

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联 接基金

2026 年中期报告

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 期末投资目标基金明细	47
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.4 期末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	48
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.7 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	58
7.8 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	58
7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.10 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	58
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	58

7.12	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.13	投资组合报告附注	58
§ 8	基金份额持有人信息	60
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9	开放式基金份额变动	61
§ 10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	61
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
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	62
10.8	其他重大事件	65
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
§ 12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	67
12.3	查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金		
基金简称	易方达沪深 300ETF 联接		
基金主代码	110020		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009 年 8 月 26 日		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	11,083,755,912.69 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	易方达沪深 300ETF 联接 A	易方达沪深 300ETF 联接 C	易方达沪深 300ETF 联接 Y
下属分级基金的交易代码	110020	007339	022928
报告期末下属分级基金的份额总额	7,017,164,631.32 份	3,936,274,019.72 份	130,317,261.65 份

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

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

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年化跟踪误差控制在 4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因

	素的基础上，决定采用申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 的买卖。本基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。本基金可投资存托凭证。此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times 95\%$ +活期存款利率(税后) $\times 5\%$
风险收益特征	本基金为沪深 300ETF 的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股（含存托凭证）组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人将采取其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数所代表的市场组合相似的风险收益特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
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25号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路	北京市西城区闹市口大街1号

	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	院1号楼
邮政编码	510627；510623；519031	100033
法定代表人	吴欣荣	张金良

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 1 日至 2026 年 6 月 30 日）		
	易方达沪深 300ETF 联接 A	易方达沪深 300ETF 联接 C	易方达沪深 300ETF 联接 Y
本期已实现收益	441,131,143.43	207,844,838.40	6,361,053.02
本期利润	1,119,253,134.79	581,870,635.10	18,474,564.71
加权平均基金份额本期利润	0.1579	0.1521	0.1647
本期加权平均净值利润率	8.28%	8.09%	8.62%
本期基金份额净值增长率	8.28%	8.17%	8.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	易方达沪深 300ETF 联接 A	易方达沪深 300ETF 联接 C	易方达沪深 300ETF 联接 Y
期末可供分配利润	6,867,949,849.44	3,750,722,289.90	127,543,893.01
期末可供分配基金份额利润	0.9787	0.9529	0.9787
期末基金资产净值	14,127,047,017.76	7,811,462,831.58	262,354,026.34
期末基金份额净值	2.0132	1.9845	2.0132
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	易方达沪深 300ETF 联接 A	易方达沪深 300ETF 联接 C	易方达沪深 300ETF 联接 Y

基金份额累计净值增长率	101.32%	47.32%	29.84%
-------------	---------	--------	--------

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达沪深 300ETF 联接 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	12.20%	1.19%	11.30%	1.19%	0.90%	0.00%
过去六个月	8.28%	1.07%	7.20%	1.07%	1.08%	0.00%
过去一年	28.07%	0.97%	25.13%	0.97%	2.94%	0.00%
过去三年	37.24%	1.04%	28.26%	1.06%	8.98%	-0.02%
过去五年	7.47%	1.05%	-4.02%	1.06%	11.49%	-0.01%
过去七年	52.10%	1.10%	29.33%	1.11%	22.77%	-0.01%
过去十年	95.70%	1.08%	55.78%	1.09%	39.92%	-0.01%
自基金合同生效起至今	101.32%	1.27%	59.81%	1.30%	41.51%	-0.03%

易方达沪深 300ETF 联接 C

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

易方达沪深 300ETF 联接 Y

阶段	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	12.20%	1.19%	11.30%	1.19%	0.90%	0.00%
过去六个月	8.28%	1.07%	7.20%	1.07%	1.08%	0.00%

过去一年	28.07%	0.97%	25.13%	0.97%	2.94%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	29.84%	0.96%	25.26%	0.96%	4.58%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金
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

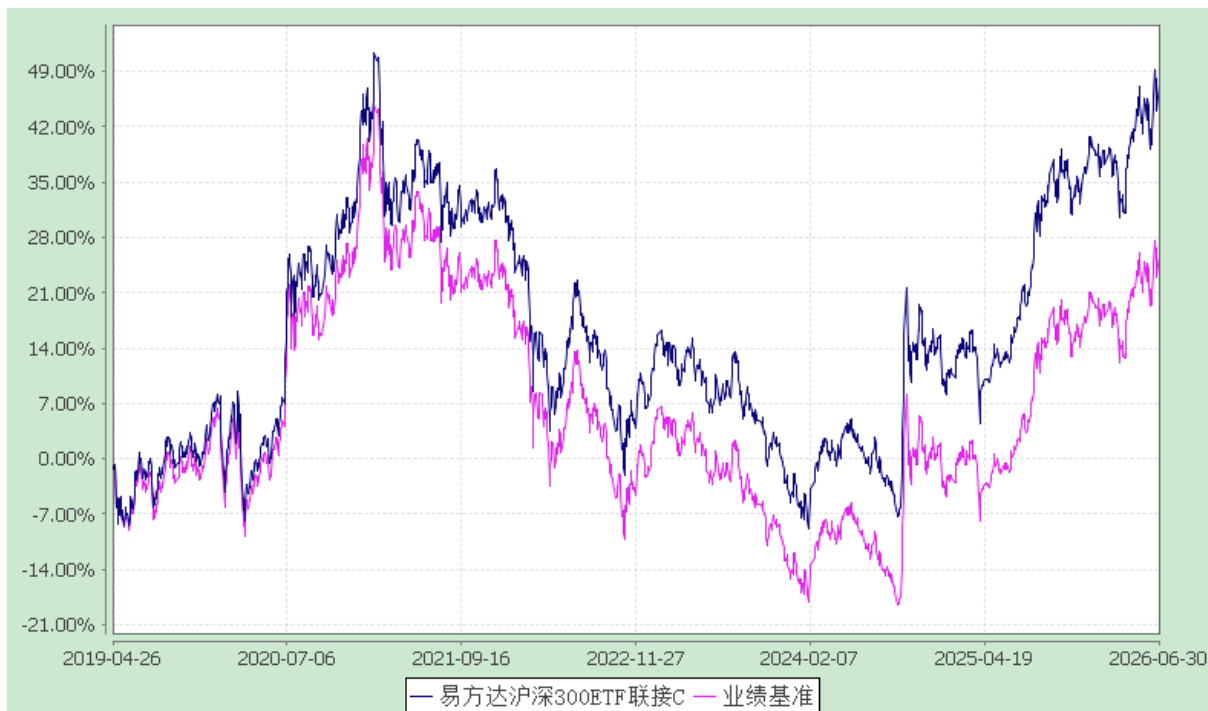
易方达沪深 300ETF 联接 A

(2009 年 8 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日)



易方达沪深 300ETF 联接 C

(2019 年 4 月 26 日至 2026 年 6 月 30 日)



易方达沪深 300ETF 联接 Y

(2024 年 12 月 16 日至 2026 年 6 月 30 日)



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

2.自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2024 年 12 月 16 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
余海燕	本基金的基金经理，易方达沪深 300 医药 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF、易方达沪深 300 非银 ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF、易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）、易方达沪深 300 医药 ETF 联接、易方达恒生国企 ETF 联接（QDII）、易方达恒生国企（QDII-ETF）、易方达中证海外中国互联网 50ETF 联接（QDII）、易方达中证 500ETF 联接、易方达奥明日经 225ETF（QDII）、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证券公司指数（LOF）、易方达中证军工 ETF、易方达上证 50 指数（LOF）的基金经理，指数投资部副总经理、指数投资决策委员会委员	2016-04-16	-	21 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇丰银行 Consumer Credit Risk 信用风险分析师，华宝兴业基金管理有限公司分析师、基金经理助理、基金经理，易方达基金管理有限公司投资发展部产品经理，易方达上证 50 分级、易方达国企改革分级、易方达军工分级、易方达证券公司分级、易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理。
庞亚平	本基金的基金经理，易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF 联接、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 A100ETF（自 2023 年 07 月 11 日至 2026 年 02 月 10 日）、易	2022-12-15	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管，华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量投资部总监，易方达基金管理有限公司易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达中证光伏产业

方达上证科创板成长 ETF（自 2023 年 08 月 23 日至 2026 年 02 月 10 日）、易方达上证科创板 100ETF（自 2023 年 11 月 08 日至 2026 年 02 月 10 日）、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达中证 A500ETF 联接、易方达中证 A500ETF、易方达上证科创板综合 ETF 联接、易方达中证数字经济主题 ETF 的基金经理，指数研究发展部总经理、指数投资决策委员会委员				指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理。
--	--	--	--	---

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

- 2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。
- 3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 64 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

2026 年上半年，中国经济在外部环境更趋复杂严峻、全球供应链深度重构与国内结构调整持续深化的大背景下，保持战略定力，宏观政策加力提效、靠前发力，存量政策与增量政策协同共振，推动“两重”“两新”政策扩围落地，加快超长期特别国债与专项债实物工作量形成，经济运行整体延续回升向好、质效双升的良好态势。面对全球贸易壁垒持续升级、地缘政治博弈复杂化，以及国内房地产市场延续筑底调整、部分传统行业经营压力犹存等困难挑战，中国政府坚持稳中求进工作总基调，统筹扩大内需和深化供给侧结构性改革，工业生产保持较强韧性，就业物价总体平稳，消费市场渐进回暖，有效投资稳步扩大，出口结构持续优化，新质生产力加速培育壮大，经济结构优化升级步伐加快。上半年我国 GDP 为 69.6 万亿元，按不变价格计算，同比增长 4.7%，上半年经济增速延续了稳中向好的发展态势，经济高质量发展取得新进展，充分彰显了中国经济的韧性与潜力。上半年宏观经济的平稳运行有效夯实了资本市场的基本面，为 A 股市场平稳运行筑牢了根基，有效提振了市场长期发展信心，为资本市场估值修复、结构优化提供了坚实支撑。同时，国内人工智能、高端芯片、先进制造等领域技术突破持续落地，科技创新产业集群加速成型，海内外投资者对中国硬核科技实力、产业升级潜力的认知持续深化，推动优质中国资产迎来系统性价值重估。

资本市场方面，上半年 A 股市场整体呈现“先抑后扬、震荡上行、结构分化显著”的运行特征，投资者情绪在政策托底与科技突破的双重提振下逐步修复。一季度地缘冲突成为市场最大外部变量，能源与安全主线领涨、高估值成长板块承压；二季度受益于人工智能大模型商业化加速落地及算力基建政策持续催化，科技成长主线持续领涨，人工智能、算力芯片、数字经济、高端装备等科技板块持续走强，成长风格占据市场主导。报告期内，从市场主流指数表现来看，代表科技创新方向的科创 50、科创创业 50、创业板指等成长风格指数在科技行情驱动下表现领先，中证 500、中证 1000 等中小盘指数亦有较好表现，沪深 300 指数表现稳健，而上证 50、中证红利等价值风格指数表现则相对落后。行业层面，受益于 AI 硬件及应用等产业政策密集催化、景气度持续向好的电子、通信等板块表现亮眼；而商贸零售、保险、农林牧渔、食品饮料、房地产链、社会服务等板块受制于需求恢复偏缓及行业周期下行压力，整体表现相对落后。

沪深 300 指数作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，聚集 A 股最核心的权益资产，涵盖了各行业龙头，指数表现跟中国宏观经济周期以及各行业龙头上市公司整体盈利状况息息相关，与

A 股大盘走势基本保持一致。报告期内指数中的电子、通信、建筑材料、机械设备等行业的成份股涨幅居前，对沪深 300 指数收益贡献较大，而非银金融、银行、食品饮料、汽车等行业的成份股表现相对落后。报告期内沪深 300 指数上涨 7.55%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，依据基金申赎变动等情况进行日常组合管理，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 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 2.0132 元，本报告期份额净值增长率为 8.28%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%；C 类基金份额净值为 1.9845 元，本报告期份额净值增长率为 8.17%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%；Y 类基金份额净值为 2.0132 元，本报告期份额净值增长率为 8.28%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。年化跟踪误差 0.37%，在合同约定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，中国经济增速延续了稳中向好的发展态势，经济高质量发展取得新进展，彰显了中国经济的强大韧性。上半年宏观经济的平稳运行为下半年持续健康发展奠定了坚实基础，新质生产力加速培育壮大，人工智能、商业航天、低空经济、人形机器人等前沿领域加速突破，高技术制造业与装备制造业持续领跑，经济转型升级和产业结构优化向纵深推进，为“十五五”良好开局积蓄了充沛动能。展望 2026 年下半年，中国经济高质量发展的态势有望持续巩固，经济增速将继续在全球主要经济体中保持领先。随着宏观政策逆周期与跨周期调节协同发力，已出台的一揽子存量政策和增量政策效果将进一步显现，超长期特别国债与专项债资金加速落地见效，预计下半年基建投资和制造业投资将保持较强韧性，消费市场在居民收入改善与促消费政策扩围加力的双重支撑下有望持续回暖，出口在产业链优势与新兴市场开拓的共同作用下将保持较强竞争力。国内物价水平有望在需求持续修复与基数效应的叠加下实现温和回升，企业盈利空间逐步改善，经济有望彻底走出价格收缩区间。尽管外部环境不确定性依然突出，全球经济复苏乏力、地缘政治博弈复杂化、贸易摩擦反复等因素仍构成扰动，但中国政策“工具箱”储备充足，财政政策、货币政策、产业政策协同发力空间较大，预计下半年宏观政策将继续精准发力、靠前发力，有效对冲外部风险挑战，为经济稳定运行提供坚实保障。新质生产力加速释放也将持续催生新产业、新业态、新经济增长点，为经济高质量发展注入源源不断的内生动力。

资本市场方面，A 股市场在基本面持续修复、政策红利密集释放、流动性环境整体充裕的多重共振下，有望延续震荡上行格局。下半年，随着美联储降息周期可能开启、全球流动性环境趋于改善，外资回流 A 股市场的动能有望增强，叠加国内中长期资金持续入市，市场资金面整体偏宽松。从结构上看，A 股市场或将延续结构性行情特征，成长与价值风格轮动有望更加均衡。科技成长板

块在人工智能商业化加速落地、算力基建持续投入、半导体国产替代深化等因素驱动下，仍有较大演绎空间，但板块内部分化可能加大，具备核心技术突破和真实业绩支撑的优质标的有望胜出；受益于经济复苏预期升温及物价水平温和回升，消费板块中的新消费、医药等细分领域配置价值凸显；顺周期方向，随着稳增长政策持续加码，银行、非银金融等板块估值修复行情仍有空间；高股息红利资产在利率低位环境下仍将受到长期资金青睐。整体而言，在宏观经济平稳运行、产业升级趋势明确、资本市场改革深化推进的背景下，优质赛道与行业龙头企业的配置优势将进一步凸显，A 股市场有望在下半年走出更加稳健的结构性上涨行情。

指数的长期收益表现取决于其成份股盈利的长期增长情况，沪深 300 指数作为 A 股市场的核心宽基指数，涵盖了中国经济中主要行业的龙头企业，这些企业的盈利会随着整体经济的增长而相应增长。长期来看沪深 300 指数表现与 GDP 增速基本一致，是分享中国经济增长的有效工具。在稳字当头、政策托底的宏观背景下，A 股上市公司中符合国家发展战略和市场需求的各行业龙头优质企业有望保持良好的成长性和稳健的财务业绩，作为 A 股市场最具有代表性的大盘蓝筹指数，沪深 300 指数的长期配置价值将随着时间推移而逐渐显现。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者分享中国证券市场的长期成长提供良好的投资工具。

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

易方达沪深 300ETF 联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达沪深 300ETF 联接 C:本报告期内未实施利润分配。

易方达沪深 300ETF 联接 Y: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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查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。

§ 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：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	833,748,790.16	638,083,377.02
结算备付金		97,571,996.72	62,576,452.02
存出保证金		49,749,801.05	31,181,186.01

交易性金融资产	6.4.7.2	21,200,983,531.91	18,514,002,982.72
其中：股票投资		153,175,690.57	147,644,730.66
基金投资		20,534,910,307.09	17,857,527,567.13
债券投资		512,897,534.25	508,830,684.93
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		38,984,115.04	21,377,893.31
应收股利		-	-
应收申购款		71,230,347.19	38,332,523.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	97,527.19	-
资产总计		22,292,366,109.26	19,305,554,414.60
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,640.28	-
应付赎回款		87,227,547.00	64,204,529.67
应付管理人报酬		201,512.43	177,506.67
应付托管费		67,170.84	59,168.88
应付销售服务费		1,236,970.63	1,081,173.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,513,250.39	6,022,796.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	248,142.01	186,024.65
负债合计		91,502,233.58	71,731,200.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	11,083,755,912.69	10,387,334,921.73
未分配利润	6.4.7.8	11,117,107,962.99	8,846,488,292.15
净资产合计		22,200,863,875.68	19,233,823,213.88
负债和净资产总计		22,292,366,109.26	19,305,554,414.60

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.0132 元，C 类基金份额净值 1.9845 元，Y 类基金份额净值 2.0132 元；基金份额总额 11,083,755,912.69 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 7,017,164,631.32 份，C 类基金份额总额 3,936,274,019.72 份，Y 类基金份额总额

130,317,261.65 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,729,642,263.51	316,332,383.43
1.利息收入		2,248,761.17	2,290,029.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,248,761.17	2,290,029.20
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		659,045,303.86	191,562,594.33
其中：股票投资收益	6.4.7.10	13,391,959.33	6,153,568.40
基金投资收益	6.4.7.11	319,558,122.26	86,449,212.11
债券投资收益	6.4.7.12	7,016,849.32	3,486.59
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	28,060,143.11	6,884,148.51
股利收益	6.4.7.15	291,018,229.84	92,072,178.72
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,064,261,299.75	119,938,828.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,086,898.73	2,540,931.67
减：二、营业总支出		10,043,928.91	7,853,688.14
1. 管理人报酬		1,179,779.64	967,249.07
2. 托管费		393,259.94	322,416.39
3. 销售服务费		7,133,267.66	6,118,376.36
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		68,097.74	-
其中：卖出回购金融资产支出		68,097.74	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		1,162,930.96	336,608.73
8. 其他费用	6.4.7.19	106,592.97	109,037.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,719,598,334.60	308,478,695.29
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,719,598,334.60	308,478,695.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,719,598,334.60	308,478,695.29

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,387,334,921.73	8,846,488,292.15	19,233,823,213.88
二、本期期初净资产	10,387,334,921.73	8,846,488,292.15	19,233,823,213.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	696,420,990.96	2,270,619,670.84	2,967,040,661.80
（一）、综合收益总额	-	1,719,598,334.60	1,719,598,334.60
（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）	696,420,990.96	551,021,336.24	1,247,442,327.20
其中：1.基金申购款	5,730,963,352.59	5,079,387,230.35	10,810,350,582.94
2.基金赎回款	-5,034,542,361.63	-4,528,365,894.11	-9,562,908,255.74
（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	11,083,755,912.69	11,117,107,962.99	22,200,863,875.68
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	13,243,005,490.72	7,237,102,372.25	20,480,107,862.97
二、本期期初净资产	13,243,005,490.72	7,237,102,372.25	20,480,107,862.97

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,003,467,911.07	-313,440,366.35	-1,316,908,277.42
（一）、综合收益总额	-	308,478,695.29	308,478,695.29
（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）	-1,003,467,911.07	-621,919,061.64	-1,625,386,972.71
其中：1.基金申购款	4,492,180,687.67	2,242,245,034.89	6,734,425,722.56
2.基金赎回款	-5,495,648,598.74	-2,864,164,096.53	-8,359,812,695.27
（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	12,239,537,579.65	6,923,662,005.90	19,163,199,585.55

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：王永铨

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金（原名易方达沪深 300 指数证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2009]第 646 号《关于核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达沪深 300 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 16,746,252,366.35 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,539,280.61 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中国证监会 2013 年 9 月 17 日下发的《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2013]812 号），易方达沪深 300 指数证券投资基金自 2013

年 9 月 17 日起变更为易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金，修改基金合同中基金的名称、投资范围、基金份额申购和赎回、基金的投资和估值、基金的费用、基金份额持有人大会等条款。

自 2019 年 4 月 25 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2019 年 4 月 26 日。自 2024 年 12 月 13 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2024 年 12 月 16 日。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、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、国家税务总局财税[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 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、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》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》的规定：

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。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% 的规定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。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。

至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税及金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，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，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，免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（3）企业所得税

证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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	833,748,790.16
等于：本金	833,674,736.06
加：应计利息	74,054.10
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	833,748,790.16

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		121,060,195.87	-	153,175,690.57	32,115,494.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	505,886,500.00	11,397,534.25	512,897,534.25	-4,386,500.00
	合计	505,886,500.00	11,397,534.25	512,897,534.25	-4,386,500.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		16,521,480,708.43	-	20,534,910,307.09	4,013,429,598.66
其他		-	-	-	-
合计		17,148,427,404.3	11,397,534.25	21,200,983,531.91	4,041,158,593.36

	0			
--	---	--	--	--

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	386,794,440.00	-	-	-
IF2609	386,794,440.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	386,794,440.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2609	IF2609	270	392,833,800.00	6,039,360.00
合计	-	-	-	6,039,360.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	6,039,360.00
净额	-	-	-	-

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

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-

其他应收款	97,527.19
待摊费用	-
合计	97,527.19

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	121,329.59
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	52,428.66
其中：交易所市场	51,933.66
银行间市场	495.00
应付利息	-
预提费用	74,383.76
合计	248,142.01

6.4.7.7 实收基金

易方达沪深 300ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,093,390,222.00	7,093,390,222.00
本期申购	2,307,360,777.90	2,307,360,777.90
本期赎回（以“-”号填列）	-2,383,586,368.58	-2,383,586,368.58
本期末	7,017,164,631.32	7,017,164,631.32

易方达沪深 300ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,221,359,208.95	3,221,359,208.95
本期申购	3,335,783,877.27	3,335,783,877.27
本期赎回（以“-”号填列）	-2,620,869,066.50	-2,620,869,066.50

本期末	3,936,274,019.72	3,936,274,019.72
-----	------------------	------------------

易方达沪深 300ETF 联接 Y

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,585,490.78	72,585,490.78
本期申购	87,818,697.42	87,818,697.42
本期赎回（以“-”号填列）	-30,086,926.55	-30,086,926.55
本期末	130,317,261.65	130,317,261.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达沪深 300ETF 联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,498,344,466.73	-402,806,869.08	6,095,537,597.65
本期期初	6,498,344,466.73	-402,806,869.08	6,095,537,597.65
本期利润	441,131,143.43	678,121,991.36	1,119,253,134.79
本期基金份额交易产生的变动数	-71,525,760.72	-33,382,585.28	-104,908,346.00
其中：基金申购款	2,209,667,420.31	-125,816,624.74	2,083,850,795.57
基金赎回款	-2,281,193,181.03	92,434,039.46	-2,188,759,141.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,867,949,849.44	241,932,537.00	7,109,882,386.44

易方达沪深 300ETF 联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,876,529,281.64	-187,952,585.04	2,688,576,696.60
本期期初	2,876,529,281.64	-187,952,585.04	2,688,576,696.60
本期利润	207,844,838.40	374,025,796.70	581,870,635.10
本期基金份额交易产生的变动数	666,348,169.86	-61,606,689.70	604,741,480.16
其中：基金申购款	3,105,507,743.23	-189,090,423.02	2,916,417,320.21
基金赎回款	-2,439,159,573.37	127,483,733.32	-2,311,675,840.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,750,722,289.90	124,466,521.96	3,875,188,811.86

易方达沪深 300ETF 联接 Y

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	66,495,879.45	-4,121,881.55	62,373,997.90
本期期初	66,495,879.45	-4,121,881.55	62,373,997.90
本期利润	6,361,053.02	12,113,511.69	18,474,564.71
本期基金份额交易产生的变动数	54,686,960.54	-3,498,758.46	51,188,202.08
其中：基金申购款	83,561,245.18	-4,442,130.61	79,119,114.57
基金赎回款	-28,874,284.64	943,372.15	-27,930,912.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	127,543,893.01	4,492,871.68	132,036,764.69

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,434,451.24
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	659,540.71
其他	154,769.22
合计	2,248,761.17

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	19,440,927.55
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-6,048,968.22
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	13,391,959.33

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	202,413,557.19
减：卖出股票成本总额	182,503,805.95
减：交易费用	468,823.69
买卖股票差价收入	19,440,927.55

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	3,218,029,650.00
减：现金支付申购款总额	1,273,103,506.33
减：申购股票成本总额	1,950,975,111.89
减：交易费用	-
申购差价收入	-6,048,968.22

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,927,673,201.63
减：卖出/赎回基金成本总额	1,599,164,948.28
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	8,848,140.75
减：交易费用	101,990.34
基金投资收益	319,558,122.26

6.4.7.12 债券投资收益**6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	7,016,849.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	7,016,849.32

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	28,060,143.11

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,266,545.74
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	289,751,684.10
合计	291,018,229.84

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	1,064,042,599.75
——股票投资	14,827,845.30
——债券投资	-2,950,000.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	1,052,164,754.45
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	218,700.00
——权证投资	-
——期货投资	218,700.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,064,261,299.75

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	4,086,898.73
合计	4,086,898.73

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	14,876.39

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
银行汇划费	13,609.21
其他	600.00
合计	106,592.97

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,575,085,395.53	70.42%	294,513.45	0.02%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
广发证券	604,590,932.49	33.89%	-	-

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	157,508.88	70.42%	772.29	1.49%
关联方名称	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	29.45	0.02%	5.69	0.01%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年1月1日至2026年6月 30日	2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,179,779.64	967,249.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,423,324.39	5,381,011.34
应支付基金管理人的净管理费	-4,243,544.75	-4,413,762.27

注：1.本基金管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金管理人的管理费每日计提，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，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2.对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	393,259.94	322,416.39

注：本基金托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

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，自动在月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人如发现数据不符，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1日至2026年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	易方达沪深300ETF 联接A	易方达沪深300ETF 联接C	易方达沪深300ETF 联接Y	合计
易方达基金管理有限公司	-	2,909,873.82	-	2,909,873.82
中国建设银行	-	118,670.26	-	118,670.26
广发证券	-	12,961.13	-	12,961.13
易方达财富	-	12,452.32	-	12,452.32
合计	-	3,053,957.53	-	3,053,957.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	易方达沪深300ETF 联接A	易方达沪深300ETF 联接C	易方达沪深300ETF 联接Y	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,450,839.41	-	1,450,839.41
中国建设银行	-	24,808.86	-	24,808.86
广发证券	-	6,115.34	-	6,115.34
合计	-	1,481,763.61	-	1,481,763.61

注：本基金 A 类基金份额、Y 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 0.2%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率

的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达沪深 300ETF 联接 A

无。

易方达沪深 300ETF 联接 C

无。

易方达沪深 300ETF 联接 Y

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	833,748,790.16	1,434,451.24	1,070,579,139.23	1,947,708.28

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
广发证券股份有限公司	920189	康美特	新股发行	200	1,628.00
上年度可比期间					

2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40

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

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 4,219,993,487 份和 3,921,886,888 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 36.24%和 5.95%。本基金在报告期内因赎回目标 ETF 基金份额而持有托管人建设银行发行的 A 股建设银行。于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有建设银行发行的 A 股建设银行（2025 年 12 月 31 日：无）。

6.4.11 利润分配情况

易方达沪深 300ETF 联接 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达沪深 300ETF 联接 C

本报告期内未发生利润分配。

易方达沪深 300ETF 联接 Y

本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001248	华润新能	2026-06-24	6 个月	新股流通	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-

	源			受限						
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
30169	三瑞	2026-0	6 个月	新股	24.68	86.80	216	5,330.	18,748	-

6	智能	3-31		流通受限				88	.80	
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-

688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
920189	康美特	2026-06-30	1 个月以内	新股流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
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	-

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	1,248	815,198.56	1,097,653.44	-

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。

本基金为沪深 300ETF 的联接基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金；本基金主要通过投资沪深 300ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，具有与业绩比较基准相似的风险收益特征。

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 0.00%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
--------	-------------------	---------------------

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	512,897,534.25	508,830,684.93
合计	512,897,534.25	508,830,684.93

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2026 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VaR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	833,748,790.16	-	-	-	833,748,790.16
结算备付金	97,571,996.72	-	-	-	97,571,996.72
存出保证金	49,749,801.05	-	-	-	49,749,801.05
交易性金融资产	512,897,534.25	-	-	20,688,085,997.66	21,200,983,531.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	38,984,115.04	38,984,115.04
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	71,230,347.19	71,230,347.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	97,527.19	97,527.19
资产总计	1,493,968,122.18	-	-	20,798,397,987.08	22,292,366,109.26

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	-	-	-	7,640.28	7,640.28
应付赎回款	-	-	-	87,227,547.00	87,227,547.00
应付管理人报酬	-	-	-	201,512.43	201,512.43
应付托管费	-	-	-	67,170.84	67,170.84
应付销售服务费	-	-	-	1,236,970.63	1,236,970.63
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,513,250.39	2,513,250.39
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	248,142.01	248,142.01
负债总计	-	-	-	91,502,233.58	91,502,233.58
利率敏感度缺口	1,493,968,122.18	-	-	20,706,895,753.50	22,200,863,875.68
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	638,083,377.02	-	-	-	638,083,377.02
结算备付金	62,576,452.02	-	-	-	62,576,452.02
存出保证金	31,181,186.01	-	-	-	31,181,186.01
交易性金融资产	508,830,684.93	-	-	18,005,172,297.79	18,514,002,982.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	21,377,893.31	21,377,893.31
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	38,332,523.52	38,332,523.52
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,240,671,699.98	-	-	18,064,882,714.6	19,305,554,414.58

				2	4.60
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	64,204,529.67	64,204,529.67
应付管理人报酬	-	-	-	177,506.67	177,506.67
应付托管费	-	-	-	59,168.88	59,168.88
应付销售服务费	-	-	-	1,081,173.87	1,081,173.87
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,022,796.98	6,022,796.98
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	186,024.65	186,024.65
负债总计	-	-	-	71,731,200.72	71,731,200.72
利率敏感度缺口	1,240,671,699.98	-	-	17,993,151,513.90	19,233,823,213.88

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	246,859.30	866,489.04
	2.市场利率上升 25 个基点	-246,616.70	-863,522.24

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。本基金主要投资于跟踪的目标 ETF、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管

理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VaR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	153,175,690.57	0.69	147,644,730.66	0.77
交易性金融资产—基金投资	20,534,910,307.09	92.50	17,857,527,567.13	92.84
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	20,688,085,997.66	93.19	18,005,172,297.79	93.61

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,089,329,296.34	887,548,509.02
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,089,329,296.34	-887,548,509.02

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	20,677,415,543.78
第二层次	514,855,447.13
第三层次	8,712,541.00
合计	21,200,983,531.91

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	153,175,690.57	0.69
	其中：股票	153,175,690.57	0.69
2	基金投资	20,534,910,307.09	92.12
3	固定收益投资	512,897,534.25	2.30
	其中：债券	512,897,534.25	2.30

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	931,320,786.88	4.18
8	其他各项资产	160,061,790.47	0.72
9	合计	22,292,366,109.26	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

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

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	780,956.00	0.00
B	采矿业	5,457,596.62	0.02
C	制造业	104,704,099.97	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,916,886.79	0.02
E	建筑业	1,339,126.28	0.01
F	批发和零售业	203,434.80	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,038,105.26	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,904,984.57	0.04
J	金融业	22,110,388.28	0.10
K	房地产业	465,551.00	0.00

L	租赁和商务服务业	580,500.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,394,512.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	187,502.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	92,047.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	153,175,690.57	0.69

7.4 期末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	6,200	7,874,000.00	0.04
2	300750	宁德时代	17,000	6,681,170.00	0.03
3	300502	新易盛	8,820	5,353,740.00	0.02
4	688256	寒武纪	2,307	3,680,933.85	0.02
5	600519	贵州茅台	2,900	3,437,921.00	0.02
6	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.01
7	603986	兆易创新	3,200	2,608,000.00	0.01
8	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.01
9	002371	北方华创	2,750	2,432,540.00	0.01
10	000333	美的集团	31,500	2,379,195.00	0.01
11	601318	中国平安	48,239	2,302,929.86	0.01
12	002475	立讯精密	32,400	2,280,960.00	0.01
13	000725	京东方 A	234,100	2,031,988.00	0.01
14	600036	招商银行	55,546	1,971,883.00	0.01
15	002384	东山精密	7,200	1,888,920.00	0.01
16	601899	紫金矿业	73,800	1,855,332.00	0.01
17	688012	中微公司	3,721	1,743,288.50	0.01
18	300059	东方财富	80,600	1,642,628.00	0.01
19	688008	澜起科技	5,029	1,558,487.10	0.01
20	688981	中芯国际	9,416	1,495,449.12	0.01
21	300274	阳光电源	9,400	1,494,788.00	0.01
22	600900	长江电力	54,700	1,447,909.00	0.01
23	603259	药明康德	11,200	1,394,512.00	0.01
24	002594	比亚迪	17,300	1,378,810.00	0.01
25	688041	海光信息	3,663	1,356,408.90	0.01
26	002463	沪电股份	8,700	1,329,360.00	0.01

27	601138	工业富联	18,100	1,305,915.00	0.01
28	300394	天孚通信	4,228	1,279,731.04	0.01
29	601166	兴业银行	75,500	1,250,280.00	0.01
30	600030	中信证券	43,459	1,248,577.07	0.01
31	600183	生益科技	7,000	1,213,800.00	0.01
32	300408	三环集团	6,600	1,101,540.00	0.00
33	688072	拓荆科技	1,248	1,097,653.44	0.00
34	000651	格力电器	28,700	1,076,250.00	0.00
35	600276	恒瑞医药	20,000	1,040,800.00	0.00
36	300476	胜宏科技	3,000	1,039,290.00	0.00
37	601398	工商银行	144,700	1,023,029.00	0.00
38	688521	芯原股份	2,653	984,634.42	0.00
39	000338	潍柴动力	34,600	942,850.00	0.00
40	601211	国泰海通	51,064	929,364.80	0.00
41	000858	五粮液	12,500	925,000.00	0.00
42	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.00
43	600176	中国巨石	10,800	787,104.00	0.00
44	601288	农业银行	128,500	779,995.00	0.00
45	601328	交通银行	120,003	771,619.29	0.00
46	603019	中科曙光	7,100	761,333.00	0.00
47	600522	中天科技	12,400	752,432.00	0.00
48	000988	华工科技	4,000	738,440.00	0.00
49	002916	深南电路	1,590	728,061.00	0.00
50	600584	长电科技	6,900	714,495.00	0.00
51	600919	江苏银行	65,700	708,246.00	0.00
52	301308	江波龙	1,000	703,800.00	0.00
53	002028	思源电气	4,000	692,000.00	0.00
54	603993	洛阳钼业	39,200	687,960.00	0.00
55	600150	中国船舶	20,341	687,322.39	0.00
56	600887	伊利股份	28,400	680,464.00	0.00
57	300124	汇川技术	9,300	616,869.00	0.00
58	002415	海康威视	17,900	612,180.00	0.00
59	601816	京沪高铁	131,300	594,789.00	0.00
60	600309	万华化学	8,612	589,146.92	0.00
61	000100	TCL 科技	101,050	588,111.00	0.00
62	000063	中兴通讯	15,800	571,802.00	0.00
63	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00
64	600111	北方稀土	11,600	557,380.00	0.00
65	601688	华泰证券	25,900	534,058.00	0.00
66	300433	蓝思科技	9,800	525,868.00	0.00
67	601857	中国石油	59,600	517,328.00	0.00
68	600000	浦发银行	59,301	510,581.61	0.00
69	600089	特变电工	22,630	509,175.00	0.00
70	600549	厦门钨业	5,900	502,680.00	0.00

71	002050	三花智控	10,900	477,747.00	0.00
72	002142	宁波银行	16,000	475,040.00	0.00
73	000001	平安银行	47,200	474,360.00	0.00
74	601088	中国神华	12,100	472,384.00	0.00
75	000792	盐湖股份	15,500	467,945.00	0.00
76	002714	牧原股份	13,200	461,868.00	0.00
77	002230	科大讯飞	11,300	461,492.00	0.00
78	600031	三一重工	26,430	456,710.40	0.00
79	688082	盛美上海	1,004	433,728.00	0.00
80	601601	中国太保	15,043	429,026.36	0.00
81	688126	沪硅产业	10,603	422,953.67	0.00
82	603501	豪威集团	4,315	409,277.75	0.00
83	300760	迈瑞医疗	2,986	405,588.38	0.00
84	600406	国电南瑞	17,660	403,531.00	0.00
85	601668	中国建筑	92,400	401,016.00	0.00
86	300014	亿纬锂能	6,100	396,683.00	0.00
87	300033	同花顺	1,620	390,420.00	0.00
88	300661	圣邦股份	2,710	388,830.80	0.00
89	601229	上海银行	44,666	387,700.88	0.00
90	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.00
91	300442	润泽科技	4,600	382,122.00	0.00
92	002353	杰瑞股份	2,500	381,250.00	0.00
93	688111	金山办公	1,754	373,689.70	0.00
94	601919	中远海控	28,180	373,666.80	0.00
95	000938	紫光股份	12,900	372,294.00	0.00
96	688396	华润微	3,802	370,885.10	0.00
97	601988	中国银行	64,700	370,084.00	0.00
98	000425	徐工机械	45,700	369,713.00	0.00
99	002938	鹏鼎控股	3,500	368,830.00	0.00
100	002352	顺丰控股	11,700	365,742.00	0.00
101	601728	中国电信	70,111	363,876.09	0.00
102	002709	天赐材料	7,000	360,010.00	0.00
103	002460	赣锋锂业	5,500	359,700.00	0.00
104	600016	民生银行	111,700	359,674.00	0.00
105	688271	联影医疗	3,541	358,455.43	0.00
106	601012	隆基绿能	27,289	358,031.68	0.00
107	600999	招商证券	16,800	354,480.00	0.00
108	601225	陕西煤业	17,400	354,090.00	0.00
109	600941	中国移动	4,100	353,133.00	0.00
110	002600	领益智造	20,300	352,002.00	0.00
111	000977	浪潮信息	5,000	350,000.00	0.00
112	600690	海尔智家	17,100	349,011.00	0.00
113	600660	福耀玻璃	6,853	345,665.32	0.00
114	000657	中钨高新	3,600	344,592.00	0.00

115	603799	华友钴业	7,100	342,646.00	0.00
116	600160	巨化股份	6,400	339,264.00	0.00
117	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
118	601985	中国核电	37,300	336,819.00	0.00
119	600926	杭州银行	22,700	328,015.00	0.00
120	002602	世纪华通	23,200	327,120.00	0.00
121	601169	北京银行	66,500	325,850.00	0.00
122	300498	温氏股份	25,900	319,088.00	0.00
123	002466	天齐锂业	5,000	306,600.00	0.00
124	002049	紫光国微	3,400	301,750.00	0.00
125	601600	中国铝业	35,700	293,454.00	0.00
126	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.00
127	002179	中航光电	6,300	291,060.00	0.00
128	600938	中国海油	10,700	290,505.00	0.00
129	600028	中国石化	65,000	289,900.00	0.00
130	000568	泸州老窖	3,700	286,824.00	0.00
131	600460	士兰微	5,200	284,232.00	0.00
132	601766	中国中车	54,200	281,840.00	0.00
133	600050	中国联通	70,200	280,800.00	0.00
134	600958	东方证券	29,700	280,368.00	0.00
135	688183	生益电子	2,098	277,775.20	0.00
136	002241	歌尔股份	12,100	272,613.00	0.00
137	601009	南京银行	27,500	271,975.00	0.00
138	000408	藏格矿业	3,900	270,348.00	0.00
139	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
140	603893	瑞芯微	1,400	263,704.00	0.00
141	600118	中国卫星	3,200	262,560.00	0.00
142	601872	招商轮船	14,900	261,793.00	0.00
143	002202	金风科技	10,900	260,510.00	0.00
144	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
145	601628	中国人寿	7,300	258,055.00	0.00
146	300316	晶盛机电	4,200	253,680.00	0.00
147	002625	光启技术	8,300	251,656.00	0.00
148	600362	江西铜业	5,800	251,140.00	0.00
149	601127	赛力斯	4,100	251,125.00	0.00
150	601336	新华保险	4,200	250,572.00	0.00
151	000630	铜陵有色	39,200	249,312.00	0.00
152	601689	拓普集团	4,400	248,248.00	0.00
153	601100	恒立液压	2,300	247,388.00	0.00
154	002837	英维克	3,100	246,636.00	0.00
155	601006	大秦铁路	53,400	246,174.00	0.00
156	601658	邮储银行	49,300	243,049.00	0.00
157	600893	航发动力	6,300	241,542.00	0.00
158	601818	光大银行	83,300	240,737.00	0.00

159	603288	海天味业	7,248	240,343.68	0.00
160	600905	三峡能源	64,600	239,666.00	0.00
161	688047	龙芯中科	1,545	238,965.15	0.00
162	002027	分众传媒	49,100	237,644.00	0.00
163	601727	上海电气	33,800	236,600.00	0.00
164	688506	百利天恒	799	234,929.97	0.00
165	600489	中金黄金	12,900	232,845.00	0.00
166	000807	云铝股份	10,300	228,042.00	0.00
167	600010	宝钢股份	101,400	226,122.00	0.00
168	600760	中航沈飞	5,500	226,050.00	0.00
169	605117	德业股份	2,120	225,101.60	0.00
170	600809	山西汾酒	2,040	223,114.80	0.00
171	605499	东鹏饮料	1,800	222,174.00	0.00
172	600875	东方电气	7,600	218,652.00	0.00
173	600436	片仔癀	2,000	218,560.00	0.00
174	601888	中国中免	4,000	214,840.00	0.00
175	000538	云南白药	4,500	213,165.00	0.00
176	600019	宝钢股份	39,070	212,150.10	0.00
177	002422	科伦药业	5,500	211,860.00	0.00
178	002001	新和成	7,400	210,308.00	0.00
179	002236	大华股份	12,700	209,423.00	0.00
180	601838	成都银行	11,700	207,090.00	0.00
181	002493	荣盛石化	19,100	205,325.00	0.00
182	600104	上汽集团	20,900	203,984.00	0.00
183	601825	沪农商行	26,329	197,204.21	0.00
184	002736	国信证券	19,700	196,803.00	0.00
185	003816	中国广核	50,200	196,282.00	0.00
186	000301	东方盛虹	17,000	194,650.00	0.00
187	000166	申万宏源	43,900	193,160.00	0.00
188	600989	宝丰能源	9,500	193,135.00	0.00
189	002648	卫星化学	8,200	192,618.00	0.00
190	601390	中国中铁	45,900	191,403.00	0.00
191	601698	中国卫通	6,300	190,575.00	0.00
192	601995	中金公司	5,200	187,980.00	0.00
193	300015	爱尔眼科	22,700	187,502.00	0.00
194	002311	海大集团	4,200	187,362.00	0.00
195	601377	兴业证券	31,010	187,300.40	0.00
196	600547	山东黄金	8,100	187,029.00	0.00
197	600795	国电电力	39,800	185,866.00	0.00
198	600221	海航控股	136,900	184,815.00	0.00
199	000768	中航西飞	9,000	184,320.00	0.00
200	600015	华夏银行	28,700	183,393.00	0.00
201	300803	指南针	2,000	183,340.00	0.00
202	600585	海螺水泥	10,800	183,060.00	0.00

203	601669	中国电建	38,500	180,950.00	0.00
204	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
205	300450	先导智能	4,400	179,168.00	0.00
206	301269	华大九天	1,500	179,130.00	0.00
207	300418	昆仑万维	4,400	177,584.00	0.00
208	601916	浙商银行	67,100	176,473.00	0.00
209	601066	中信建投	6,000	174,420.00	0.00
210	603296	华勤技术	2,340	173,791.80	0.00
211	000625	长安汽车	24,200	173,514.00	0.00
212	600346	恒力石化	9,600	170,016.00	0.00
213	000157	中联重科	24,200	168,674.00	0.00
214	688036	传音控股	2,860	168,597.00	0.00
215	601868	中国能建	62,500	166,875.00	0.00
216	600066	宇通客车	6,200	166,222.00	0.00
217	600482	中国动力	5,000	164,000.00	0.00
218	601998	中信银行	23,600	163,548.00	0.00
219	000963	华东医药	5,700	160,284.00	0.00
220	002920	德赛西威	1,900	154,850.00	0.00
221	600426	华鲁恒升	6,400	153,088.00	0.00
222	600011	华能国际	20,100	152,559.00	0.00
223	001280	中国铀业	2,277	151,875.90	0.00
224	002304	洋河股份	3,900	148,785.00	0.00
225	600048	保利发展	32,100	148,623.00	0.00
226	301236	软通动力	3,500	148,575.00	0.00
227	001979	招商蛇口	23,000	147,890.00	0.00
228	000895	双汇发展	6,600	147,840.00	0.00
229	600438	通威股份	12,200	147,742.00	0.00
230	002558	巨人网络	5,300	146,068.00	0.00
231	600570	恒生电子	6,893	146,062.67	0.00
232	600115	中国东航	38,300	145,923.00	0.00
233	002074	国轩高科	5,300	145,803.00	0.00
234	601077	渝农商行	23,600	144,196.00	0.00
235	600886	国投电力	10,800	143,748.00	0.00
236	600188	兖矿能源	8,070	143,403.90	0.00
237	601058	赛轮轮胎	12,200	140,666.00	0.00
238	000975	山金国际	8,100	137,700.00	0.00
239	002532	天山铝业	12,800	137,344.00	0.00
240	601456	国联民生	15,400	136,136.00	0.00
241	300866	安克创新	1,300	135,850.00	0.00
242	601360	三六零	15,500	134,695.00	0.00
243	601901	方正证券	18,304	131,788.80	0.00
244	600026	中远海能	7,300	130,962.00	0.00
245	601111	中国国航	21,600	130,680.00	0.00
246	000002	万科 A	43,500	128,760.00	0.00

247	600415	小商品城	12,600	128,016.00	0.00
248	600674	川投能源	9,000	127,530.00	0.00
249	601186	中国铁建	21,000	124,950.00	0.00
250	600029	南方航空	24,100	124,838.00	0.00
251	600219	南山铝业	30,900	123,291.00	0.00
252	601117	中国化学	16,600	122,010.00	0.00
253	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
254	001965	招商公路	13,100	119,996.00	0.00
255	600233	圆通速递	7,500	118,125.00	0.00
256	601877	正泰电器	4,600	115,322.00	0.00
257	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
258	300628	亿联网络	3,200	108,224.00	0.00
259	000617	中油资本	16,200	106,758.00	0.00
260	300832	新产业	2,500	105,000.00	0.00
261	302132	中航成飞	1,800	104,976.00	0.00
262	601898	中煤能源	8,300	101,094.00	0.00
263	000999	华润三九	4,340	97,606.60	0.00
264	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
265	300896	爱美客	1,100	95,920.00	0.00
266	600009	上海机场	4,000	92,400.00	0.00
267	300251	光线传媒	8,300	92,047.00	0.00
268	300122	智飞生物	7,700	90,013.00	0.00
269	600196	复星医药	4,000	89,880.00	0.00
270	300999	金龙鱼	3,800	88,388.00	0.00
271	000596	古井贡酒	1,100	87,780.00	0.00
272	601788	光大证券	5,900	85,137.00	0.00
273	000708	中信特钢	6,400	80,768.00	0.00
274	688223	晶科能源	16,799	79,795.25	0.00
275	688472	阿特斯	6,655	72,007.10	0.00
276	300413	芒果超媒	4,900	71,687.00	0.00
277	600372	中航机载	6,265	67,975.25	0.00
278	601878	浙商证券	7,100	67,450.00	0.00
279	601881	中国银河	5,200	65,364.00	0.00
280	600930	华电新能	12,755	60,841.35	0.00
281	601633	长城汽车	3,969	59,892.21	0.00
282	601319	中国人保	8,600	58,136.00	0.00
283	600741	华域汽车	3,700	57,424.00	0.00
284	688009	中国通号	11,716	55,768.16	0.00
285	600039	四川路桥	7,104	55,553.28	0.00
286	601021	春秋航空	1,200	54,696.00	0.00
287	603369	今世缘	2,300	54,533.00	0.00
288	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
289	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
290	600588	用友网络	5,800	53,244.00	0.00

291	600023	浙能电力	10,000	52,600.00	0.00
292	601800	中国交建	9,100	51,961.00	0.00
293	600061	国投资本	7,900	51,745.00	0.00
294	600085	同仁堂	2,100	48,531.00	0.00
295	301165	锐捷网络	600	48,270.00	0.00
296	600027	华电国际	10,500	46,725.00	0.00
297	600845	宝信软件	2,768	46,031.84	0.00
298	688303	大全能源	2,608	45,457.44	0.00
299	600918	中泰证券	8,500	45,220.00	0.00
300	600025	华能水电	5,000	44,450.00	0.00
301	601618	中国中冶	18,200	44,408.00	0.00
302	601607	上海医药	2,802	43,150.80	0.00
303	600515	海南机场	14,700	40,278.00	0.00
304	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
305	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
306	600018	上港集团	7,800	36,816.00	0.00
307	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
308	601059	信达证券	2,200	35,618.00	0.00
309	600803	新奥股份	2,000	31,600.00	0.00
310	601018	宁波港	10,000	31,500.00	0.00
311	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
312	601238	广汽集团	5,400	27,432.00	0.00
313	600600	青岛啤酒	500	26,115.00	0.00
314	001391	国货航	5,800	23,606.00	0.00
315	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
316	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
317	601136	首创证券	1,400	19,530.00	0.00
318	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
319	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
320	603392	万泰生物	600	16,182.00	0.00
321	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
322	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
323	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
324	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
325	603260	合盛硅业	300	14,478.00	0.00
326	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
327	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
328	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
329	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
330	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
331	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
332	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
333	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
334	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00

335	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
336	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
337	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
338	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
339	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
340	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	114,642,034.00	0.60
2	601318	中国平安	93,328,787.33	0.49
3	601899	紫金矿业	79,902,477.00	0.42
4	600036	招商银行	66,583,125.90	0.35
5	600900	长江电力	43,564,566.00	0.23
6	601166	兴业银行	42,718,382.06	0.22
7	688041	海光信息	42,677,371.32	0.22
8	600030	中信证券	35,906,478.85	0.19
9	601138	工业富联	33,292,374.00	0.17
10	601398	工商银行	32,072,697.40	0.17
11	600276	恒瑞医药	31,738,226.00	0.17
12	603259	药明康德	31,271,485.00	0.16
13	688008	澜起科技	30,349,133.40	0.16
14	688981	中芯国际	29,560,353.87	0.15
15	601211	国泰海通	29,432,780.00	0.15
16	603986	兆易创新	27,020,442.00	0.14
17	603993	洛阳钼业	26,227,374.00	0.14
18	601288	农业银行	26,200,458.00	0.14
19	601328	交通银行	24,433,522.08	0.13
20	600887	伊利股份	23,502,578.00	0.12

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	9,013,857.00	0.05
2	920186	中科仪	6,963,365.53	0.04
3	601318	中国平安	6,767,798.11	0.04
4	601899	紫金矿业	6,065,551.00	0.03
5	600036	招商银行	5,273,154.00	0.03

6	688041	海光信息	4,079,262.07	0.02
7	600900	长江电力	3,494,308.00	0.02
8	601166	兴业银行	3,316,312.00	0.02
9	688008	澜起科技	2,853,827.42	0.01
10	600030	中信证券	2,753,593.60	0.01
11	688981	中芯国际	2,678,864.14	0.01
12	601138	工业富联	2,654,251.00	0.01
13	603259	药明康德	2,644,209.00	0.01
14	601398	工商银行	2,581,337.00	0.01
15	600276	恒瑞医药	2,480,176.00	0.01
16	603986	兆易创新	2,389,027.65	0.01
17	688820	盛合晶微	2,136,656.12	0.01
18	601288	农业银行	2,097,891.00	0.01
19	601211	国泰海通	2,094,065.00	0.01
20	601328	交通银行	1,958,342.00	0.01

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。

7.5.3 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	2,040,160,776.45
卖出股票收入（成交）总额	202,413,557.19

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。

7.6 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	512,897,534.25	2.31
	其中：政策性金融债	512,897,534.25	2.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	512,897,534.25	2.31

7.7 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	210208	21 国开 08	5,000,000	512,897,534.25	2.31

7.8 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。

7.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 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。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。本基金在出现大额净申赎等需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

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

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

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

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

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.13.2 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。

7.13.3 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	49,749,801.05
2	应收清算款	38,984,115.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	71,230,347.19
6	其他应收款	97,527.19
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	160,061,790.47

7.13.4 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。

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

§ 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
易方达沪深 300ETF 联接 A	812,794	8,633.39	523,614,442.26	7.46%	6,493,550,189.06	92.54%
易方达沪深 300ETF 联接 C	515,710	7,632.73	1,838,758,091.43	46.71%	2,097,515,928.29	53.29%
易方达沪深 300ETF 联接 Y	29,695	4,388.53	0.00	0.00%	130,317,261.65	100.00%
合计	1,358,199	8,160.63	2,362,372,533.69	21.31%	8,721,383,379.00	78.69%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达沪深 300ETF 联接 A	1,607,766.10	0.0229%
	易方达沪深 300ETF 联接 C	660,201.09	0.0168%
	易方达沪深 300ETF 联接 Y	100,000.94	0.0767%
	合计	2,367,968.13	0.0214%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	易方达沪深 300ETF 联接 A	10~50
	易方达沪深 300ETF 联接 C	0
	易方达沪深 300ETF 联接 Y	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达沪深 300ETF 联接 A	0~10

	易方达沪深 300ETF 联接 C	0
	易方达沪深 300ETF 联接 Y	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达沪深 300ETF 联接 A	易方达沪深 300ETF 联接 C	易方达沪深 300ETF 联接 Y
基金合同生效日 (2009 年 8 月 26 日) 基金份额总额	16,746,252,366.35	-	-
本报告期期初基金份额总额	7,093,390,222.00	3,221,359,208.95	72,585,490.78
本报告期基金总申购份额	2,307,360,777.90	3,335,783,877.27	87,818,697.42
减：本报告期基金总赎回份额	2,383,586,368.58	2,620,869,066.50	30,086,926.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,017,164,631.32	3,936,274,019.72	130,317,261.65

§ 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，基金托管人未受到调查或处罚。

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，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理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	
财通证券	2	661,648,393.89	29.58%	66,165.21	29.58%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	1,575,085,395.53	70.42%	157,508.88	70.42%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-

华源证券	1	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为信达证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为开源证券股份有限公司。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额 的比例		购成交 总额的比例		交总额 的比例		交总额 的比例
财通 证券	-	-	-	-	-	-	1,179,235 ,528.40	66.11%
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	604,590,9 32.49	33.89%
国海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰	-	-	-	-	-	-	-	-

前海								
开源	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
民生	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
南京	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
平安	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
上海	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
申万	-	-	-	-	-	-	-	-
宏源								
太平	-	-	-	-	-	-	-	-
洋证								
券								
天风	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
万联	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
西部	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
西南	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
兴业	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
银河	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
招商	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
浙商	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
中金	-	-	-	-	-	-	-	-
财富								
中信	-	-	-	-	-	-	-	-
建投								
中信	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								
中邮	-	-	-	-	-	-	-	-
证券								

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-01-08
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-01-22
4	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
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-03-23
6	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
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报	2026-03-31
8	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
9	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
10	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
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	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
13	易方达基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2026-05-29
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

§ 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.中国证监会核准易方达沪深 300 指数证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会《关于易方达沪深 300 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金基金合同》；
- 4.《易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金联接基金托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

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