00	0.40
39	002916	深南电路	2,800	1,282,120.00	0.40
40	300475	香农芯创	3,900	1,170,000.00	0.36
41	600276	恒瑞医药	21,700	1,129,268.00	0.35
42	600309	万华化学	16,500	1,128,765.00	0.35
43	600919	江苏银行	103,700	1,117,886.00	0.35
44	300059	东方财富	54,800	1,116,824.00	0.34
45	300857	协创数据	3,280	1,114,872.00	0.34
46	601288	农业银行	183,200	1,112,024.00	0.34

47	000651	格力电器	29,300	1,098,750.00	0.34
48	300476	胜宏科技	3,100	1,073,933.00	0.33
49	600176	中国巨石	14,400	1,049,472.00	0.32
50	000001	平安银行	103,800	1,043,190.00	0.32
51	001309	德明利	1,100	1,037,190.00	0.32
52	688498	源杰科技	543	1,024,098.00	0.32
53	300274	阳光电源	6,200	985,924.00	0.30
54	603993	洛阳钼业	55,900	981,045.00	0.30
55	002594	比亚迪	12,300	980,310.00	0.30
56	600549	厦门钨业	11,500	979,800.00	0.30
57	002602	世纪华通	68,100	960,210.00	0.30
58	300394	天孚通信	3,080	932,254.40	0.29
59	601688	华泰证券	43,500	896,970.00	0.28
60	600522	中天科技	14,500	879,860.00	0.27
61	688347	华虹宏力	2,588	870,344.40	0.27
62	002008	大族激光	5,700	855,627.00	0.26
63	000988	华工科技	4,400	812,284.00	0.25
64	000938	紫光股份	27,900	805,194.00	0.25
65	688002	睿创微纳	5,083	786,289.27	0.24
66	000100	TCL 科技	134,800	784,536.00	0.24
67	603799	华友钴业	16,100	776,986.00	0.24
68	600000	浦发银行	89,400	769,734.00	0.24
69	688396	华润微	7,869	767,620.95	0.24
70	300014	亿纬锂能	11,600	754,348.00	0.23
71	601872	招商轮船	41,244	724,657.08	0.22
72	601169	北京银行	147,100	720,790.00	0.22
73	002281	光迅科技	2,800	719,432.00	0.22
74	002648	卫星化学	29,900	702,351.00	0.22
75	600938	中国海油	25,700	697,755.00	0.22
76	601857	中国石油	80,200	696,136.00	0.21
77	300373	扬杰科技	4,400	691,812.00	0.21
78	601600	中国铝业	82,100	674,862.00	0.21
79	002466	天齐锂业	11,000	674,520.00	0.21
80	002709	天赐材料	13,100	673,733.00	0.21
81	002460	赣锋锂业	10,300	673,620.00	0.21
82	601009	南京银行	66,900	661,641.00	0.20
83	688111	金山办公	3,104	661,307.20	0.20
84	000807	云铝股份	29,600	655,344.00	0.20
85	300661	圣邦股份	4,500	645,660.00	0.20
86	000408	藏格矿业	9,300	644,676.00	0.20
87	605117	德业股份	6,060	643,450.80	0.20
88	001389	广合科技	2,700	640,575.00	0.20
89	000657	中钨高新	6,600	631,752.00	0.20
90	600489	中金黄金	34,700	626,335.00	0.19

91	002558	巨人网络	22,500	620,100.00	0.19
92	300548	长芯博创	2,200	611,600.00	0.19
93	688702	盛科通信	1,510	588,884.90	0.18
94	600482	中国动力	17,900	587,120.00	0.18
95	000858	五粮液	7,900	584,600.00	0.18
96	601995	中金公司	16,100	582,015.00	0.18
97	300390	天华新能	6,200	579,762.00	0.18
98	000783	长江证券	59,400	579,150.00	0.18
99	002738	中矿资源	9,600	566,304.00	0.17
100	300458	全志科技	14,320	565,067.20	0.17
101	688220	翱捷科技	4,502	559,688.64	0.17
102	600028	中国石化	125,400	559,284.00	0.17
103	002236	大华股份	33,784	557,098.16	0.17
104	688578	艾力斯	5,041	550,477.20	0.17
105	002142	宁波银行	18,400	546,296.00	0.17
106	601066	中信建投	18,600	540,702.00	0.17
107	600426	华鲁恒升	22,600	540,592.00	0.17
108	600989	宝丰能源	26,500	538,745.00	0.17
109	301358	湖南裕能	7,100	538,677.00	0.17
110	002028	思源电气	3,100	536,300.00	0.17
111	002532	天山铝业	49,300	528,989.00	0.16
112	600584	长电科技	5,100	528,105.00	0.16
113	600031	三一重工	30,500	527,040.00	0.16
114	601006	大秦铁路	114,300	526,923.00	0.16
115	300037	新宙邦	5,600	519,960.00	0.16
116	603019	中科曙光	4,800	514,704.00	0.16
117	600601	方正科技	37,100	513,464.00	0.16
118	600019	宝钢股份	94,500	513,135.00	0.16
119	601360	三六零	58,700	510,103.00	0.16
120	601816	京沪高铁	112,500	509,625.00	0.16
121	601601	中国太保	17,700	504,804.00	0.16
122	002202	金风科技	21,100	504,290.00	0.16
123	600089	特变电工	22,300	501,750.00	0.15
124	601117	中国化学	68,100	500,535.00	0.15
125	600346	恒力石化	28,000	495,880.00	0.15
126	000703	恒逸石化	35,800	485,806.00	0.15
127	688037	芯源微	1,095	480,759.75	0.15
128	600026	中远海能	26,700	478,998.00	0.15
129	301536	星辰科技	3,700	476,227.00	0.15
130	002493	荣盛石化	44,100	474,075.00	0.15
131	688200	华峰测控	902	473,640.20	0.15
132	600497	驰宏锌锗	38,900	471,079.00	0.15
133	002966	苏州银行	67,500	469,800.00	0.15
134	688629	华丰科技	2,479	464,837.29	0.14

135	601225	陕西煤业	22,700	461,945.00	0.14
136	600233	圆通速递	29,300	461,475.00	0.14
137	002271	东方雨虹	38,800	460,556.00	0.14
138	002353	杰瑞股份	3,000	457,500.00	0.14
139	000301	东方盛虹	39,900	456,855.00	0.14
140	601988	中国银行	79,600	455,312.00	0.14
141	601233	桐昆股份	21,000	454,650.00	0.14
142	600352	浙江龙盛	37,300	451,703.00	0.14
143	300073	当升科技	9,400	451,576.00	0.14
144	600886	国投电力	33,700	448,547.00	0.14
145	600104	上汽集团	45,700	446,032.00	0.14
146	002414	高德红外	33,300	441,558.00	0.14
147	688728	格科微	20,968	441,166.72	0.14
148	600741	华域汽车	28,400	440,768.00	0.14
149	601998	中信银行	63,500	440,055.00	0.14
150	600926	杭州银行	30,400	439,280.00	0.14
151	002266	浙富控股	86,700	438,702.00	0.14
152	600885	宏发股份	12,500	431,125.00	0.13
153	000063	中兴通讯	11,900	430,661.00	0.13
154	601100	恒立液压	4,000	430,240.00	0.13
155	601888	中国中免	8,000	429,680.00	0.13
156	300919	中伟新材	9,800	428,750.00	0.13
157	002812	恩捷股份	6,400	428,224.00	0.13
158	000425	徐工机械	52,800	427,152.00	0.13
159	300124	汇川技术	6,400	424,512.00	0.13
160	002756	永兴材料	7,300	413,472.00	0.13
161	688469	芯联集成	38,933	413,079.13	0.13
162	601229	上海银行	47,400	411,432.00	0.13
163	603659	璞泰来	13,900	402,127.00	0.12
164	600048	保利发展	86,300	399,569.00	0.12
165	600111	北方稀土	8,300	398,815.00	0.12
166	601088	中国神华	10,200	398,208.00	0.12
167	000987	越秀资本	50,900	398,038.00	0.12
168	000415	渤海租赁	97,700	397,639.00	0.12
169	002850	科达利	2,100	397,530.00	0.12
170	300450	先导智能	9,700	394,984.00	0.12
171	601668	中国建筑	89,700	389,298.00	0.12
172	000983	山西焦煤	66,800	387,440.00	0.12
173	601939	建设银行	40,200	387,126.00	0.12
174	600499	科达制造	28,000	386,400.00	0.12
175	301377	鼎泰高科	700	385,630.00	0.12
176	300012	华测检测	27,800	385,308.00	0.12
177	601869	长飞光纤	700	382,130.00	0.12
178	600595	中孚实业	67,980	382,047.60	0.12

179	688331	荣昌生物	2,923	380,749.98	0.12
180	003031	中瓷电子	2,100	378,630.00	0.12
181	603345	安井食品	4,700	376,893.00	0.12
182	002487	大金重工	6,500	376,805.00	0.12
183	601577	长沙银行	42,900	373,659.00	0.12
184	601788	光大证券	25,700	370,851.00	0.11
185	601058	赛轮轮胎	32,100	370,113.00	0.11
186	000423	东阿阿胶	8,000	362,880.00	0.11
186	000683	博源化工	63,000	362,880.00	0.11
188	000951	中国重汽	18,400	358,984.00	0.11
189	300136	信维通信	3,000	357,750.00	0.11
190	600999	招商证券	16,900	356,590.00	0.11
191	601696	中银证券	28,000	354,200.00	0.11
192	000629	钒钛股份	105,100	351,034.00	0.11
193	000708	中信特钢	27,800	350,836.00	0.11
194	688778	厦钨新能	6,416	349,030.40	0.11
195	600166	福田汽车	119,900	348,909.00	0.11
196	601077	渝农商行	57,100	348,881.00	0.11
197	300953	震裕科技	2,600	347,620.00	0.11
198	300972	万辰集团	2,000	346,820.00	0.11
199	000975	山金国际	20,400	346,800.00	0.11
200	600109	国金证券	39,400	345,932.00	0.11
201	603256	宏和科技	1,300	344,929.00	0.11
202	688188	柏楚电子	3,227	344,320.90	0.11
203	603308	应流股份	5,700	344,280.00	0.11
204	601607	上海医药	22,200	341,880.00	0.11
205	688235	百济神州	1,342	341,686.62	0.11
206	002821	凯莱英	2,100	340,200.00	0.11
207	601618	中国中冶	138,800	338,672.00	0.10
208	600016	民生银行	104,900	337,778.00	0.10
209	600884	杉杉股份	24,900	337,395.00	0.10
210	002938	鹏鼎控股	3,200	337,216.00	0.10
211	002120	韵达股份	53,000	337,080.00	0.10
212	603699	纽威股份	6,700	337,010.00	0.10
213	688615	合合信息	2,970	335,907.00	0.10
214	601728	中国电信	64,600	335,274.00	0.10
215	601997	贵阳银行	65,300	334,989.00	0.10
216	688472	阿特斯	30,910	334,446.20	0.10
217	300395	菲利华	2,500	334,325.00	0.10
218	002078	太阳纸业	26,700	333,483.00	0.10
219	600177	雅戈尔	43,100	324,543.00	0.10
220	601699	潞安环能	22,500	321,300.00	0.10
221	002064	华峰化学	33,800	320,762.00	0.10
222	002027	分众传媒	66,100	319,924.00	0.10

223	002273	水晶光电	9,000	319,320.00	0.10
224	600535	天士力	24,100	318,843.00	0.10
225	002603	以岭药业	21,100	316,500.00	0.10
226	300760	迈瑞医疗	2,300	312,409.00	0.10
227	600875	东方电气	10,700	307,839.00	0.10
228	300432	富临精工	15,300	307,377.00	0.09
229	600606	绿地控股	250,953	303,653.13	0.09
230	688475	萤石网络	11,093	303,393.55	0.09
231	601877	正泰电器	12,100	303,347.00	0.09
232	600061	国投资本	46,300	303,265.00	0.09
233	600660	福耀玻璃	6,001	302,690.44	0.09
234	600941	中国移动	3,500	301,455.00	0.09
235	300442	润泽科技	3,600	299,052.00	0.09
236	000786	北新建材	16,500	298,485.00	0.09
237	600598	北大荒	27,400	297,016.00	0.09
238	600546	山煤国际	27,100	296,203.00	0.09
239	600050	中国联通	73,500	294,000.00	0.09
240	002841	视源股份	8,500	293,505.00	0.09
241	601766	中国中车	56,100	291,720.00	0.09
242	603077	和邦生物	125,700	291,624.00	0.09
243	000792	盐湖股份	9,600	289,824.00	0.09
244	601665	齐鲁银行	50,100	289,077.00	0.09
245	002299	圣农发展	19,000	288,040.00	0.09
246	600655	豫园股份	69,400	285,234.00	0.09
247	600801	华新建材	18,200	283,920.00	0.09
248	000800	一汽解放	47,700	283,815.00	0.09
249	002340	格林美	42,900	283,569.00	0.09
250	688120	华海清科	877	282,551.86	0.09
251	000027	深圳能源	45,300	280,860.00	0.09
252	301606	绿联科技	4,600	280,692.00	0.09
253	601139	深圳燃气	49,500	280,170.00	0.09
254	600329	达仁堂	7,500	279,150.00	0.09
255	601000	唐山港	66,300	275,145.00	0.08
256	688617	惠泰医疗	1,513	274,700.28	0.08
257	600995	南网储能	22,300	274,290.00	0.08
258	000959	首钢股份	78,100	274,131.00	0.08
259	002032	苏泊尔	6,900	273,240.00	0.08
260	000709	河钢股份	140,500	272,570.00	0.08
261	600062	华润双鹤	16,900	271,076.00	0.08
262	603233	大参林	17,835	268,060.05	0.08
263	600927	永安期货	21,100	262,695.00	0.08
264	600460	士兰微	4,800	262,368.00	0.08
265	300033	同花顺	1,080	260,280.00	0.08
266	600008	首创环保	95,540	259,868.80	0.08

267	603565	中谷物流	26,400	258,984.00	0.08
268	601336	新华保险	4,300	256,538.00	0.08
269	600348	华阳股份	33,400	255,510.00	0.08
270	601156	东航物流	15,700	253,084.00	0.08
271	600380	健康元	26,800	252,456.00	0.08
272	600398	海澜之家	48,200	252,086.00	0.08
273	300957	贝泰妮	8,000	252,080.00	0.08
274	603444	吉比特	700	250,894.00	0.08
275	001286	陕西能源	24,300	246,402.00	0.08
276	688692	达梦数据	990	241,847.10	0.07
277	002001	新和成	8,500	241,570.00	0.07
278	600011	华能国际	31,800	241,362.00	0.07
279	300146	汤臣倍健	26,600	240,464.00	0.07
280	002423	中粮资本	29,200	240,316.00	0.07
281	600015	华夏银行	37,600	240,264.00	0.07
282	002465	海格通信	18,600	237,522.00	0.07
283	600196	复星医药	10,500	235,935.00	0.07
284	601098	中南传媒	23,800	234,192.00	0.07
285	600754	锦江酒店	13,000	233,870.00	0.07
286	600566	济川药业	10,500	232,995.00	0.07
287	601919	中远海控	17,400	230,724.00	0.07
288	603129	春风动力	900	230,220.00	0.07
289	600663	陆家嘴	36,600	229,848.00	0.07
290	002050	三花智控	5,100	223,533.00	0.07
291	300567	精测电子	700	222,320.00	0.07
292	000630	铜陵有色	34,500	219,420.00	0.07
293	601019	山东出版	34,100	218,240.00	0.07
294	000538	云南白药	4,600	217,902.00	0.07
295	000166	申万宏源	49,400	217,360.00	0.07
296	603288	海天味业	6,500	215,540.00	0.07
297	003816	中国广核	55,100	215,441.00	0.07
298	000895	双汇发展	9,600	215,040.00	0.07
299	300140	节能环保	42,900	213,213.00	0.07
300	600685	中船防务	8,300	211,152.00	0.07
301	603939	益丰药房	11,600	208,568.00	0.06
302	688361	中科飞测	477	205,110.00	0.06
303	002402	和而泰	7,900	204,057.00	0.06
304	300803	指南针	2,200	201,674.00	0.06
305	300054	鼎龙股份	1,900	201,343.00	0.06
306	600795	国电电力	42,600	198,942.00	0.06
307	000750	国海证券	54,000	198,720.00	0.06
308	600372	中航机载	18,200	197,470.00	0.06
309	002714	牧原股份	5,635	197,168.65	0.06
310	002625	光启技术	6,400	194,048.00	0.06

311	601818	光大银行	66,600	192,474.00	0.06
312	600406	国电南瑞	8,400	191,940.00	0.06
313	001203	大中矿业	6,381	191,110.95	0.06
314	300759	康龙化成	6,600	190,938.00	0.06
315	000039	中集集团	23,500	190,585.00	0.06
316	000519	中兵红箭	9,000	189,630.00	0.06
317	600486	扬农化工	3,700	187,590.00	0.06
318	002600	领益智造	10,600	183,804.00	0.06
319	601111	中国国航	29,800	180,290.00	0.06
320	600690	海尔智家	8,700	177,567.00	0.05
321	601186	中国铁建	29,300	174,335.00	0.05
322	300496	中科创达	2,800	173,012.00	0.05
323	300763	锦浪科技	1,900	171,665.00	0.05
324	600298	安琪酵母	4,700	170,140.00	0.05
325	688271	联影医疗	1,673	169,357.79	0.05
326	600820	隧道股份	32,000	166,720.00	0.05
327	601012	隆基绿能	12,700	166,624.00	0.05
328	300433	蓝思科技	3,100	166,346.00	0.05
329	002179	中航光电	3,600	166,320.00	0.05
330	600901	江苏金租	28,800	165,600.00	0.05
331	601878	浙商证券	17,300	164,350.00	0.05
332	603501	豪威集团	1,700	161,245.00	0.05
333	600803	新奥股份	10,200	161,160.00	0.05
334	600362	江西铜业	3,700	160,210.00	0.05
335	002049	紫光国微	1,800	159,750.00	0.05
336	002926	华西证券	19,300	157,681.00	0.05
337	300474	景嘉微	2,600	157,248.00	0.05
338	003022	联泓新科	6,000	155,400.00	0.05
339	688385	复旦微电	2,170	154,699.30	0.05
340	002126	银轮股份	3,100	154,380.00	0.05
341	688387	信科移动	7,767	154,097.28	0.05
342	601901	方正证券	21,400	154,080.00	0.05
343	000977	浪潮信息	2,200	154,000.00	0.05
344	600115	中国东航	40,400	153,924.00	0.05
345	600295	鄂尔多斯	14,300	153,296.00	0.05
346	600188	兖矿能源	8,600	152,822.00	0.05
347	603893	瑞芯微	800	150,688.00	0.05
348	601825	沪农商行	19,800	148,302.00	0.05
349	600893	航发动力	3,800	145,692.00	0.04
350	300628	亿联网络	4,300	145,426.00	0.04
351	002025	航天电器	1,900	144,818.00	0.04
352	600765	中航重机	11,200	144,704.00	0.04
353	000429	粤高速 A	10,500	143,325.00	0.04
354	000893	亚钾国际	3,500	143,115.00	0.04

355	601916	浙商银行	54,100	142,283.00	0.04
356	002500	山西证券	27,500	141,900.00	0.04
357	600221	海航控股	104,600	141,210.00	0.04
358	689009	九号公司	3,620	138,103.00	0.04
359	300699	光威复材	4,800	137,520.00	0.04
360	600029	南方航空	26,400	136,752.00	0.04
361	600027	华电国际	30,600	136,170.00	0.04
362	600219	南山铝业	34,000	135,660.00	0.04
363	603486	科沃斯	2,600	131,950.00	0.04
364	603766	隆鑫通用	10,800	128,844.00	0.04
365	601377	兴业证券	21,300	128,652.00	0.04
366	601127	赛力斯	2,100	128,625.00	0.04
367	002230	科大讯飞	3,100	126,604.00	0.04
368	600704	物产中大	26,700	126,024.00	0.04
369	002352	顺丰控股	4,000	125,040.00	0.04
370	600369	西南证券	31,000	124,620.00	0.04
371	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.04
372	000963	华东医药	4,400	123,728.00	0.04
373	300207	欣旺达	6,500	123,435.00	0.04
374	603160	汇顶科技	2,000	123,420.00	0.04
375	600339	中油工程	40,200	123,414.00	0.04
376	603737	三棵树	5,040	121,464.00	0.04
377	688099	晶晨股份	1,179	121,319.10	0.04
378	688180	君实生物	3,568	120,669.76	0.04
379	688036	传音控股	2,014	118,725.30	0.04
380	002074	国轩高科	4,300	118,293.00	0.04
381	000155	川能动力	9,800	117,404.00	0.04
382	002851	麦格米特	700	117,026.00	0.04
383	000157	中联重科	16,700	116,399.00	0.04
384	000568	泸州老窖	1,500	116,280.00	0.04
385	300498	温氏股份	9,400	115,808.00	0.04
386	300751	迈为股份	400	112,984.00	0.03
387	301165	锐捷网络	1,400	112,630.00	0.03
388	601128	常熟银行	19,210	111,802.20	0.03
389	600845	宝信软件	6,700	111,421.00	0.03
390	603899	晨光股份	5,400	111,402.00	0.03
391	300666	江丰电子	300	110,580.00	0.03
392	002152	广电运通	11,500	107,870.00	0.03
393	603688	石英股份	1,300	107,393.00	0.03
394	600392	盛和资源	3,600	107,172.00	0.03
395	300999	金龙鱼	4,600	106,996.00	0.03
396	601555	东吴证券	13,300	105,336.00	0.03
397	002195	岩山科技	15,500	101,370.00	0.03
398	300413	芒果超媒	6,900	100,947.00	0.03

399	600711	盛屯矿业	9,100	99,827.00	0.03
400	601108	财通证券	11,400	98,610.00	0.03
401	601106	中国一重	29,800	98,340.00	0.03
402	300017	网宿科技	7,500	97,575.00	0.03
403	002436	兴森科技	1,900	96,805.00	0.03
404	600066	宇通客车	3,600	96,516.00	0.03
405	000021	深科技	1,500	96,405.00	0.03
406	601608	中信重工	20,200	96,354.00	0.03
407	688301	奕瑞科技	776	96,224.00	0.03
408	000617	中油资本	14,600	96,214.00	0.03
409	600143	金发科技	6,200	95,790.00	0.03
410	300383	光环新网	7,700	95,788.00	0.03
411	002130	沃尔核材	5,000	94,800.00	0.03
412	601985	中国核电	10,300	93,009.00	0.03
413	002432	九安医疗	1,300	91,884.00	0.03
414	688172	燕东微	1,083	90,603.78	0.03
415	002335	科华数据	2,130	90,418.50	0.03
416	600160	巨化股份	1,700	90,117.00	0.03
417	603179	新泉股份	1,800	89,370.00	0.03
418	600521	华海药业	6,200	89,280.00	0.03
419	002311	海大集团	2,000	89,220.00	0.03
420	600699	均胜电子	4,100	88,601.00	0.03
421	000661	长春高新	1,300	86,580.00	0.03
422	600918	中泰证券	16,200	86,184.00	0.03
423	300015	爱尔眼科	10,400	85,904.00	0.03
424	601628	中国人寿	2,400	84,840.00	0.03
425	600153	建发股份	10,600	84,058.00	0.03
426	002304	洋河股份	2,200	83,930.00	0.03
427	300866	安克创新	800	83,600.00	0.03
428	600515	海南机场	30,300	83,022.00	0.03
429	002568	百润股份	4,900	82,908.00	0.03
430	603606	东方电缆	1,980	82,189.80	0.03
431	002683	广东宏大	2,800	82,012.00	0.03
432	302132	中航成飞	1,400	81,648.00	0.03
433	688126	沪硅产业	2,035	81,176.15	0.03
434	600674	川投能源	5,700	80,769.00	0.02
435	000921	海信家电	2,900	79,228.00	0.02
436	688676	金盘科技	931	78,799.84	0.02
437	601456	国联民生	8,900	78,676.00	0.02
438	601018	宁波港	24,600	77,490.00	0.02
439	601399	国机重装	22,000	77,000.00	0.02
440	600809	山西汾酒	700	76,559.00	0.02
441	688169	石头科技	806	76,545.82	0.02
442	603338	浙江鼎力	1,800	76,500.00	0.02

443	300623	捷捷微电	1,700	76,483.00	0.02
444	002155	湖南黄金	3,200	76,384.00	0.02
445	603379	三美股份	1,000	75,890.00	0.02
446	300832	新产业	1,800	75,600.00	0.02
447	601898	中煤能源	6,200	75,516.00	0.02
448	002153	石基信息	10,400	75,192.00	0.02
449	600039	四川路桥	9,600	75,072.00	0.02
450	601198	东兴证券	5,500	74,745.00	0.02
451	600312	平高电气	4,200	74,172.00	0.02
452	000528	柳工	9,800	73,990.00	0.02
453	601689	拓普集团	1,300	73,346.00	0.02
454	601238	广汽集团	14,300	72,644.00	0.02
455	301200	大族数控	200	72,130.00	0.02
456	000596	古井贡酒	900	71,820.00	0.02
457	000739	普洛药业	4,300	71,638.00	0.02
458	601800	中国交建	12,400	70,804.00	0.02
459	688599	天合光能	4,968	70,148.16	0.02
460	002131	利欧股份	14,700	69,825.00	0.02
461	001979	招商蛇口	10,800	69,444.00	0.02
462	002185	华天科技	3,100	69,161.00	0.02
463	601838	成都银行	3,900	69,030.00	0.02
464	300142	沃森生物	5,300	68,847.00	0.02
465	002409	雅克科技	300	67,350.00	0.02
466	300454	深信服	700	67,340.00	0.02
467	688777	中控技术	570	66,975.00	0.02
468	000878	云南铜业	4,200	66,696.00	0.02
469	601880	辽港股份	48,200	66,516.00	0.02
470	688349	三一重能	4,340	65,881.20	0.02
471	002429	兆驰股份	6,300	65,457.00	0.02
472	603979	金诚信	1,100	64,933.00	0.02
473	300346	南大光电	700	64,855.00	0.02
474	000960	锡业股份	1,500	64,035.00	0.02
475	601021	春秋航空	1,380	62,900.40	0.02
476	300677	英科医疗	1,600	62,672.00	0.02
477	603087	甘李药业	1,100	62,436.00	0.02
478	002444	巨星科技	2,000	62,200.00	0.02
479	688223	晶科能源	13,088	62,168.00	0.02
480	601390	中国中铁	14,900	62,133.00	0.02
481	688819	天能股份	2,771	61,516.20	0.02
482	002407	多氟多	1,200	60,276.00	0.02
483	600642	申能股份	6,900	60,237.00	0.02
484	600009	上海机场	2,600	60,060.00	0.02
485	000728	国元证券	8,000	59,920.00	0.02
486	688411	海博思创	203	59,113.60	0.02

487	600098	广州发展	10,000	59,100.00	0.02
488	600021	上海电力	3,900	58,773.00	0.02
489	601059	信达证券	3,600	58,284.00	0.02
490	300144	宋城演艺	10,000	58,100.00	0.02
491	688561	奇安信	2,420	58,031.60	0.02
492	000883	湖北能源	13,400	57,888.00	0.02
493	600547	山东黄金	2,500	57,725.00	0.02
494	688018	乐鑫科技	451	57,691.92	0.02
495	600958	东方证券	6,100	57,584.00	0.02
496	600010	包钢股份	25,800	57,534.00	0.02
497	001965	招商公路	6,200	56,792.00	0.02
498	300001	特锐德	1,500	56,745.00	0.02
499	688313	仕佳光子	307	56,687.55	0.02
500	002252	上海莱士	13,000	56,420.00	0.02
501	600060	海信视像	2,000	55,740.00	0.02
502	600282	南钢股份	12,100	55,539.00	0.02
503	600988	赤峰黄金	2,100	55,272.00	0.02
504	601669	中国电建	11,700	54,990.00	0.02
505	603298	杭叉集团	2,300	54,878.00	0.02
506	600436	片仔癀	500	54,640.00	0.02
507	600585	海螺水泥	3,200	54,240.00	0.02
508	000062	深圳华强	1,700	54,094.00	0.02
509	600105	永鼎股份	800	53,984.00	0.02
510	603156	养元饮品	1,100	53,977.00	0.02
511	603049	中策橡胶	1,200	53,772.00	0.02
512	600316	洪都航空	1,900	53,086.00	0.02
513	600808	马钢股份	21,100	52,750.00	0.02
514	600637	东方明珠	6,300	52,353.00	0.02
515	300735	光弘科技	2,300	52,302.00	0.02
516	600332	白云山	2,600	52,104.00	0.02
517	600985	淮北矿业	3,700	51,985.00	0.02
518	002241	歌尔股份	2,300	51,819.00	0.02
519	300285	国瓷材料	500	51,590.00	0.02
520	002673	西部证券	7,896	51,245.04	0.02
521	600998	九州通	10,900	51,121.00	0.02
522	601567	三星电气	3,400	50,796.00	0.02
523	605499	东鹏饮料	410	50,606.30	0.02
524	601958	金钼股份	1,800	50,598.00	0.02
525	600737	中粮糖业	4,100	50,553.00	0.02
526	002422	科伦药业	1,300	50,076.00	0.02
527	688187	时代电气	729	50,053.14	0.02
528	600256	广汇能源	9,900	48,906.00	0.02
529	600562	国睿科技	2,300	48,806.00	0.02
530	603806	福斯特	2,900	48,691.00	0.02

531	000932	华菱钢铁	13,800	47,886.00	0.01
532	600390	五矿资本	10,500	47,880.00	0.01
533	688192	迪哲医药	1,196	47,756.28	0.01
534	300003	乐普医疗	4,000	47,400.00	0.01
535	000997	新大陆	2,900	47,270.00	0.01
536	600511	国药股份	1,800	46,872.00	0.01
537	600208	衢州发展	16,500	46,695.00	0.01
538	301526	国际复材	1,000	46,670.00	0.01
539	002065	东华软件	6,500	46,410.00	0.01
540	601212	白银有色	9,100	46,228.00	0.01
541	002736	国信证券	4,600	45,954.00	0.01
542	000738	航发控制	2,500	45,725.00	0.01
543	600760	中航沈飞	1,100	45,210.00	0.01
544	603786	科博达	1,100	45,001.00	0.01
545	600100	同方股份	6,500	44,525.00	0.01
546	000830	鲁西化工	3,700	44,400.00	0.01
547	300418	昆仑万维	1,100	44,396.00	0.01
548	300058	蓝色光标	3,200	44,032.00	0.01
549	601228	广州港	15,500	43,710.00	0.01
550	601666	平煤股份	5,900	42,185.00	0.01
551	600483	福能股份	4,100	41,779.00	0.01
552	600085	同仁堂	1,800	41,598.00	0.01
553	601868	中国能建	15,500	41,385.00	0.01
554	600967	内蒙一机	3,800	41,230.00	0.01
555	300487	蓝晓科技	700	41,195.00	0.01
556	600763	通策医疗	1,200	40,656.00	0.01
557	601727	上海电气	5,800	40,600.00	0.01
558	301498	乖宝宠物	1,000	40,590.00	0.01
559	000999	华润三九	1,800	40,482.00	0.01
560	000513	丽珠集团	1,400	40,446.00	0.01
561	600871	石化油服	19,800	40,194.00	0.01
562	688009	中国通号	8,350	39,746.00	0.01
563	688375	国博电子	380	39,634.00	0.01
564	002056	横店东磁	1,300	39,624.00	0.01
565	688295	中复神鹰	654	39,593.16	0.01
566	600438	通威股份	3,200	38,752.00	0.01
567	688065	凯赛生物	790	37,801.50	0.01
568	601598	中国外运	7,600	37,696.00	0.01
569	600378	昊华科技	500	37,690.00	0.01
570	688538	和辉光电	14,437	37,536.20	0.01
571	002410	广联达	4,600	37,536.00	0.01
572	002939	长城证券	4,500	37,530.00	0.01
573	601319	中国人保	5,500	37,180.00	0.01
574	688343	云天励飞	455	37,155.30	0.01

575	002138	顺络电子	500	36,550.00	0.01
576	300888	稳健医疗	1,300	36,387.00	0.01
577	688122	西部超导	569	35,738.89	0.01
578	688234	天岳先进	204	35,396.04	0.01
579	603225	新凤鸣	1,800	35,370.00	0.01
580	688183	生益电子	267	35,350.80	0.01
581	601881	中国银河	2,800	35,196.00	0.01
582	688322	奥比中光	265	34,595.75	0.01
583	688047	龙芯中科	223	34,491.41	0.01
584	688166	博瑞医药	980	34,309.80	0.01
585	600970	中材国际	4,800	34,224.00	0.01
586	300627	华测导航	1,200	34,080.00	0.01
587	603920	世运电路	700	33,628.00	0.01
588	002508	老板电器	2,300	33,626.00	0.01
589	601001	晋控煤业	1,900	33,041.00	0.01
590	600038	中直股份	1,300	32,877.00	0.01
591	002797	第一创业	5,000	32,850.00	0.01
592	002920	德赛西威	400	32,600.00	0.01
593	300558	贝达药业	500	32,535.00	0.01
594	000625	长安汽车	4,500	32,265.00	0.01
595	000598	兴蓉环境	5,000	32,100.00	0.01
596	000050	深天马 A	3,200	31,712.00	0.01
597	600023	浙能电力	6,000	31,560.00	0.01
598	688248	南网科技	445	30,785.10	0.01
599	601717	中创智领	2,200	30,602.00	0.01
600	601698	中国卫通	1,000	30,250.00	0.01
601	002244	滨江集团	3,900	29,640.00	0.01
602	600415	小商品城	2,900	29,464.00	0.01
603	600498	烽火通信	400	29,440.00	0.01
604	600582	天地科技	6,500	28,925.00	0.01
605	600517	国网英大	6,100	28,548.00	0.01
606	600141	兴发集团	600	28,182.00	0.01
607	300676	华大基因	800	28,048.00	0.01
608	300115	长盈精密	1,000	27,940.00	0.01
609	002430	杭氧股份	900	27,864.00	0.01
610	000831	中国稀土	500	27,745.00	0.01
611	600131	国网信通	1,900	27,740.00	0.01
612	601808	中海油服	2,500	27,025.00	0.01
613	600688	上海石化	8,900	26,077.00	0.01
614	000088	盐田港	6,300	25,767.00	0.01
615	000825	太钢不锈	7,500	25,575.00	0.01
616	600171	上海贝岭	800	25,552.00	0.01
617	600848	上海临港	3,400	25,466.00	0.01
618	601615	明阳智能	2,200	25,454.00	0.01

619	688281	华秦科技	501	25,165.23	0.01
620	000034	神州数码	900	24,975.00	0.01
621	600132	重庆啤酒	600	24,780.00	0.01
622	600435	北方导航	2,200	24,640.00	0.01
623	000768	中航西飞	1,200	24,576.00	0.01
624	601966	玲珑轮胎	2,400	24,456.00	0.01
625	300679	电连技术	400	23,996.00	0.01
626	301269	华大九天	200	23,884.00	0.01
627	601216	君正集团	5,300	23,638.00	0.01
628	601298	青岛港	2,900	23,345.00	0.01
629	600170	上海建工	10,500	23,310.00	0.01
630	601118	海南橡胶	4,700	23,124.00	0.01
631	002223	鱼跃医疗	900	23,094.00	0.01
632	601633	长城汽车	1,500	22,635.00	0.01
633	600905	三峡能源	6,100	22,631.00	0.01
634	600536	中国软件	800	22,496.00	0.01
635	603596	伯特利	904	22,455.36	0.01
636	601928	凤凰传媒	2,500	21,975.00	0.01
637	000002	万科 A	7,400	21,904.00	0.01
638	601236	红塔证券	3,200	21,824.00	0.01
639	300724	捷佳伟创	300	21,180.00	0.01
640	688027	国盾量子	42	21,168.42	0.01
641	002831	裕同科技	582	20,695.92	0.01
642	002203	海亮股份	900	20,565.00	0.01
643	603858	步长制药	1,400	20,440.00	0.01
644	000937	冀中能源	5,000	19,900.00	0.01
645	603650	彤程新材	200	19,596.00	0.01
646	600588	用友网络	2,100	19,278.00	0.01
647	603000	人民网	1,300	19,227.00	0.01
648	605589	圣泉集团	300	19,071.00	0.01
649	603369	今世缘	800	18,968.00	0.01
650	001696	宗申动力	900	18,729.00	0.01
651	603728	鸣志电器	300	18,276.00	0.01
652	603833	欧派家居	600	18,066.00	0.01
653	600906	财达证券	2,400	17,904.00	0.01
654	688772	珠海冠宇	899	17,647.37	0.01
655	300251	光线传媒	1,500	16,635.00	0.01
656	600118	中国卫星	200	16,410.00	0.01
657	002739	儒意电影	1,700	16,320.00	0.01
658	600862	中航高科	900	16,227.00	0.01
659	300002	神州泰岳	2,000	15,620.00	0.00
660	603529	爱玛科技	800	15,608.00	0.00
661	600583	海油工程	3,100	15,593.00	0.00
662	600977	中国电影	1,200	15,504.00	0.00

663	300748	金力永磁	500	15,425.00	0.00
664	603290	斯达半导	100	15,294.00	0.00
665	000729	燕京啤酒	1,500	15,195.00	0.00
666	600863	华能蒙电	3,200	15,040.00	0.00
667	600879	航天电子	700	14,903.00	0.00
668	688563	航材股份	290	14,856.70	0.00
669	600350	山东高速	1,300	14,469.00	0.00
670	601990	南京证券	2,200	14,454.00	0.00
671	601136	首创证券	1,000	13,950.00	0.00
672	000582	北部湾港	1,300	13,949.00	0.00
673	600025	华能水电	1,500	13,335.00	0.00
674	600968	海油发展	4,000	13,320.00	0.00
675	600292	电投水电	1,100	13,244.00	0.00
676	002601	龙佰集团	800	13,184.00	0.00
677	603589	口子窖	700	13,076.00	0.00
678	688114	华大智造	255	13,025.40	0.00
679	688297	中无人机	306	12,714.30	0.00
680	000032	深桑达 A	500	12,475.00	0.00
681	000537	绿发电力	1,700	12,427.00	0.00
682	600126	杭钢股份	2,000	12,260.00	0.00
683	688708	佳驰科技	236	11,988.80	0.00
684	000591	太阳能	2,600	11,960.00	0.00
685	002044	美年健康	2,300	11,569.00	0.00
686	688336	三生国健	216	11,469.60	0.00
687	002461	珠江啤酒	1,500	11,355.00	0.00
688	000733	振华科技	200	11,328.00	0.00
689	002085	万丰奥威	1,000	11,090.00	0.00
690	002608	江苏国信	1,600	11,040.00	0.00
691	603392	万泰生物	400	10,788.00	0.00
692	601991	大唐发电	1,500	10,620.00	0.00
693	002837	英维克	130	10,342.80	0.00
694	600095	湘财股份	1,300	9,789.00	0.00
695	601865	福莱特	900	9,459.00	0.00
696	002262	恩华药业	500	9,375.00	0.00
697	300122	智飞生物	800	9,352.00	0.00
698	603885	吉祥航空	900	9,261.00	0.00
699	002984	森麒麟	700	9,149.00	0.00
700	601611	中国核建	800	8,920.00	0.00
701	600909	华安证券	800	8,888.00	0.00
702	300896	爱美客	100	8,720.00	0.00
703	688425	铁建重工	2,168	8,715.36	0.00
704	603658	安图生物	300	8,706.00	0.00
705	601866	中远海发	3,900	8,619.00	0.00
706	002312	川发龙蟒	900	8,253.00	0.00

707	002945	华林证券	600	8,058.00	0.00
708	600602	云赛智联	500	8,040.00	0.00
709	000723	美锦能源	2,300	7,705.00	0.00
710	601179	中国西电	500	7,460.00	0.00
711	601162	天风证券	2,200	7,414.00	0.00
712	600873	梅花生物	1,000	7,350.00	0.00
713	000887	中鼎股份	400	7,156.00	0.00
714	600377	宁沪高速	600	6,942.00	0.00
715	601099	太平洋	2,000	6,740.00	0.00
716	000898	鞍钢股份	3,600	6,732.00	0.00
717	603119	浙江荣泰	100	6,634.00	0.00
718	301301	川宁生物	800	6,352.00	0.00
719	300718	长盛轴承	100	6,097.00	0.00
720	300316	晶盛机电	100	6,040.00	0.00
721	002261	拓维信息	200	5,602.00	0.00
722	600764	中国海防	300	5,229.00	0.00
723	002265	建设工业	300	5,220.00	0.00
724	002318	久立特材	200	4,780.00	0.00
725	003035	南网能源	800	4,656.00	0.00
726	002472	双环传动	100	4,151.00	0.00
727	600299	安迪苏	500	3,925.00	0.00
728	002670	国盛证券	300	3,300.00	0.00
729	600578	京能电力	500	3,225.00	0.00
730	601016	节能风电	500	1,940.00	0.00
731	603568	伟明环保	60	922.80	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	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.17
2	688525	佰维存储	814	402,710.22	0.12
3	688766	普冉股份	489	374,867.40	0.12
4	688110	东芯股份	1,798	366,252.60	0.11
5	688416	恒烁股份	2,579	361,060.00	0.11
6	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.10
7	688536	思瑞浦	831	302,558.79	0.09
8	002653	海思科	4,100	271,994.00	0.08
9	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.08
10	688378	奥来德	4,298	266,476.00	0.08
11	688221	前沿生物	11,714	262,393.60	0.08
12	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.08
13	600961	株冶集团	7,900	255,881.00	0.08

14	603061	金海通	500	251,110.00	0.08
15	688257	新锐股份	2,430	247,617.00	0.08
16	688390	固德威	2,224	241,326.24	0.07
17	688308	欧科亿	1,319	239,807.39	0.07
18	301031	中熔电气	1,972	235,555.40	0.07
19	002080	中材科技	2,600	234,000.00	0.07
20	688107	安路科技	4,867	221,935.20	0.07
21	688045	必易微	2,658	214,713.24	0.07
22	002833	弘亚数控	11,000	212,190.00	0.07
23	002283	天润工业	21,300	205,545.00	0.06
24	301548	崇德科技	2,300	204,171.00	0.06
25	000933	神火股份	9,600	203,520.00	0.06
26	688156	路德科技	6,661	201,495.25	0.06
27	000989	九芝堂	25,300	196,581.00	0.06
28	300590	移为通信	13,600	195,160.00	0.06
29	002111	威海广泰	21,200	190,800.00	0.06
30	002956	西麦食品	9,100	188,916.00	0.06
31	000848	承德露露	25,500	188,700.00	0.06
32	002511	中顺洁柔	28,300	188,195.00	0.06
33	001248	华润新能源	18,502	187,055.22	0.06
34	002701	奥瑞金	43,900	187,014.00	0.06
35	002216	三全食品	16,200	186,786.00	0.06
36	600502	安徽建工	42,600	185,310.00	0.06
37	301371	敷尔佳	7,100	184,600.00	0.06
38	600037	歌华有线	29,100	182,457.00	0.06
39	002154	报喜鸟	51,200	182,272.00	0.06
40	300438	鹏辉能源	2,200	182,270.00	0.06
41	002772	众兴菌业	16,000	181,760.00	0.06
42	688717	艾罗能源	2,174	179,507.18	0.06
43	601038	一拖股份	16,800	177,912.00	0.05
44	002737	葵花药业	15,800	177,118.00	0.05
45	300970	华绿生物	9,680	176,950.40	0.05
46	600335	国机汽车	37,400	175,032.00	0.05
47	300681	英搏尔	6,100	174,582.00	0.05
48	000036	华联控股	39,500	172,615.00	0.05
49	001218	丽臣实业	7,700	169,862.00	0.05
50	603711	香飘飘	15,200	168,872.00	0.05
51	603317	天味食品	12,700	165,227.00	0.05
52	002545	东方铁塔	9,400	152,468.00	0.05
53	000553	安道麦 A	28,300	151,405.00	0.05
54	688400	凌云光	2,261	149,678.20	0.05
55	688291	金橙子	2,467	144,270.16	0.04
56	603588	高能环境	7,100	136,320.00	0.04
57	000551	创元科技	6,500	134,095.00	0.04

58	688046	药康生物	5,446	131,793.20	0.04
59	688279	峰岷科技	562	126,135.28	0.04
60	300861	美畅股份	4,800	120,912.00	0.04
61	688059	华锐精密	603	120,425.13	0.04
62	688127	蓝特光学	1,220	119,072.00	0.04
63	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.04
64	605098	行动教育	2,000	108,320.00	0.03
65	688356	键凯科技	1,375	105,985.00	0.03
66	688137	近岸蛋白	2,908	104,688.00	0.03
67	688167	炬光科技	288	102,012.48	0.03
68	301216	万凯新材	4,400	101,156.00	0.03
69	603719	良品铺子	11,400	98,610.00	0.03
70	600883	博闻科技	14,000	98,000.00	0.03
71	000990	诚志股份	11,700	95,706.00	0.03
72	000570	苏常柴 A	20,400	95,268.00	0.03
73	300511	雪榕生物	18,800	94,564.00	0.03
74	002484	江海股份	900	94,500.00	0.03
75	603713	密尔克卫	1,300	92,521.00	0.03
76	600064	南京高科	12,900	91,977.00	0.03
77	002204	大连重工	17,300	91,344.00	0.03
78	605118	力鼎光电	2,600	90,714.00	0.03
79	603629	利通电子	500	89,405.00	0.03
80	002379	宏桥控股	5,700	84,189.00	0.03
81	688388	嘉元科技	1,912	84,128.00	0.03
82	301219	腾远钴业	1,460	80,008.00	0.02
83	002838	道恩股份	2,600	79,612.00	0.02
84	002993	奥海科技	1,100	78,771.00	0.02
85	001301	尚太科技	800	74,808.00	0.02
86	603876	鼎胜新材	2,800	72,828.00	0.02
87	688797	臻宝科技	154	72,175.18	0.02
88	600259	中稀有色	700	71,127.00	0.02
89	301018	申菱环境	600	69,366.00	0.02
90	601965	中国汽研	5,700	68,172.00	0.02
91	603236	移远通信	1,300	66,521.00	0.02
92	002782	可立克	3,100	65,255.00	0.02
93	301026	浩通科技	3,220	65,108.40	0.02
94	000970	中科三环	4,100	62,279.00	0.02
95	300482	万孚生物	3,700	61,457.00	0.02
96	603155	新亚强	2,100	60,018.00	0.02
97	002688	金河生物	12,900	59,598.00	0.02
98	600960	渤海汽车	14,000	56,420.00	0.02
99	600487	亨通光电	500	54,670.00	0.02
100	001266	宏英智能	1,100	54,010.00	0.02
101	002380	科远智慧	1,400	47,852.00	0.01

102	603096	新经典	3,400	45,492.00	0.01
103	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
104	300118	东方日升	3,200	39,840.00	0.01
105	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
106	002156	通富微电	500	37,935.00	0.01
107	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
108	603881	数据港	1,440	36,000.00	0.01
109	603678	火炬电子	400	33,200.00	0.01
110	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
111	601168	西部矿业	1,000	27,140.00	0.01
112	688510	航亚科技	1,112	26,554.56	0.01
113	688700	东威科技	294	26,283.60	0.01
114	301290	东星医疗	900	24,525.00	0.01
115	000426	兴业银锡	700	23,072.00	0.01
116	001365	天海电子	719	22,511.89	0.01
117	600096	云天化	700	21,280.00	0.01
118	002128	电投能源	900	20,808.00	0.01
119	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
120	688203	海正生材	1,982	19,780.36	0.01
121	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
122	300497	富祥股份	800	17,728.00	0.01
123	300671	富满微	200	17,232.00	0.01
124	600673	东阳光	500	16,790.00	0.01
125	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.01
126	301310	鑫宏业	300	16,572.00	0.01
127	688689	银河微电	254	16,438.88	0.01
128	002492	恒基达鑫	3,000	16,230.00	0.01
129	688181	八亿时空	257	16,088.20	0.00
130	300647	超频三	2,700	16,065.00	0.00
131	300613	富瀚微	200	16,016.00	0.00
132	301336	趣睡科技	400	15,980.00	0.00
133	300509	新美星	1,900	15,922.00	0.00
134	000619	海螺新材	3,600	15,840.00	0.00
135	002712	思美传媒	3,800	15,770.00	0.00
136	300425	中建环能	4,200	15,708.00	0.00
137	300422	博世科	3,700	15,577.00	0.00
138	002702	海欣食品	3,500	15,575.00	0.00
139	002330	得利斯	4,500	15,570.00	0.00
140	000548	湖南投资	3,800	15,542.00	0.00
141	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
142	600854	春兰股份	3,800	15,466.00	0.00
143	300074	华平股份	4,500	15,300.00	0.00
144	002671	龙泉股份	4,100	15,211.00	0.00
145	001393	维通利	387	15,089.13	0.00

146	601061	中信金属	1,400	15,078.00	0.00
147	002998	优彩资源	2,300	14,973.00	0.00
148	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
149	000565	渝三峡 A	2,600	14,768.00	0.00
150	300575	中旗股份	3,000	14,760.00	0.00
151	688209	英集芯	502	14,598.16	0.00
152	300030	阳普医疗	2,500	14,525.00	0.00
153	300281	金明精机	2,400	14,472.00	0.00
154	300928	华安鑫创	500	14,440.00	0.00
155	603137	恒尚节能	1,100	14,234.00	0.00
156	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
157	300739	明阳电路	400	14,056.00	0.00
158	300184	力源信息	800	14,040.00	0.00
159	688080	映翰通	324	14,013.00	0.00
160	002664	信质集团	800	13,832.00	0.00
161	301608	博实结	272	13,670.72	0.00
162	002595	豪迈科技	290	13,514.00	0.00
163	301586	佳力奇	400	13,464.00	0.00
164	301616	浙江华业	400	13,408.00	0.00
165	601677	明泰铝业	800	13,280.00	0.00
166	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
167	002687	乔治白	2,500	13,100.00	0.00
168	603125	常青科技	400	13,096.00	0.00
169	600761	安徽合力	800	13,088.00	0.00
170	300363	博腾股份	800	12,992.00	0.00
171	300801	泰和科技	400	12,920.00	0.00
172	301287	康力源	400	12,916.00	0.00
173	301390	经纬股份	400	12,904.00	0.00
174	002864	盘龙药业	500	12,900.00	0.00
175	301166	优宁维	500	12,895.00	0.00
176	301105	鸿铭股份	300	12,894.00	0.00
177	301131	聚赛龙	400	12,852.00	0.00
178	301270	汉仪股份	500	12,840.00	0.00
179	688687	凯因科技	785	12,803.35	0.00
180	001228	永泰运	500	12,775.00	0.00
181	301585	蓝宇股份	500	12,605.00	0.00
182	001368	通达创智	600	12,342.00	0.00
183	301318	维海德	600	12,240.00	0.00
184	300531	优博讯	800	12,120.00	0.00
185	001373	翔腾新材	400	12,060.00	0.00
186	301479	弘景光电	200	12,040.00	0.00
187	301130	西点药业	500	11,990.00	0.00
188	300886	华业香料	600	11,940.00	0.00
189	001314	亿道信息	193	11,927.40	0.00

190	000810	创维数字	900	11,925.00	0.00
191	688148	芳源股份	1,389	11,917.62	0.00
192	300915	海融科技	600	11,880.00	0.00
193	600955	维远股份	800	11,776.00	0.00
194	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
195	688168	安博通	169	11,618.75	0.00
196	603700	宁水集团	1,000	11,610.00	0.00
197	301002	崧盛股份	300	11,580.00	0.00
198	301408	华人健康	800	11,504.00	0.00
199	000973	佛塑科技	800	11,480.00	0.00
200	688113	联测科技	326	11,442.60	0.00
201	002805	丰元股份	400	11,436.00	0.00
202	301258	富士莱	500	11,385.00	0.00
203	688004	博汇科技	620	11,284.00	0.00
204	688244	永信至诚	789	11,251.14	0.00
205	603937	丽岛新材	800	11,216.00	0.00
206	300971	博亚精工	600	11,196.00	0.00
207	300723	一品红	300	11,184.00	0.00
208	300844	山水比德	500	11,105.00	0.00
209	688067	爱威科技	551	11,102.65	0.00
210	301163	宏德股份	500	11,090.00	0.00
211	002910	庄园牧场	1,000	11,080.00	0.00
211	603178	圣龙股份	800	11,080.00	0.00
213	688565	力源科技	1,170	11,056.50	0.00
214	301230	泓博医药	300	11,052.00	0.00
215	001336	楚环科技	500	11,010.00	0.00
216	300938	信测标准	220	10,973.60	0.00
217	002958	青农商行	4,000	10,960.00	0.00
218	001205	盛航股份	800	10,944.00	0.00
218	300412	迦南科技	2,400	10,944.00	0.00
220	688373	盟科药业	2,409	10,912.77	0.00
221	603025	大豪科技	800	10,912.00	0.00
222	688501	青达环保	567	10,886.40	0.00
223	001201	东瑞股份	1,000	10,860.00	0.00
224	688321	微芯生物	411	10,821.63	0.00
225	002084	海鸥住工	3,100	10,788.00	0.00
226	301170	锡南科技	500	10,755.00	0.00
227	605228	神通科技	800	10,744.00	0.00
228	688681	科汇股份	768	10,736.64	0.00
229	603818	曲美家居	3,600	10,692.00	0.00
230	300717	华信新材	500	10,650.00	0.00
231	600288	大恒科技	800	10,640.00	0.00
232	688517	金冠电气	608	10,627.84	0.00
233	603906	龙蟠科技	400	10,612.00	0.00

234	002723	小崧股份	1,200	10,608.00	0.00
235	301065	本立科技	600	10,590.00	0.00
236	300452	山河药辅	900	10,512.00	0.00
237	300337	银邦股份	900	10,494.00	0.00
238	002136	安纳达	800	10,464.00	0.00
239	301500	飞南资源	400	10,420.00	0.00
240	688158	优刻得	283	10,403.08	0.00
241	001298	好上好	500	10,375.00	0.00
242	301027	华蓝集团	500	10,345.00	0.00
243	301008	宏昌科技	400	10,240.00	0.00
244	001387	雪祺电气	800	10,216.00	0.00
245	300883	龙利得	1,600	10,096.00	0.00
246	301079	邵阳液压	300	10,092.00	0.00
247	300787	海能实业	1,100	10,032.00	0.00
248	688285	高铁电气	1,395	10,002.15	0.00
249	603282	亚光股份	700	9,989.00	0.00
250	300409	道氏技术	500	9,965.00	0.00
251	300890	翔丰华	300	9,951.00	0.00
252	300150	世纪瑞尔	2,500	9,925.00	0.00
253	300233	金城医药	800	9,920.00	0.00
254	300534	陇神戎发	1,400	9,912.00	0.00
255	688350	富淼科技	287	9,910.11	0.00
256	603188	亚邦股份	2,500	9,900.00	0.00
257	002949	华阳国际	1,000	9,890.00	0.00
258	600528	中铁工业	1,500	9,885.00	0.00
259	002810	山东赫达	400	9,880.00	0.00
259	300018	中元股份	800	9,880.00	0.00
261	688616	西力科技	978	9,877.80	0.00
262	002448	中原内配	800	9,840.00	0.00
263	605001	威奥股份	1,800	9,810.00	0.00
264	300996	普联软件	900	9,801.00	0.00
265	301355	南王科技	1,000	9,780.00	0.00
266	603385	惠达卫浴	2,000	9,760.00	0.00
267	688633	星球石墨	328	9,751.44	0.00
268	002660	茂硕电源	1,500	9,750.00	0.00
269	300582	英飞特	800	9,744.00	0.00
270	300635	中达安	800	9,736.00	0.00
271	600203	福日电子	800	9,720.00	0.00
271	600697	欧亚集团	1,000	9,720.00	0.00
271	601231	环旭电子	300	9,720.00	0.00
274	002780	三夫户外	800	9,712.00	0.00
275	300306	远方信息	1,000	9,700.00	0.00
276	300148	天舟文化	3,100	9,641.00	0.00
277	002495	佳隆股份	4,700	9,635.00	0.00

278	000153	丰原药业	1,900	9,633.00	0.00
279	002486	嘉麟杰	4,500	9,630.00	0.00
280	300564	筑博设计	800	9,608.00	0.00
281	300694	蠡湖股份	1,000	9,600.00	0.00
282	002377	国创高新	3,800	9,576.00	0.00
282	300958	建工修复	900	9,576.00	0.00
284	300640	德艺文创	1,700	9,571.00	0.00
285	300701	森霸传感	1,000	9,570.00	0.00
286	002294	信立泰	300	9,567.00	0.00
287	300636	同和药业	1,500	9,555.00	0.00
288	301135	瑞德智能	580	9,552.60	0.00
289	300778	新城市	1,000	9,550.00	0.00
289	301099	雅创电子	100	9,550.00	0.00
291	300813	泰林生物	500	9,545.00	0.00
292	300535	达威股份	700	9,541.00	0.00
293	688171	纬德信息	217	9,539.32	0.00
294	300621	维业股份	1,500	9,525.00	0.00
295	000633	合金投资	2,000	9,520.00	0.00
295	300218	安利股份	800	9,520.00	0.00
297	300387	富邦科技	1,400	9,506.00	0.00
298	300659	中孚信息	1,000	9,500.00	0.00
299	300891	惠云钛业	1,500	9,495.00	0.00
300	300929	华骐环保	900	9,486.00	0.00
301	001202	炬申股份	700	9,485.00	0.00
302	300479	神思电子	700	9,478.00	0.00
303	603811	诚意药业	1,260	9,475.20	0.00
304	000419	通程控股	2,100	9,471.00	0.00
305	002802	洪汇新材	900	9,468.00	0.00
306	300589	江龙船艇	800	9,440.00	0.00
307	002722	物产金轮	800	9,432.00	0.00
308	300517	海波重科	1,000	9,420.00	0.00
309	300645	正元智慧	800	9,416.00	0.00
310	301126	达嘉维康	1,100	9,405.00	0.00
310	600561	江西长运	1,900	9,405.00	0.00
312	603797	联泰环保	2,500	9,375.00	0.00
313	300839	博汇股份	800	9,368.00	0.00
314	600386	北巴传媒	3,000	9,360.00	0.00
315	300220	金运激光	900	9,351.00	0.00
316	300514	友讯达	1,000	9,350.00	0.00
317	002551	尚荣医疗	3,500	9,345.00	0.00
317	600249	两面针	2,100	9,345.00	0.00
319	600097	开创国际	1,200	9,336.00	0.00
320	603041	美思德	900	9,333.00	0.00
321	002381	双箭股份	1,800	9,324.00	0.00

321	002494	华斯股份	2,100	9,324.00	0.00
321	600448	华纺股份	3,700	9,324.00	0.00
321	600613	神奇制药	2,100	9,324.00	0.00
325	300314	戴维医疗	1,000	9,310.00	0.00
326	002172	澳洋健康	3,300	9,306.00	0.00
327	002337	赛象科技	2,100	9,303.00	0.00
328	001222	源飞宠物	700	9,296.00	0.00
329	300771	智莱科技	900	9,288.00	0.00
330	300112	万讯自控	1,500	9,285.00	0.00
331	600858	银座股份	2,100	9,261.00	0.00
332	300800	力合科技	1,000	9,250.00	0.00
333	300417	南华仪器	900	9,234.00	0.00
334	603183	建研院	2,600	9,230.00	0.00
335	301083	百胜智能	700	9,219.00	0.00
336	002852	道道全	1,300	9,217.00	0.00
337	000757	浩物股份	2,700	9,207.00	0.00
337	002775	文科股份	2,700	9,207.00	0.00
337	300559	佳发教育	900	9,207.00	0.00
340	000573	粤宏远 A	2,600	9,204.00	0.00
341	003016	欣贺股份	1,500	9,195.00	0.00
342	300200	高盟新材	800	9,192.00	0.00
342	603496	恒为科技	400	9,192.00	0.00
344	000751	锌业股份	1,500	9,180.00	0.00
344	002561	徐家汇	1,500	9,180.00	0.00
346	002835	同为股份	800	9,176.00	0.00
347	300658	延江股份	800	9,144.00	0.00
348	301062	上海艾录	1,600	9,136.00	0.00
349	301239	普瑞眼科	300	9,135.00	0.00
350	002134	天津普林	300	9,126.00	0.00
351	603182	嘉华股份	800	9,120.00	0.00
352	002186	全聚德	1,100	9,108.00	0.00
353	000637	茂化实华	2,600	9,100.00	0.00
354	688609	九联科技	825	9,083.25	0.00
355	688468	科美诊断	1,595	9,075.55	0.00
356	603093	南华期货	500	9,075.00	0.00
357	600802	福建水泥	2,200	9,064.00	0.00
358	300374	中铁装配	900	9,063.00	0.00
359	002566	益盛药业	1,500	9,060.00	0.00
359	300867	圣元环保	500	9,060.00	0.00
361	300153	科泰电源	400	9,048.00	0.00
361	300510	金冠股份	2,900	9,048.00	0.00
363	002999	天禾股份	1,700	9,044.00	0.00
364	002753	永东股份	1,600	9,040.00	0.00
365	002363	隆基机械	1,500	9,030.00	0.00

366	002788	鹭燕医药	900	9,027.00	0.00
367	603933	睿能科技	400	9,020.00	0.00
368	002398	垒知集团	2,400	9,000.00	0.00
368	600616	金枫酒业	2,400	9,000.00	0.00
370	000812	陕西金叶	2,900	8,990.00	0.00
371	301103	何氏眼科	600	8,988.00	0.00
371	600768	宁波富邦	600	8,988.00	0.00
373	300434	金石亚药	800	8,984.00	0.00
373	300583	赛托生物	800	8,984.00	0.00
375	688701	卓锦股份	1,193	8,983.29	0.00
376	300240	飞力达	1,800	8,982.00	0.00
377	002862	实丰文化	700	8,981.00	0.00
378	603329	上海雅仕	1,000	8,980.00	0.00
379	603217	元利科技	400	8,972.00	0.00
380	301082	久盛电气	1,000	8,960.00	0.00
381	003003	天元股份	900	8,955.00	0.00
382	000529	广弘控股	2,100	8,946.00	0.00
382	301113	雅艺科技	600	8,946.00	0.00
382	600235	民丰特纸	1,800	8,946.00	0.00
382	603073	彩蝶实业	600	8,946.00	0.00
386	603026	石大胜华	100	8,937.00	0.00
387	300713	英可瑞	700	8,918.00	0.00
388	002682	龙洲股份	2,100	8,904.00	0.00
388	002863	今飞凯达	2,100	8,904.00	0.00
390	002105	信隆健康	1,800	8,892.00	0.00
390	600356	恒丰纸业	1,200	8,892.00	0.00
392	688208	道通科技	352	8,866.88	0.00
393	002144	宏达高科	900	8,865.00	0.00
394	603520	司太立	800	8,832.00	0.00
395	688365	光云科技	560	8,831.20	0.00
396	603602	纵横通信	800	8,816.00	0.00
397	300405	科隆股份	1,700	8,806.00	0.00
397	300796	贝斯美	1,400	8,806.00	0.00
399	300371	汇中股份	900	8,802.00	0.00
400	603238	诺邦股份	800	8,800.00	0.00
401	002817	黄山胶囊	1,500	8,790.00	0.00
402	002857	三晖电气	500	8,785.00	0.00
402	301006	迈拓股份	700	8,785.00	0.00
404	002873	新天药业	1,200	8,784.00	0.00
404	603066	音飞储存	900	8,784.00	0.00
406	301587	中瑞股份	400	8,780.00	0.00
407	300743	天地数码	600	8,754.00	0.00
408	300349	金卡智能	800	8,752.00	0.00
409	600371	万向德农	1,400	8,750.00	0.00

410	300823	建科智能	600	8,748.00	0.00
411	600689	上海三毛	900	8,730.00	0.00
412	002858	力盛体育	800	8,728.00	0.00
413	300145	南方泵业	1,600	8,720.00	0.00
414	603117	万林物流	2,600	8,710.00	0.00
415	301519	舜禹股份	800	8,680.00	0.00
416	301266	宇邦新材	380	8,679.20	0.00
417	600650	锦江在线	900	8,676.00	0.00
418	300126	锐奇股份	1,500	8,670.00	0.00
418	300942	易瑞生物	1,500	8,670.00	0.00
420	600257	大湖股份	2,000	8,660.00	0.00
421	605077	华康股份	800	8,648.00	0.00
422	600359	新农开发	1,600	8,640.00	0.00
423	300824	北鼎股份	1,200	8,616.00	0.00
424	300927	江天化学	400	8,612.00	0.00
425	002843	泰嘉股份	400	8,588.00	0.00
426	300629	新劲刚	400	8,584.00	0.00
427	603321	梅轮电梯	1,500	8,580.00	0.00
427	603518	锦泓集团	1,200	8,580.00	0.00
429	002591	恒大高新	1,400	8,568.00	0.00
429	300773	拉卡拉	560	8,568.00	0.00
431	000605	渤海股份	1,600	8,560.00	0.00
431	002628	成都路桥	1,600	8,560.00	0.00
433	000985	大庆华科	600	8,538.00	0.00
434	003008	开普检测	500	8,535.00	0.00
435	603909	建发合诚	1,000	8,530.00	0.00
436	300597	吉大通信	1,200	8,496.00	0.00
437	603579	荣泰健康	500	8,485.00	0.00
438	301229	纽泰格	700	8,484.00	0.00
439	002295	精艺股份	1,000	8,480.00	0.00
440	603214	爱婴室	700	8,477.00	0.00
441	301255	通力科技	400	8,476.00	0.00
442	002799	环球印务	1,400	8,470.00	0.00
442	603958	哈森股份	500	8,470.00	0.00
444	688081	兴图新科	207	8,462.16	0.00
445	002968	新大正	1,000	8,460.00	0.00
446	600051	宁波联合	1,500	8,445.00	0.00
446	603900	莱绅通灵	1,500	8,445.00	0.00
448	603029	天鹅股份	600	8,436.00	0.00
449	002917	金奥博	800	8,432.00	0.00
450	603506	南都物业	900	8,406.00	0.00
451	002820	桂发祥	1,000	8,400.00	0.00
451	301037	保立佳	700	8,400.00	0.00
453	300950	德固特	500	8,385.00	0.00

453	603982	泉峰汽车	1,500	8,385.00	0.00
455	600493	凤竹纺织	1,600	8,384.00	0.00
456	301032	新柴股份	900	8,370.00	0.00
457	300732	设研院	1,500	8,355.00	0.00
458	603390	通达电气	800	8,352.00	0.00
459	603089	正裕工业	1,000	8,350.00	0.00
460	600128	苏豪弘业	1,100	8,349.00	0.00
461	688360	德马科技	466	8,341.40	0.00
462	300519	新光药业	700	8,295.00	0.00
462	300675	建科院	700	8,295.00	0.00
464	600661	昂立教育	1,200	8,292.00	0.00
465	605155	西大门	700	8,288.00	0.00
466	301189	奥尼电子	140	8,250.20	0.00
467	002115	三维通信	800	8,240.00	0.00
467	600835	上海机电	400	8,240.00	0.00
469	002440	闰土股份	800	8,200.00	0.00
469	300214	日科化学	800	8,200.00	0.00
471	002372	伟星新材	1,000	8,190.00	0.00
472	600137	浪莎股份	500	8,115.00	0.00
473	301298	东利机械	700	8,099.00	0.00
474	300738	奥飞数据	400	8,088.00	0.00
475	600590	泰豪科技	800	8,080.00	0.00
476	603289	泰瑞机器	1,000	8,070.00	0.00
477	300504	天邑股份	500	8,065.00	0.00
478	300599	雄塑科技	800	8,056.00	0.00
479	603758	秦安股份	900	8,046.00	0.00
480	001209	洪兴股份	500	8,010.00	0.00
480	300254	仟源医药	1,000	8,010.00	0.00
480	300838	浙江力诺	600	8,010.00	0.00
483	300239	东宝生物	1,500	7,995.00	0.00
484	603022	新通联	1,000	7,990.00	0.00
484	605567	春雪食品	1,000	7,990.00	0.00
486	600099	林海股份	1,000	7,980.00	0.00
487	301292	海科新源	100	7,973.00	0.00
488	603383	顶点软件	300	7,968.00	0.00
489	301359	东南电子	500	7,940.00	0.00
490	605577	龙版传媒	900	7,929.00	0.00
491	300404	博济医药	900	7,884.00	0.00
492	603680	今创集团	800	7,848.00	0.00
493	301429	森泰股份	500	7,835.00	0.00
494	002961	瑞达期货	400	7,832.00	0.00
495	001260	坤泰股份	500	7,825.00	0.00
496	300057	万顺新材	900	7,812.00	0.00
497	301261	恒工精密	100	7,810.00	0.00

498	605300	佳禾食品	800	7,800.00	0.00
499	300095	华伍股份	900	7,758.00	0.00
500	301048	金鹰重工	900	7,749.00	0.00
501	300249	依米康	500	7,700.00	0.00
501	600770	综艺股份	1,100	7,700.00	0.00
503	300006	莱美药业	1,500	7,695.00	0.00
504	603966	法兰泰克	940	7,661.00	0.00
505	300981	中红医疗	800	7,656.00	0.00
506	300042	朗科科技	100	7,617.00	0.00
507	002439	启明星辰	600	7,590.00	0.00
508	002034	旺能环境	500	7,575.00	0.00
509	301110	青木科技	200	7,572.00	0.00
510	300277	汽轮科技	500	7,520.00	0.00
511	000652	泰达股份	2,200	7,502.00	0.00
512	600713	南京医药	1,500	7,500.00	0.00
513	301353	普莱得	450	7,474.50	0.00
514	002386	天原股份	1,200	7,440.00	0.00
515	002033	丽江股份	900	7,434.00	0.00
515	301167	建研设计	600	7,434.00	0.00
517	000715	中兴商业	1,600	7,424.00	0.00
518	603626	科森科技	400	7,400.00	0.00
519	002930	宏川智慧	800	7,360.00	0.00
520	301060	兰卫医学	900	7,353.00	0.00
521	300168	万达信息	1,600	7,344.00	0.00
522	002437	誉衡药业	2,700	7,290.00	0.00
523	002546	新联电子	1,000	7,280.00	0.00
524	603366	日出东方	1,000	7,270.00	0.00
525	002521	齐峰新材	1,000	7,240.00	0.00
526	002035	华帝股份	1,600	7,232.00	0.00
527	300569	天能重工	1,500	7,230.00	0.00
528	002967	广电计量	400	7,220.00	0.00
529	603095	越剑智能	500	7,160.00	0.00
530	002616	长青集团	1,600	7,152.00	0.00
531	002950	奥美医疗	800	7,112.00	0.00
532	001313	粤海饲料	1,000	7,090.00	0.00
533	300190	维尔利	1,700	7,055.00	0.00
534	300067	安诺其	1,300	7,046.00	0.00
535	002132	恒星科技	1,300	7,033.00	0.00
536	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
537	600626	申达股份	2,200	7,018.00	0.00
538	000516	国际医学	1,800	7,002.00	0.00
539	300022	吉峰科技	900	6,993.00	0.00
540	600829	人民同泰	900	6,984.00	0.00
541	300848	美瑞新材	500	6,975.00	0.00

542	000813	德展健康	2,300	6,969.00	0.00
543	300043	星辉娱乐	1,600	6,960.00	0.00
544	002274	华昌化工	1,500	6,945.00	0.00
545	002302	西部建设	1,600	6,912.00	0.00
546	300082	奥克股份	800	6,904.00	0.00
547	300016	北陆药业	900	6,903.00	0.00
548	300332	天壕能源	1,600	6,880.00	0.00
548	601218	吉鑫科技	1,600	6,880.00	0.00
550	600664	哈药股份	2,300	6,877.00	0.00
551	300355	蒙草生态	2,500	6,875.00	0.00
552	301137	哈焊华通	200	6,872.00	0.00
553	002663	普邦股份	4,600	6,854.00	0.00
554	301116	益客食品	800	6,848.00	0.00
555	002107	沃华医药	1,200	6,828.00	0.00
556	002481	双塔食品	1,800	6,822.00	0.00
557	600929	雪天盐业	1,500	6,810.00	0.00
558	300507	苏奥传感	900	6,777.00	0.00
559	301077	星华新材	300	6,774.00	0.00
560	002419	天虹股份	1,600	6,768.00	0.00
561	002228	合兴包装	2,300	6,762.00	0.00
561	002573	清新环境	2,300	6,762.00	0.00
563	002162	悦心健康	2,000	6,760.00	0.00
563	002582	好想你	800	6,760.00	0.00
563	600509	天富能源	800	6,760.00	0.00
566	000599	青岛双星	1,600	6,752.00	0.00
567	002479	富春环保	1,600	6,736.00	0.00
568	000753	漳州发展	1,500	6,735.00	0.00
569	002040	南京港	900	6,705.00	0.00
569	002606	大连电瓷	500	6,705.00	0.00
571	002560	通达股份	900	6,696.00	0.00
572	002795	永和智控	1,000	6,690.00	0.00
573	600853	龙建股份	2,200	6,688.00	0.00
574	300310	宜通世纪	1,600	6,672.00	0.00
575	300228	富瑞特装	900	6,660.00	0.00
576	603817	海峡环保	1,300	6,643.00	0.00
577	002589	瑞康医药	2,700	6,642.00	0.00
578	002108	沧州明珠	1,600	6,624.00	0.00
578	605138	盛泰集团	1,200	6,624.00	0.00
580	300490	华自科技	500	6,615.00	0.00
581	300756	金马游乐	200	6,610.00	0.00
582	300172	中电环保	1,600	6,608.00	0.00
582	600320	振华重工	1,600	6,608.00	0.00
584	300215	电科院	1,000	6,590.00	0.00
585	600308	华泰股份	2,200	6,578.00	0.00

585	603507	振江股份	200	6,578.00	0.00
587	601500	通用股份	1,800	6,570.00	0.00
588	600638	新黄浦	1,500	6,555.00	0.00
589	000906	浙商中拓	1,300	6,552.00	0.00
590	601368	绿城水务	1,600	6,544.00	0.00
591	600383	金地集团	3,100	6,541.00	0.00
592	600425	青松建化	2,000	6,540.00	0.00
593	601890	亚星锚链	800	6,536.00	0.00
594	002793	罗欣药业	1,700	6,528.00	0.00
594	600469	风神股份	1,200	6,528.00	0.00
594	601828	美凯龙	3,200	6,528.00	0.00
597	600333	长春燃气	1,300	6,526.00	0.00
598	603999	读者传媒	1,300	6,500.00	0.00
599	000589	贵州轮胎	1,600	6,496.00	0.00
600	600676	交运股份	1,000	6,490.00	0.00
601	000420	吉林化纤	1,600	6,480.00	0.00
602	002042	华孚时尚	1,900	6,479.00	0.00
603	600429	三元股份	1,600	6,464.00	0.00
604	300639	凯普生物	1,300	6,461.00	0.00
605	002392	北京利尔	800	6,456.00	0.00
606	000822	山东海化	1,600	6,432.00	0.00
607	300275	梅安森	800	6,424.00	0.00
608	002375	亚厦股份	1,900	6,422.00	0.00
608	002483	润邦股份	1,300	6,422.00	0.00
610	601789	宁波建工	1,600	6,416.00	0.00
611	000919	金陵药业	1,100	6,413.00	0.00
612	300389	艾比森	500	6,410.00	0.00
613	002016	世荣兆业	1,600	6,400.00	0.00
613	300358	楚天科技	800	6,400.00	0.00
615	002593	日上集团	1,600	6,384.00	0.00
616	300231	银信科技	800	6,360.00	0.00
617	301039	中集车辆	900	6,345.00	0.00
618	000949	新乡化纤	1,000	6,340.00	0.00
619	300335	迪森股份	1,300	6,331.00	0.00
620	002376	新北洋	1,100	6,325.00	0.00
621	300324	旋极信息	1,700	6,324.00	0.00
622	600284	浦东建设	1,300	6,318.00	0.00
623	002578	闽发铝业	2,000	6,300.00	0.00
624	000407	胜利股份	1,700	6,290.00	0.00
624	600880	博瑞传播	1,700	6,290.00	0.00
626	000404	长虹华意	800	6,288.00	0.00
627	601968	宝钢包装	1,600	6,272.00	0.00
628	301090	华润材料	1,000	6,270.00	0.00
629	000402	金融街	2,600	6,266.00	0.00

630	300887	谱尼测试	900	6,264.00	0.00
631	600266	城建发展	1,600	6,256.00	0.00
632	301157	华塑科技	100	6,248.00	0.00
633	002454	松芝股份	1,300	6,214.00	0.00
634	600790	轻纺城	1,900	6,213.00	0.00
635	000877	天山股份	1,700	6,171.00	0.00
636	600617	国新能源	2,300	6,164.00	0.00
637	300107	建新股份	1,100	6,160.00	0.00
637	300587	天铁科技	1,600	6,160.00	0.00
639	301179	泽宇智能	300	6,138.00	0.00
640	300603	立昂技术	800	6,136.00	0.00
641	300532	今天国际	980	6,105.40	0.00
642	300444	双杰电气	500	6,105.00	0.00
643	002298	中电鑫龙	800	6,096.00	0.00
644	300933	中辰股份	1,000	6,080.00	0.00
645	600740	山西焦化	1,900	6,061.00	0.00
646	300253	卫宁健康	900	6,057.00	0.00
647	600419	天润乳业	800	6,056.00	0.00
648	002412	汉森制药	1,100	6,050.00	0.00
648	601333	广深铁路	2,200	6,050.00	0.00
650	605189	富春染织	500	6,025.00	0.00
651	600736	苏州高新	900	6,021.00	0.00
651	601921	浙版传媒	900	6,021.00	0.00
653	000059	华锦股份	1,600	6,000.00	0.00
654	002054	德美化工	900	5,985.00	0.00
655	300979	华利集团	200	5,950.00	0.00
656	600395	盘江股份	1,300	5,928.00	0.00
657	002067	景兴纸业	1,600	5,888.00	0.00
658	002328	新朋股份	800	5,872.00	0.00
659	002685	华东重机	900	5,814.00	0.00
660	601515	衢州东峰	1,800	5,760.00	0.00
661	600007	中国国贸	300	5,694.00	0.00
662	300099	尤洛卡	900	5,688.00	0.00
663	300132	青松股份	1,000	5,680.00	0.00
664	300563	神宇股份	200	5,678.00	0.00
665	601121	宝地矿业	1,000	5,640.00	0.00
666	300062	中能电气	1,000	5,610.00	0.00
667	300388	节能国祯	900	5,553.00	0.00
668	603071	物产环能	500	5,530.00	0.00
669	002752	昇兴股份	1,000	5,520.00	0.00
670	002997	瑞鹄模具	200	5,512.00	0.00
671	301246	宏源药业	200	5,380.00	0.00
672	603815	交建股份	1,000	5,200.00	0.00
673	601918	新集能源	600	5,154.00	0.00

674	688100	威胜信息	159	4,863.81	0.00
675	002459	晶澳科技	600	4,860.00	0.00
676	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
677	600720	中交设计	900	4,338.00	0.00
678	603195	公牛集团	100	3,915.00	0.00
679	002922	伊戈尔	100	3,280.00	0.00
680	000876	新希望	500	3,135.00	0.00
681	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
682	301150	中一科技	40	2,524.40	0.00
683	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
684	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
685	603889	新澳股份	40	204.40	0.00
686	301156	美农生物	10	108.70	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	55,023,416.40	16.99
2	600519	贵州茅台	46,262,995.50	14.29
3	300308	中际旭创	40,696,327.24	12.57
4	601318	中国平安	38,960,922.03	12.03
5	601899	紫金矿业	35,342,408.00	10.91
6	300502	新易盛	24,769,876.20	7.65
7	600036	招商银行	23,252,712.00	7.18
8	601166	兴业银行	19,483,273.60	6.02
9	000333	美的集团	17,262,663.20	5.33
10	002475	立讯精密	17,107,131.50	5.28
11	600030	中信证券	16,599,887.31	5.13
12	603259	药明康德	16,300,832.06	5.03
13	601138	工业富联	15,620,857.00	4.82
14	300394	天孚通信	15,530,250.00	4.80
15	300274	阳光电源	15,284,575.05	4.72
16	688256	寒武纪	14,853,213.25	4.59
17	603986	兆易创新	14,623,618.00	4.52
18	600150	中国船舶	14,338,579.20	4.43
19	600900	长江电力	13,369,519.70	4.13
20	603993	洛阳钼业	13,211,917.00	4.08
21	300059	东方财富	12,098,233.00	3.74
22	002142	宁波银行	11,940,281.00	3.69
23	600183	生益科技	11,856,341.07	3.66
24	601328	交通银行	11,689,325.80	3.61

25	002384	东山精密	11,251,133.00	3.47
26	600919	江苏银行	11,220,082.00	3.47
27	600276	恒瑞医药	11,187,911.80	3.46
28	688981	中芯国际	10,896,650.31	3.37
29	601601	中国太保	10,719,168.50	3.31
30	688012	中微公司	10,470,083.00	3.23
31	601398	工商银行	10,425,416.00	3.22
32	002916	深南电路	10,402,884.00	3.21
33	600309	万华化学	10,382,162.13	3.21
34	603799	华友钴业	10,324,426.00	3.19
35	002594	比亚迪	10,203,776.00	3.15
36	002371	北方华创	10,077,676.00	3.11
37	002028	思源电气	10,028,692.00	3.10
38	601211	国泰海通	9,988,579.00	3.08
39	600031	三一重工	9,670,565.00	2.99
40	002415	海康威视	9,472,695.00	2.93
41	000157	中联重科	9,279,176.80	2.87
42	601600	中国铝业	9,153,958.00	2.83
43	600795	国电电力	9,094,249.00	2.81
44	688041	海光信息	9,030,262.11	2.79
45	601688	华泰证券	8,860,025.00	2.74
46	600028	中国石化	8,625,323.10	2.66
47	002714	牧原股份	8,610,559.37	2.66
48	002460	赣锋锂业	8,559,703.00	2.64
49	605499	东鹏饮料	8,479,417.00	2.62
50	600352	浙江龙盛	8,375,952.00	2.59
51	600176	中国巨石	8,179,730.00	2.53
52	600887	伊利股份	8,038,910.00	2.48
53	601668	中国建筑	7,912,703.00	2.44
54	000100	TCL 科技	7,793,146.00	2.41
55	600660	福耀玻璃	7,659,743.11	2.37
56	600549	厦门钨业	7,606,457.20	2.35
57	601288	农业银行	7,500,091.00	2.32
58	688111	金山办公	7,388,592.57	2.28
59	300476	胜宏科技	7,366,899.00	2.28
60	300033	同花顺	7,326,890.54	2.26
61	600522	中天科技	7,264,202.00	2.24
62	601169	北京银行	7,235,753.00	2.23
63	601108	财通证券	7,213,833.60	2.23
64	300014	亿纬锂能	7,107,940.00	2.20
65	601628	中国人寿	7,046,048.00	2.18
66	000651	格力电器	7,001,596.00	2.16
67	000725	京东方 A	6,992,298.00	2.16
68	002558	巨人网络	6,946,133.00	2.15

69	000733	振华科技	6,813,905.10	2.10
70	300604	长川科技	6,782,927.00	2.09
71	600690	海尔智家	6,769,951.00	2.09
72	600019	宝钢股份	6,707,289.00	2.07
73	002027	分众传媒	6,674,247.00	2.06
74	300450	先导智能	6,655,587.00	2.06
75	688008	澜起科技	6,651,069.69	2.05
76	601336	新华保险	6,537,506.00	2.02
77	000408	藏格矿业	6,520,436.00	2.01
78	002008	大族激光	6,481,711.00	2.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	56,691,255.27	17.51
2	300308	中际旭创	51,051,164.54	15.77
3	600519	贵州茅台	40,095,207.88	12.38
4	300502	新易盛	32,490,551.50	10.03
5	601318	中国平安	30,140,379.08	9.31
6	601899	紫金矿业	27,968,338.00	8.64
7	600036	招商银行	19,928,078.60	6.15
8	300394	天孚通信	18,701,418.90	5.78
9	002475	立讯精密	18,443,687.19	5.70
10	601166	兴业银行	16,658,959.94	5.14
11	601138	工业富联	15,175,368.75	4.69
12	603259	药明康德	14,742,580.00	4.55
13	000333	美的集团	14,614,408.00	4.51
14	603986	兆易创新	14,165,151.00	4.37
15	600150	中国船舶	13,936,983.49	4.30
16	002384	东山精密	13,887,115.48	4.29
17	600030	中信证券	13,352,813.00	4.12
18	600183	生益科技	12,958,115.00	4.00
19	300274	阳光电源	12,827,155.44	3.96
20	688256	寒武纪	12,635,084.11	3.90
21	002916	深南电路	12,130,599.00	3.75
22	002142	宁波银行	11,895,210.20	3.67
23	600900	长江电力	11,875,728.04	3.67
24	600919	江苏银行	11,037,976.00	3.41
25	603993	洛阳钼业	10,429,276.00	3.22
26	600176	中国巨石	10,216,100.00	3.16
27	601328	交通银行	10,150,609.00	3.13

28	002594	比亚迪	9,745,524.00	3.01
29	002008	大族激光	9,636,110.00	2.98
30	300059	东方财富	9,549,032.40	2.95
31	002028	思源电气	9,437,764.00	2.91
32	600276	恒瑞医药	9,400,643.00	2.90
33	600309	万华化学	9,341,418.60	2.88
34	000157	中联重科	9,070,843.85	2.80
35	688525	佰维存储	9,036,877.85	2.79
36	600795	国电电力	9,036,309.00	2.79
37	601398	工商银行	8,964,641.00	2.77
38	002415	海康威视	8,762,180.00	2.71
39	688012	中微公司	8,649,377.04	2.67
40	603799	华友钴业	8,645,392.00	2.67
41	688981	中芯国际	8,528,960.91	2.63
42	601601	中国太保	8,517,969.20	2.63
43	002460	赣锋锂业	8,408,138.00	2.60
44	600352	浙江龙盛	8,359,689.00	2.58
45	688041	海光信息	8,260,522.54	2.55
46	002371	北方华创	8,088,228.80	2.50
47	002714	牧原股份	8,021,174.00	2.48
48	300857	协创数据	7,917,441.27	2.45
49	601688	华泰证券	7,759,316.00	2.40
50	600031	三一重工	7,635,987.00	2.36
51	605499	东鹏饮料	7,575,015.00	2.34
52	601211	国泰海通	7,563,248.80	2.34
53	300476	胜宏科技	7,511,332.00	2.32
54	600028	中国石化	7,398,544.00	2.28
55	601668	中国建筑	7,314,297.00	2.26
56	300604	长川科技	7,289,529.00	2.25
57	601108	财通证券	7,275,048.20	2.25
58	601600	中国铝业	7,254,168.00	2.24
59	600549	厦门钨业	7,241,063.00	2.24
60	600522	中天科技	7,143,899.00	2.21
61	600660	福耀玻璃	6,923,586.20	2.14
62	000100	TCL 科技	6,894,250.90	2.13
63	688220	翱捷科技	6,856,060.75	2.12
64	300033	同花顺	6,803,331.00	2.10
65	000733	振华科技	6,780,886.00	2.09
66	002709	天赐材料	6,774,940.01	2.09
67	300014	亿纬锂能	6,671,107.35	2.06
68	301308	江波龙	6,643,645.00	2.05
69	601918	新集能源	6,505,868.00	2.01
70	601169	北京银行	6,487,659.00	2.00

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	2,857,375,688.33
卖出股票收入（成交）总额	2,647,621,855.02

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

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

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。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	4,458,133.51
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,052,851.26
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,510,984.77

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

金额单位：人民币元

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

§ 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 800 增强 A	4,738	43,715.15	0.00	0.00%	207,122,392.11	100.00 %
易方达中证 800 增强 C	18,759	4,899.71	0.00	0.00%	91,913,636.82	100.00 %
合计	23,497	12,726.56	0.00	0.00%	299,036,028.93	100.00 %

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	易方达中证 800 增强 A	5,013.01	0.0024%

员持有本基金	易方达中证 800 增强 C	1,046.37	0.0011%
	合计	6,059.38	0.0020%

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 800 增强 A	0
	易方达中证 800 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 800 增强 A	0
	易方达中证 800 增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 800 增强 A	易方达中证 800 增强 C
基金合同生效日（2026 年 1 月 15 日）基金份额总额	1,954,701,316.29	195,484,213.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	160,150,620.75	60,082,219.20
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,907,729,544.93	163,652,796.36
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	207,122,392.11	91,913,636.82

注：本基金合同生效日为 2026 年 1 月 15 日。

§ 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、基金托管业务的诉讼事项。

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，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

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，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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	
东吴证券	1	125,436.35	0.00%	12.55	0.00%	-
国泰海通	2	1,463,484,396.65	26.60%	146,355.38	26.60%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	1,292,048,267.20	23.48%	129,205.20	23.48%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	870,539,841.97	15.82%	87,058.07	15.82%	-
中信证券	2	1,876,518,665.12	34.10%	187,652.25	34.10%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为东吴证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本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
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	11,399,110,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	16,624.88	100.00%	-	-	-	-

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	易方达中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-16
2	易方达中证 800 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-04
3	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
4	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-21
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理	上海证券报、基金管理人	2026-03-23

	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	网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	关于易方达中证 800 指数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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
7	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
8	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
9	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	上海证券报	2026-04-22
10	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
12	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
14	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23
15	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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 800 指数增强型证券投资基金注册的文件；

- 2.《易方达中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

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