

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

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	5
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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	65
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	65
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	65
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	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65

7.12 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
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	68
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 量化增强证券投资基金	
基金简称	易方达沪深 300 量化增强	
基金主代码	110030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 7 月 5 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	285,518,268.87 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 300 量化增强 A	易方达沪深 300 量化增强 Y
下属分级基金的交易代码	110030	027262
报告期末下属分级基金的份额总额	285,408,558.94 份	109,709.93 份

注：自 2026 年 4 月 27 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2026 年 4 月 28 日。

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，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用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。
投资策略	本基金主要策略为复制标的指数，投资组合将以标的指数的构成为基础，主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果，结合基金管理人的长期研究与实践应用，利用多因子量化模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。本基金可投资存托凭证。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金中的指数增强型基金，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。

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	北京市西城区金融大街25号

	188号6层	
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	北京市西城区闹市口大街1号院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 300 量化增强 A	易方达沪深 300 量化增强 Y
本期已实现收益	80,711,553.86	4,274.78
本期利润	95,121,574.29	8,190.79
加权平均基金份额本期利润	0.3098	0.1474
本期加权平均净值利润率	9.56%	4.38%
本期基金份额净值增长率	9.91%	4.01%
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 300 量化增强 A	易方达沪深 300 量化增强 Y
期末可供分配利润	567,122,369.20	218,327.95
期末可供分配基金份额利润	1.9871	1.9900
期末基金资产净值	974,642,377.41	374,979.09
期末基金份额净值	3.4149	3.4179

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达沪深 300 量化增强 A	易方达沪深 300 量化增强 Y
基金份额累计净值增长率	241.49%	4.01%

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.自 2026 年 4 月 27 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2026 年 4 月 28 日，增设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

易方达沪深 300 量化增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.76%	1.16%	11.30%	1.19%	0.46%	-0.03%
过去六个月	9.91%	1.06%	7.20%	1.07%	2.71%	-0.01%
过去一年	31.16%	0.95%	25.13%	0.97%	6.03%	-0.02%
过去三年	37.80%	1.08%	28.26%	1.06%	9.54%	0.02%
过去五年	-1.34%	1.12%	-4.02%	1.06%	2.68%	0.06%
过去七年	45.04%	1.15%	29.33%	1.11%	15.71%	0.04%
过去十年	105.10%	1.12%	55.78%	1.09%	49.32%	0.03%
自基金合同生效起至今	241.49%	1.29%	98.19%	1.26%	143.30%	0.03%

易方达沪深 300 量化增强 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	-	-	-	-	-	-
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	4.01%	1.18%	4.17%	1.25%	-0.16%	-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

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金
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

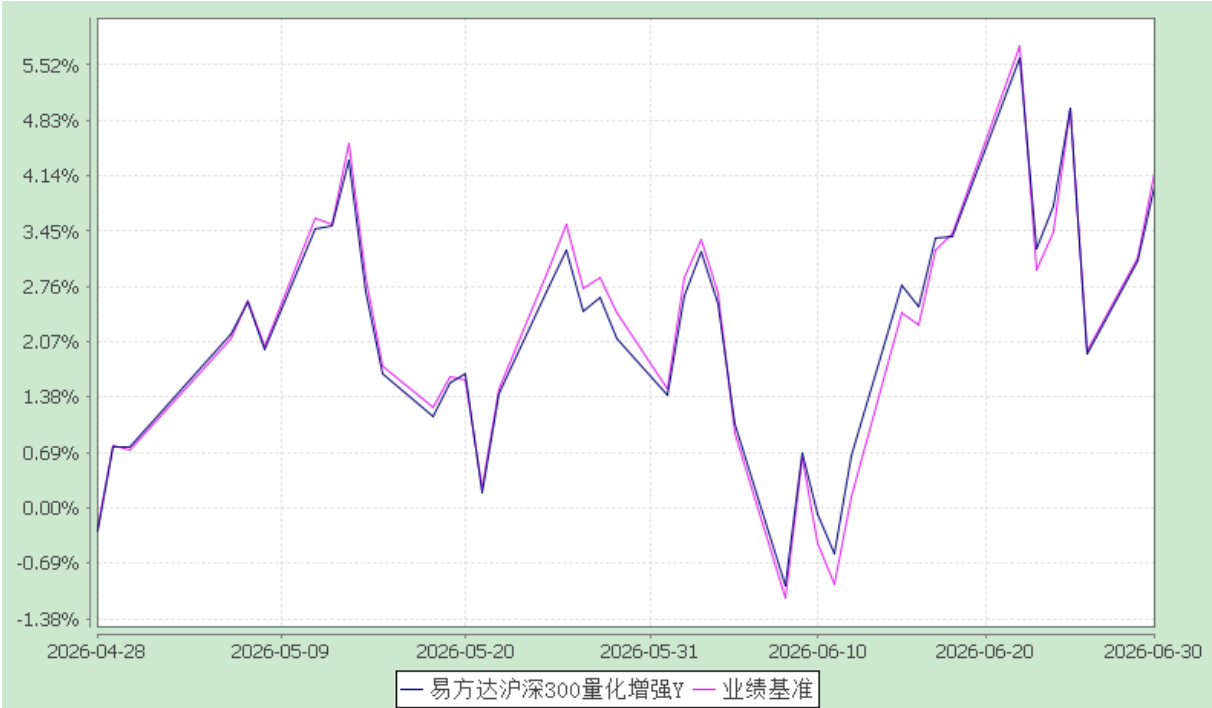
易方达沪深 300 量化增强 A

(2012 年 7 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日)



易方达沪深 300 量化增强 Y

(2026 年 4 月 28 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：1.自 2013 年 6 月 7 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×80%+活期存款利率（税后）×20%”调整为“沪深 300 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

2.自 2026 年 4 月 27 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2026 年 4 月 28 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		

王建军	本基金的基金经理，易方达量化策略精选混合（自 2022 年 09 月 14 日至 2026 年 03 月 04 日）、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通量化增强、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达高股息量化选股股票发起式的基金经理，量化投资部负责人、量化投资决策委员会委员、投资经理	2021-09-04	-	19 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、量化投资部副总经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF 联接、易方达创业板 ETF、易方达中小板指数分级、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达重组分级的基金经理。
明朗	本基金的基金经理，易方达高股息量化选股股票发起式的基金经理	2023-11-09	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任交通银行股份有限公司高级投资经理，易方达基金管理有限公司投资经理、投资经理助理、量化研究员。

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.根据 2026 年 7 月 4 日《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金经理变更公告》，自 2026 年 7 月 4 日起，王建军不再担任本基金的基金经理，明朗仍担任本基金的基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王建军	公募基金	4	1,261,061,571.07	2021-09-04
	私募资产管理计划	5	11,827,619,496.40	2019-07-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	9	13,088,681,067.47	-

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，王建军曾管理 1 只公募基金已于 2026 年 3 月 5 日离任。根据相关公告，王建军不再担任易方达量化策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

回顾本报告期内，国内经济在复杂的内外部环境呈现出“前高后低、稳中承压”的运行态势。2026 年第一、二季度的 GDP 增长有所放缓，同比分别为 5.0% 和 4.3%。制造业 PMI 在年初一度低于荣枯平衡线（1 月 49.3%、2 月 49.0%），三月起边际回升并重返扩张区间，此后维持在 50% 附近波动，六月为 50.3%，显示制造业景气总体企稳但动能偏弱。从 M2 指标来看，上半年货币增速处于相对高位，年初一度达 9.0%，此后小幅回落至六月的 8.0%，流动性总体保持合理充裕。消费方面，社会消费品零售总额增长偏弱，当月同比在负增长与低个位数之间波动，六月同比约 1.0%，内需修复力度仍显不足。投资方面，固定资产投资承压明显，上半年累计同比录得负增长，地产投资拖累依旧较大，成为经济运行中的主要短板。整体来看，上半年经济增长动能边际放缓，稳增长政策仍需持续发力。

从股票市场表现来看，上半年市场结构分化极为显著，成长风格大幅跑赢价值风格：沪深 300 指数收益率为 7.55%，中证 500 指数收益率为 20.97%，创业板指数收益率高达 35.58%。尽管宏观基本面偏弱，但在流动性充裕、产业趋势催化和风险偏好回升的推动下，A 股市场尤其是科技成长板块交投活跃、整体偏强。从行业表现来看，电子（+86.29%）、通信（+73.59%）和建筑材料（+46.26%）等行业表现较好，商贸零售（-29.42%）、农林牧渔（-25.26%）和美容护理（-24.86%）等行业表现较差，行业间分化程度处于历史高位，AI 算力、半导体等科技主线成为市场核心矛盾。

报告期内，本基金依托量化选股模型，平衡中长期基本面与短期情绪指标，优选长期质地好、中短期具有性价比的公司进行均衡配置。在市场结构分化加剧的行情中，本基金积极进行调仓换股，坚持配置基本面相对优质的标的，并通过量化指标回避因标的拥挤度过高带来的风险。本基金在下阶段的投资运作中仍将坚持基本面量化投资的投资理念，以长期稳健收益为目标持续优化策略模型，力争为投资者创造稳健且持续的投资回报。

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 3.4149 元，本报告期份额净值增长率为 9.91%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%；Y 类基金份额净值为 3.4179 元，本报告期份额净值增长率为 4.01%，同期业绩比较基准收益率为 4.17%。年化跟踪误差 2.01%，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

展望下一阶段，尽管内需修复偏弱、地产投资仍有拖累，外部环境的不确定性尚未消除，但国内的政策应对工具依然丰富，财政与货币政策有望协同发力，对经济起到对冲和支撑的作用。另一方面，资本市场的流动性在政策呵护的环境下保持充裕，叠加居民资产配置向权益市场迁移的中长期趋势，股市风险偏好有望维持，我们对 A 股后续表现保持谨慎乐观。

管理人在下阶段的投资运作中，将坚持使用基本面量化模型优选质地优良、性价比有优势的标的进行配置，在均衡配置的基础上重点把握市场的结构性机会，力争控制回撤并获取相对稳健的超额收益。

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

易方达沪深 300 量化增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达沪深 300 量化增强 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 量化增强证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	51,704,233.06	91,828,384.59
结算备付金		3,699,571.36	3,437,570.44

存出保证金		105,087.31	202,960.83
交易性金融资产	6.4.7.2	919,523,091.04	937,662,733.38
其中：股票投资		918,108,401.78	937,661,733.36
基金投资		-	-
债券投资		1,414,689.26	1,000.02
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		1,130,829.64	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,570,853.53	2,656,082.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		978,733,665.94	1,035,787,732.06
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	5,294,789.71
应付赎回款		2,627,529.54	2,110,878.27
应付管理人报酬		639,612.57	661,834.35
应付托管费		119,927.35	124,093.95
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		51.74	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	329,188.24	336,988.59
负债合计		3,716,309.44	8,528,584.87
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	285,518,268.87	330,629,766.85
未分配利润	6.4.7.8	689,499,087.63	696,629,380.34
净资产合计		975,017,356.50	1,027,259,147.19
负债和净资产总计		978,733,665.94	1,035,787,732.06

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 3.4149 元，Y 类基金份额净值 3.4179 元；基金份额总额 285,518,268.87 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 285,408,558.94 份，Y 类基金份额总额 109,709.93 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		99,922,596.74	44,782,283.72
1.利息收入		106,313.34	156,884.77
其中：存款利息收入	6.4.7.9	106,313.34	156,884.77
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）		85,109,487.39	15,070,490.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	75,839,011.53	-416,808.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	61,055.59	14,933.99
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	-	66,353.83
股利收益	6.4.7.14	9,209,420.27	15,406,011.34
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	14,413,936.44	29,393,298.11
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	292,859.57	161,610.15
减：二、营业总支出		4,792,831.66	6,705,763.99
1. 管理人报酬		3,947,148.19	5,523,925.76
2. 托管费		740,090.26	1,035,736.06
3. 销售服务费		-	-
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		12.39	239.54
8. 其他费用	6.4.7.18	105,580.82	145,862.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		95,129,765.08	38,076,519.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		95,129,765.08	38,076,519.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		95,129,765.08	38,076,519.73
----------	--	---------------	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	330,629,766.85	696,629,380.34	1,027,259,147.19
二、本期期初净资产	330,629,766.85	696,629,380.34	1,027,259,147.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-45,111,497.98	-7,130,292.71	-52,241,790.69
（一）、综合收益总额	-	95,129,765.08	95,129,765.08
（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）	-45,111,497.98	-102,260,057.79	-147,371,555.77
其中：1.基金申购款	72,528,452.34	162,793,224.19	235,321,676.53
2.基金赎回款	-117,639,950.32	-265,053,281.98	-382,693,232.30
（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	285,518,268.87	689,499,087.63	975,017,356.50
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	567,359,008.38	871,534,063.94	1,438,893,072.32
二、本期期初净资产	567,359,008.38	871,534,063.94	1,438,893,072.32
三、本期增减变动额（减少以“-”	-31,417,180.51	-12,078,792.87	-43,495,973.38

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	38,076,519.73	38,076,519.73
(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)	-31,417,180.51	-50,155,312.60	-81,572,493.11
其中: 1.基金申购款	43,131,098.90	65,103,023.37	108,234,122.27
2.基金赎回款	-74,548,279.41	-115,258,335.97	-189,806,615.38
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	535,941,827.87	859,455,271.07	1,395,397,098.94

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

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金（原名易方达量化衍伸股票型证券投资基金，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[2012]627 号《关于核准易方达量化衍伸股票型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《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 248,871,987.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 6,407.02 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 6 月 7 日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监许可[2013]742 号），易方达量化衍伸股票型证券投资基金自 2013 年 6 月 7 日起变更为易方达沪深 300 量化增强证券投资基金，修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等

条款。

自 2026 年 4 月 27 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2026 年 4 月 28 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。

6.4.4.1 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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，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，基金份额持有人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 A 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红，本基金 Y 类基金份额默认的收益分配方式是红利再投资；

(3)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类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)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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	51,704,233.06
等于：本金	51,699,864.56
加：应计利息	4,368.50
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	51,704,233.06

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		842,251,933.09	-	918,108,401.78	75,856,468.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所	1,402,156.00	13,709.26	1,414,689.26	-1,176.00

	市场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,402,156.00	13,709.26	1,414,689.26	-1,176.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		843,654,089.09	13,709.26	919,523,091.04	75,855,292.69

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,280.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	221,200.50
其中：交易所市场	221,200.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	101,707.52
合计	329,188.24

6.4.7.7 实收基金

易方达沪深 300 量化增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	330,629,766.85	330,629,766.85
本期申购	72,404,468.25	72,404,468.25
本期赎回（以“-”号填列）	-117,625,676.16	-117,625,676.16
本期末	285,408,558.94	285,408,558.94

易方达沪深 300 量化增强 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
本期申购	123,984.09	123,984.09
本期赎回（以“-”号填列）	-14,274.16	-14,274.16
本期末	109,709.93	109,709.93

注：1.自 2026 年 4 月 27 日起，本基金增设 Y 类份额类别，份额首次确认日为 2026 年 4 月 28 日。

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

易方达沪深 300 量化增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	570,906,274.21	125,723,106.13	696,629,380.34
本期期初	570,906,274.21	125,723,106.13	696,629,380.34
本期利润	80,711,553.86	14,410,020.43	95,121,574.29
本期基金份额交易产生的变动数	-84,495,458.87	-18,021,677.29	-102,517,136.16
其中：基金申购款	134,832,590.59	27,669,327.28	162,501,917.87
基金赎回款	-219,328,049.46	-45,691,004.57	-265,019,054.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	567,122,369.20	122,111,449.27	689,233,818.47

易方达沪深 300 量化增强 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,274.78	3,916.01	8,190.79
本期基金份额交易产生的变动数	214,053.17	43,025.20	257,078.37
其中：基金申购款	242,190.51	49,115.81	291,306.32
基金赎回款	-28,137.34	-6,090.61	-34,227.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	218,327.95	46,941.21	265,269.16

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	95,420.38
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	9,505.17
其他	1,387.79
合计	106,313.34

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	75,839,011.53
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	75,839,011.53

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	2,474,746,952.24
减：卖出股票成本总额	2,396,876,993.68
减：交易费用	2,030,947.03
买卖股票差价收入	75,839,011.53

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,453.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	57,602.38
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	61,055.59

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	152,118.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	94,500.00
减：应计利息总额	10.25
减：交易费用	6.07
买卖债券差价收入	57,602.38

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,209,420.27
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	9,209,420.27

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	14,413,936.44
——股票投资	14,415,112.44
——债券投资	-1,176.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
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	14,413,936.44

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	292,859.57
合计	292,859.57

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	42,200.15
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,873.30
合计	105,580.82

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,947,148.19	5,523,925.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,246,149.81	1,658,786.82
应支付基金管理人的净管理费	2,700,998.38	3,865,138.94

注：（1）本基金 A 类基金份额的年管理费率为 0.80%，管理费的计算方法如下：

$$H = EA \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

EA 为前一日的 A 类份额基金资产净值

(2) 本基金 Y 类基金份额的年管理费率为 0.40%，管理费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

EY 为前一日的 Y 类份额基金资产净值

A 类基金份额及 Y 类基金份额的基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与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，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，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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	740,090.26	1,035,736.06

注：（1）本基金 A 类基金份额年托管费率为 0.15%，托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

EA 为前一日 A 类份额的基金资产净值

(2) 本基金 Y 类基金份额的年托管费率为 0.075%，托管费的计算方法如下：

$$H = EY \times 0.075\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

EY 为前一日 Y 类份额的基金资产净值

A 类基金份额及 Y 类基金份额的基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与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，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，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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

份额单位：份

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	
	易方达沪深300量化增强A	易方达沪深300量化增强Y	易方达沪深300量化增强A	易方达沪深300量化增强Y
报告期初持有的基金份额	16,318,489.99	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	16,318,489.99	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.7176%	-	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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 300 量化增强 A

无。

易方达沪深 300 量化增强 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	51,704,233.06	95,420.38	87,583,514.03	146,578.77

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
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达沪深 300 量化增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达沪深 300 量化增强 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	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-

				受限						
00125 7	盛龙 股份	2026-0 3-24	6 个月	新股 流通 受限	7.82	20.74	1,743	13,630 .26	36,149 .82	-
00131 2	福恩 股份	2026-0 4-14	6 个月	新股 流通 受限	18.38	16.78	134	2,462. 92	2,248. 52	-
00136 5	天海 电子	2026-0 5-11	6 个月	新股 流通 受限	27.19	31.31	719	19,549 .61	22,511 .89	-
00139 3	维通 利	2026-0 5-08	6 个月	新股 流通 受限	30.38	38.99	387	11,757 .06	15,089 .13	-
00139 9	惠科 股份	2026-0 6-16	6 个月	新股 流通 受限	10.12	27.73	5,488	55,538 .56	152,18 2.24	-
30151 3	尚水 智能	2026-0 4-10	6 个月	新股 流通 受限	26.66	50.96	138	3,679. 08	7,032. 48	-
30153 1	春光 集团	2026-0 4-28	6 个月	新股 流通 受限	13.30	51.56	290	3,857. 00	14,952 .40	-
30159 9	理奇 智能	2026-0 4-22	6 个月	新股 流通 受限	13.91	32.47	433	6,023. 03	14,059 .51	-
30166 6	大普 微	2026-0 4-08	6 个月	新股 流通 受限	46.08	463.33	1,220	56,217 .60	565,26 2.60	-
30166 9	高特 电子	2026-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	7.08	28.40	546	3,865. 68	15,506 .40	-
30168 0	固德 电材	2026-0 2-27	6 个月	新股 流通 受限	58.00	112.16	117	6,786. 00	13,122 .72	-
30168 2	宏明 电子	2026-0 3-18	6 个月	新股 流通 受限	69.66	160.06	714	49,737 .24	114,28 2.84	-
30168 3	慧谷 新材	2026-0 3-24	6 个月	新股 流通 受限	78.38	121.77	96	7,524. 48	11,689 .92	-
30168 7	新广 益	2025-1 2-24	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	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	3,937	449,920.36	2,665,112.78	-

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	2,795	292,524.70	2,149,047.55	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,537	30,248.16	217,470.13	-

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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603137	恒尚节能	2026-06-16	重大事项停牌	12.94	2026-07-01	14.23	21,800	302,771.56	282,092.00	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	2,106	1,413,964.95	1,852,290.18	-

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。

本基金属股票型基金中的指数增强型基金，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。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 0.00%(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	1,414,689.26	0.00

合计	1,414,689.26	0.00
----	--------------	------

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	1,000.02
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	1,000.02

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	51,704,233.06	-	-	-	51,704,233.06
结算备付金	3,699,571.36	-	-	-	3,699,571.36
存出保证金	105,087.31	-	-	-	105,087.31
交易性金融资产	1,414,689.26	-	-	918,108,401.78	919,523,091.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,130,829.64	1,130,829.64
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,570,853.53	2,570,853.53
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	56,923,580.99	-	-	921,810,084.95	978,733,665.94
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	-	-	-	2,627,529.54	2,627,529.54
应付管理人报酬	-	-	-	639,612.57	639,612.57
应付托管费	-	-	-	119,927.35	119,927.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	51.74	51.74
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	329,188.24	329,188.24
负债总计	-	-	-	3,716,309.44	3,716,309.44
利率敏感度缺口	56,923,580.99	-	-	918,093,775.51	975,017,356.50
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	91,828,384.59	-	-	-	91,828,384.59
结算备付金	3,437,570.44	-	-	-	3,437,570.44
存出保证金	202,960.83	-	-	-	202,960.83
交易性金融资产	-	-	1,000.02	937,661,733.36	937,662,733.38
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	-	-	-	2,656,082.82	2,656,082.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	95,468,915.86	-	1,000.02	940,317,816.18	1,035,787,732.06
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-

衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	5,294,789.71	5,294,789.71
应付赎回款	-	-	-	2,110,878.27	2,110,878.27
应付管理人报酬	-	-	-	661,834.35	661,834.35
应付托管费	-	-	-	124,093.95	124,093.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	336,988.59	336,988.59
负债总计	-	-	-	8,528,584.87	8,528,584.87
利率敏感度缺口	95,468,915.86	-	1,000.02	931,789,231.31	1,027,259,147.19

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	1,016.17	-
	2.市场利率上升 25 个基点	-1,014.55	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VaR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	918,108,401.78	94.16	937,661,733.36	91.28
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	918,108,401.78	94.16	937,661,733.36	91.28

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%	46,496,495.56	47,756,375.00
	2.业绩比较基准下降 5%	-46,496,495.56	-47,756,375.00

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	905,666,827.39

第二层次	3,549,071.44
第三层次	10,307,192.21
合计	919,523,091.04

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	918,108,401.78	93.81
	其中：股票	918,108,401.78	93.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,414,689.26	0.14
	其中：债券	1,414,689.26	0.14
	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	55,403,804.42	5.66

8	其他各项资产	3,806,770.48	0.39
9	合计	978,733,665.94	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	617,253.00	0.06
B	采矿业	32,396,299.83	3.32
C	制造业	467,520,635.49	47.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,376,167.36	1.58
E	建筑业	7,395,850.12	0.76
F	批发和零售业	944,020.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	14,738,043.04	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,297,761.81	3.52
J	金融业	162,206,141.65	16.64
K	房地产业	4,518,030.00	0.46
L	租赁和商务服务业	1,844,566.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	13,970,022.00	1.43
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	1,661,086.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	757,485,876.30	77.69

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	268,151.00	0.03

B	采矿业	8,413,723.82	0.86
C	制造业	114,644,506.78	11.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,577,415.00	0.26
E	建筑业	1,088,058.00	0.11
F	批发和零售业	2,706,110.50	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	2,773,727.10	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,518,335.94	1.28
J	金融业	8,470,898.14	0.87
K	房地产业	262,987.00	0.03
L	租赁和商务服务业	1,117,152.20	0.11
M	科学研究和技术服务业	4,864,274.00	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	286,957.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	43,328.00	0.00
Q	卫生和社会工作	84,224.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	457,865.00	0.05
S	综合	44,812.00	0.00
	合计	160,622,525.48	16.47

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	39,180	49,758,600.00	5.10
2	300750	宁德时代	86,187	33,872,352.87	3.47
3	300502	新易盛	46,084	27,972,988.00	2.87
4	600519	贵州茅台	18,477	21,904,298.73	2.25
5	601318	中国平安	382,088	18,240,881.12	1.87
6	603986	兆易创新	21,400	17,441,000.00	1.79
7	688256	寒武纪	10,141	16,180,472.55	1.66
8	603259	药明康德	112,200	13,970,022.00	1.43
9	600036	招商银行	350,747	12,451,518.50	1.28

10	601899	紫金矿业	482,274	12,124,368.36	1.24
11	688041	海光信息	32,310	11,964,393.00	1.23
12	002475	立讯精密	162,035	11,407,264.00	1.17
13	600030	中信证券	396,075	11,379,234.75	1.17
14	000333	美的集团	144,224	10,893,238.72	1.12
15	002384	东山精密	41,100	10,782,585.00	1.11
16	002371	北方华创	11,268	9,967,222.08	1.02
17	600900	长江电力	357,300	9,457,731.00	0.97
18	688012	中微公司	20,159	9,444,491.50	0.97
19	688008	澜起科技	30,424	9,428,397.60	0.97
20	601138	工业富联	128,100	9,242,415.00	0.95
21	600276	恒瑞医药	173,959	9,052,826.36	0.93
22	002594	比亚迪	107,000	8,527,900.00	0.87
23	600919	江苏银行	790,982	8,526,785.96	0.87
24	601166	兴业银行	475,300	7,870,968.00	0.81
25	300059	东方财富	379,233	7,728,768.54	0.79
26	000725	京东方 A	852,800	7,402,304.00	0.76
27	688981	中芯国际	45,962	7,299,684.84	0.75
28	000938	紫光股份	247,700	7,148,622.00	0.73
29	601211	国泰海通	375,728	6,838,249.60	0.70
30	300274	阳光电源	41,300	6,567,526.00	0.67
31	601398	工商银行	854,800	6,043,436.00	0.62
32	000001	平安银行	598,100	6,010,905.00	0.62
33	601360	三六零	677,100	5,883,999.00	0.60
34	002142	宁波银行	194,422	5,772,389.18	0.59
35	600887	伊利股份	236,500	5,666,540.00	0.58
36	601009	南京银行	563,300	5,571,037.00	0.57
37	002463	沪电股份	35,700	5,454,960.00	0.56
38	000651	格力电器	136,087	5,103,262.50	0.52
39	600183	生益科技	28,243	4,897,336.20	0.50
40	600926	杭州银行	338,200	4,886,990.00	0.50
41	000100	TCL 科技	826,400	4,809,648.00	0.49
42	000807	云铝股份	203,000	4,494,420.00	0.46
43	300476	胜宏科技	12,800	4,434,304.00	0.45
44	300408	三环集团	26,382	4,403,155.80	0.45
45	601998	中信银行	613,400	4,250,862.00	0.44
46	600489	中金黄金	232,200	4,191,210.00	0.43
47	600016	民生银行	1,282,700	4,130,294.00	0.42
48	600309	万华化学	59,600	4,077,236.00	0.42
49	600150	中国船舶	116,810	3,947,009.90	0.40
50	002001	新和成	138,500	3,936,170.00	0.40
51	002648	卫星化学	165,000	3,875,850.00	0.40
52	688521	芯原股份	10,139	3,762,988.46	0.39
53	601628	中国人寿	104,600	3,697,610.00	0.38

54	601336	新华保险	61,900	3,692,954.00	0.38
55	002493	荣盛石化	343,475	3,692,356.25	0.38
56	600938	中国海油	135,800	3,686,970.00	0.38
57	601600	中国铝业	447,900	3,681,738.00	0.38
58	000338	潍柴动力	132,300	3,605,175.00	0.37
59	600233	圆通速递	227,700	3,586,275.00	0.37
60	600015	华夏银行	555,900	3,552,201.00	0.36
61	300628	亿联网络	101,600	3,436,112.00	0.35
62	600089	特变电工	152,500	3,431,250.00	0.35
63	601688	华泰证券	166,100	3,424,982.00	0.35
64	000858	五粮液	46,100	3,411,400.00	0.35
65	002415	海康威视	98,100	3,355,020.00	0.34
66	301308	江波龙	4,700	3,307,860.00	0.34
67	601898	中煤能源	256,403	3,122,988.54	0.32
68	601995	中金公司	86,000	3,108,900.00	0.32
69	300433	蓝思科技	56,300	3,021,058.00	0.31
70	002532	天山铝业	278,900	2,992,597.00	0.31
71	002709	天赐材料	56,540	2,907,852.20	0.30
72	002028	思源电气	16,600	2,871,800.00	0.29
73	601788	光大证券	195,800	2,825,394.00	0.29
74	002602	世纪华通	193,300	2,725,530.00	0.28
75	002916	深南电路	5,900	2,701,610.00	0.28
76	601328	交通银行	419,600	2,698,028.00	0.28
77	600115	中国东航	700,500	2,668,905.00	0.27
78	300661	圣邦股份	18,380	2,637,162.40	0.27
79	600050	中国联通	658,600	2,634,400.00	0.27
80	000988	华工科技	14,200	2,621,462.00	0.27
81	603993	洛阳钼业	147,400	2,586,870.00	0.27
82	001979	招商蛇口	398,800	2,564,284.00	0.26
83	601878	浙商证券	265,400	2,521,300.00	0.26
84	300803	指南针	27,500	2,520,925.00	0.26
85	300394	天孚通信	8,240	2,494,083.20	0.26
86	300124	汇川技术	33,400	2,215,422.00	0.23
87	600918	中泰证券	410,400	2,183,328.00	0.22
88	601456	国联民生	243,100	2,149,004.00	0.22
89	002460	赣锋锂业	32,796	2,144,858.40	0.22
90	600584	长电科技	20,600	2,133,130.00	0.22
91	601816	京沪高铁	456,600	2,068,398.00	0.21
92	601601	中国太保	71,000	2,024,920.00	0.21
93	000708	中信特钢	158,900	2,005,318.00	0.21
94	300014	亿纬锂能	30,810	2,003,574.30	0.21
95	601225	陕西煤业	98,348	2,001,381.80	0.21
96	000975	山金国际	116,700	1,983,900.00	0.20
97	601136	首创证券	139,800	1,950,210.00	0.20

98	600426	华鲁恒升	79,800	1,908,816.00	0.20
99	600690	海尔智家	91,100	1,859,351.00	0.19
100	688072	拓荆科技	2,106	1,852,290.18	0.19
101	600522	中天科技	30,300	1,838,604.00	0.19
102	300760	迈瑞医疗	13,300	1,806,539.00	0.19
103	002050	三花智控	40,000	1,753,200.00	0.18
104	600406	国电南瑞	76,100	1,738,885.00	0.18
105	601668	中国建筑	390,700	1,695,638.00	0.17
106	688271	联影医疗	16,432	1,663,411.36	0.17
107	300015	爱尔眼科	201,100	1,661,086.00	0.17
108	601800	中国交建	289,800	1,654,758.00	0.17
109	601872	招商轮船	93,272	1,638,789.04	0.17
110	601288	农业银行	267,300	1,622,511.00	0.17
111	600585	海螺水泥	93,700	1,588,215.00	0.16
112	601229	上海银行	177,900	1,544,172.00	0.16
113	601117	中国化学	208,400	1,531,740.00	0.16
114	000425	徐工机械	188,600	1,525,774.00	0.16
115	601111	中国国航	251,600	1,522,180.00	0.16
116	600999	招商证券	70,500	1,487,550.00	0.15
117	605117	德业股份	14,000	1,486,520.00	0.15
118	002938	鹏鼎控股	14,100	1,485,858.00	0.15
119	603288	海天味业	44,528	1,476,548.48	0.15
120	600031	三一重工	84,300	1,456,704.00	0.15
121	601012	隆基绿能	110,400	1,448,448.00	0.15
122	601077	渝农商行	236,600	1,445,626.00	0.15
123	002422	科伦药业	37,200	1,432,944.00	0.15
124	601186	中国铁建	240,800	1,432,760.00	0.15
125	600989	宝丰能源	68,400	1,390,572.00	0.14
126	002353	杰瑞股份	9,000	1,372,500.00	0.14
127	601169	北京银行	277,100	1,357,790.00	0.14
128	601985	中国核电	149,212	1,347,384.36	0.14
129	601888	中国中免	24,200	1,299,782.00	0.13
130	601988	中国银行	222,500	1,272,700.00	0.13
131	601916	浙商银行	461,600	1,214,008.00	0.12
132	601658	邮储银行	240,000	1,183,200.00	0.12
133	688396	华润微	11,947	1,165,429.85	0.12
134	000408	藏格矿业	16,800	1,164,576.00	0.12
135	600482	中国动力	35,000	1,148,000.00	0.12
136	603799	华友钴业	23,600	1,138,936.00	0.12
137	600196	复星医药	46,100	1,035,867.00	0.11
138	600515	海南机场	375,600	1,029,144.00	0.11
139	601100	恒立液压	9,300	1,000,308.00	0.10
140	000538	云南白药	20,800	985,296.00	0.10
141	601825	沪农商行	127,300	953,477.00	0.10

142	600028	中国石化	211,900	945,074.00	0.10
143	601607	上海医药	61,300	944,020.00	0.10
144	600660	福耀玻璃	18,100	912,964.00	0.09
145	600809	山西汾酒	8,300	907,771.00	0.09
146	600346	恒力石化	51,100	904,981.00	0.09
147	603501	豪威集团	9,400	891,590.00	0.09
148	000568	泸州老窖	11,500	891,480.00	0.09
149	000792	盐湖股份	29,200	881,548.00	0.09
150	601088	中国神华	22,500	878,400.00	0.09
151	600221	海航控股	642,000	866,700.00	0.09
152	002202	金风科技	35,800	855,620.00	0.09
153	000002	万科 A	286,400	847,744.00	0.09
154	600111	北方稀土	17,475	839,673.75	0.09
155	003816	中国广核	213,600	835,176.00	0.09
156	002049	紫光国微	9,400	834,250.00	0.09
157	601766	中国中车	154,800	804,960.00	0.08
158	002466	天齐锂业	13,100	803,292.00	0.08
159	600875	东方电气	27,300	785,421.00	0.08
160	601633	长城汽车	51,895	783,095.55	0.08
161	600460	士兰微	14,300	781,638.00	0.08
162	300316	晶盛机电	12,600	761,040.00	0.08
163	600741	华域汽车	47,600	738,752.00	0.08
164	000625	长安汽车	101,900	730,623.00	0.07
165	601059	信达证券	45,100	730,169.00	0.07
166	600000	浦发银行	84,700	729,267.00	0.07
167	600176	中国巨石	10,000	728,800.00	0.07
168	600886	国投电力	54,700	728,057.00	0.07
169	000617	中油资本	109,600	722,264.00	0.07
170	600372	中航机载	66,300	719,355.00	0.07
171	300450	先导智能	17,400	708,528.00	0.07
172	000977	浪潮信息	10,100	707,000.00	0.07
173	002179	中航光电	15,200	702,240.00	0.07
174	601877	正泰电器	27,800	696,946.00	0.07
175	600029	南方航空	133,800	693,084.00	0.07
176	002600	领益智造	39,600	686,664.00	0.07
177	601066	中信建投	23,100	671,517.00	0.07
178	002837	英维克	8,400	668,304.00	0.07
179	688472	阿特斯	61,042	660,474.44	0.07
180	688126	沪硅产业	16,556	660,418.84	0.07
181	600436	片仔癀	6,000	655,680.00	0.07
182	600941	中国移动	7,300	628,749.00	0.06
183	002714	牧原股份	17,500	612,325.00	0.06
184	600104	上汽集团	62,600	610,976.00	0.06
185	002241	歌尔股份	26,500	597,045.00	0.06

186	600905	三峡能源	155,700	577,647.00	0.06
187	002625	光启技术	18,700	566,984.00	0.06
188	601818	光大银行	194,700	562,683.00	0.06
189	600362	江西铜业	12,900	558,570.00	0.06
190	600893	航发动力	14,500	555,930.00	0.06
191	600118	中国卫星	6,700	549,735.00	0.06
192	000895	双汇发展	24,300	544,320.00	0.06
193	601689	拓普集团	9,500	535,990.00	0.05
194	601127	赛力斯	8,600	526,750.00	0.05
195	002304	洋河股份	13,800	526,470.00	0.05
196	600011	华能国际	68,700	521,433.00	0.05
197	600674	川投能源	36,700	520,039.00	0.05
198	688036	传音控股	8,731	514,692.45	0.05
199	600760	中航沈飞	12,500	513,750.00	0.05
200	688082	盛美上海	1,120	483,840.00	0.05
201	600188	兖矿能源	26,900	478,013.00	0.05
202	000157	中联重科	67,800	472,566.00	0.05
203	601390	中国中铁	111,800	466,206.00	0.05
204	601006	大秦铁路	101,100	466,071.00	0.05
205	600438	通威股份	37,800	457,758.00	0.05
206	688183	生益电子	3,445	456,118.00	0.05
207	601727	上海电气	63,700	445,900.00	0.05
208	600795	国电电力	95,400	445,518.00	0.05
209	603893	瑞芯微	2,300	433,228.00	0.04
210	601058	赛轮轮胎	37,500	432,375.00	0.04
211	600066	宇通客车	15,900	426,279.00	0.04
212	601698	中国卫通	13,900	420,475.00	0.04
213	000301	东方盛虹	36,500	417,925.00	0.04
214	002027	分众传媒	83,800	405,592.00	0.04
215	601857	中国石油	45,600	395,808.00	0.04
216	688506	百利天恒	1,346	395,764.38	0.04
217	001965	招商公路	43,000	393,880.00	0.04
218	601919	中远海控	27,100	359,346.00	0.04
219	688047	龙芯中科	2,048	316,764.16	0.03
220	002074	国轩高科	11,400	313,614.00	0.03
221	601669	中国电建	66,600	313,020.00	0.03
222	605499	东鹏饮料	2,453	302,773.79	0.03
223	000768	中航西飞	14,700	301,056.00	0.03
224	300896	爱美客	3,400	296,480.00	0.03
225	601868	中国能建	105,400	281,418.00	0.03
226	601018	宁波港	83,900	264,285.00	0.03
227	601838	成都银行	13,200	233,640.00	0.02
228	300866	安克创新	2,200	229,900.00	0.02
229	600023	浙能电力	42,600	224,076.00	0.02

230	688009	中国通号	47,061	224,010.36	0.02
231	688223	晶科能源	43,935	208,691.25	0.02
232	302132	中航成飞	3,500	204,120.00	0.02
233	601319	中国人保	29,900	202,124.00	0.02
234	600025	华能水电	21,400	190,246.00	0.02
235	600027	华电国际	42,600	189,570.00	0.02
236	600930	华电新能	39,000	186,030.00	0.02
237	000657	中钨高新	1,800	172,296.00	0.02
238	300033	同花顺	700	168,700.00	0.02
239	300122	智飞生物	13,500	157,815.00	0.02
240	600803	新奥股份	9,700	153,260.00	0.02
241	300999	金龙鱼	6,000	139,560.00	0.01
242	603019	中科曙光	1,300	139,399.00	0.01
243	600415	小商品城	13,700	139,192.00	0.01
244	601238	广汽集团	26,600	135,128.00	0.01
245	688303	大全能源	6,859	119,552.37	0.01
246	600549	厦门钨业	1,300	110,760.00	0.01
247	600019	宝钢股份	20,200	109,686.00	0.01
248	002558	巨人网络	3,900	107,484.00	0.01
249	600026	中远海能	5,800	104,052.00	0.01
250	688111	金山办公	476	101,411.80	0.01
251	600600	青岛啤酒	1,900	99,237.00	0.01
252	600085	同仁堂	4,000	92,440.00	0.01
253	000596	古井贡酒	1,000	79,800.00	0.01
254	600048	保利发展	16,600	76,858.00	0.01
255	600010	包钢股份	32,200	71,806.00	0.01
256	002352	顺丰控股	1,700	53,142.00	0.01
257	600958	东方证券	5,200	49,088.00	0.01
258	000063	中兴通讯	1,300	47,047.00	0.00
259	002311	海大集团	1,000	44,610.00	0.00
260	601728	中国电信	6,800	35,292.00	0.00
261	600018	上港集团	7,300	34,456.00	0.00
262	600845	宝信软件	1,600	26,608.00	0.00
263	002230	科大讯飞	650	26,546.00	0.00
264	300442	润泽科技	300	24,921.00	0.00
265	600039	四川路桥	2,566	20,066.12	0.00
266	002236	大华股份	1,200	19,788.00	0.00
267	600009	上海机场	800	18,480.00	0.00
268	002920	德赛西威	100	8,150.00	0.00
269	600160	巨化股份	100	5,301.00	0.00
270	300498	温氏股份	400	4,928.00	0.00
271	000999	华润三九	207	4,655.43	0.00
272	300832	新产业	100	4,200.00	0.00
273	603369	今世缘	100	2,371.00	0.00

274	600547	山东黄金	57	1,316.13	0.00
275	601881	中国银河	100	1,257.00	0.00
276	002736	国信证券	100	999.00	0.00
277	601901	方正证券	100	720.00	0.00
278	601377	兴业证券	100	604.00	0.00
279	601618	中国中冶	100	244.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	300002	神州泰岳	621,400	4,853,134.00	0.50
2	002152	广电运通	503,600	4,723,768.00	0.48
3	300223	北京君正	12,296	3,060,474.40	0.31
4	688783	西安奕材	49,248	2,849,771.16	0.29
5	000983	山西焦煤	489,100	2,836,780.00	0.29
6	688795	摩尔线程	3,937	2,665,112.78	0.27
7	301377	鼎泰高科	4,800	2,644,320.00	0.27
8	002064	华峰化学	273,200	2,592,668.00	0.27
9	688510	航亚科技	103,932	2,481,896.16	0.25
10	002488	金固股份	273,000	2,432,430.00	0.25
11	688630	芯碁微装	4,411	2,423,359.29	0.25
12	600483	福能股份	228,600	2,329,434.00	0.24
13	300483	首华燃气	132,200	2,324,076.00	0.24
14	603678	火炬电子	27,900	2,315,700.00	0.24
15	600418	江淮汽车	89,600	2,314,368.00	0.24
16	601000	唐山港	546,900	2,269,635.00	0.23
17	688802	沐曦股份	2,795	2,149,047.55	0.22
18	002065	东华软件	277,800	1,983,492.00	0.20
19	601699	潞安环能	126,200	1,802,136.00	0.18
20	601997	贵阳银行	349,600	1,793,448.00	0.18
21	600273	嘉化能源	271,600	1,770,832.00	0.18
22	600686	金龙汽车	154,100	1,739,789.00	0.18
23	002839	张家港行	438,500	1,710,150.00	0.18
24	688361	中科飞测	3,876	1,666,680.00	0.17
25	600100	同方股份	217,800	1,491,930.00	0.15
26	300759	康龙化成	51,400	1,487,002.00	0.15
27	002250	联化科技	108,300	1,480,461.00	0.15
28	688318	财富趋势	20,740	1,478,969.40	0.15
29	300671	富满微	16,800	1,447,488.00	0.15
30	600623	华谊集团	174,800	1,410,636.00	0.14
31	603766	隆鑫通用	117,400	1,400,582.00	0.14
32	002975	博杰股份	9,770	1,387,340.00	0.14

33	603308	应流股份	22,600	1,365,040.00	0.14
34	688807	优迅股份	3,376	1,358,603.68	0.14
35	300782	卓胜微	11,651	1,276,716.58	0.13
36	688662	富信科技	7,432	1,248,576.00	0.13
37	300489	光智科技	4,000	1,247,800.00	0.13
38	002636	金安国纪	10,100	1,211,697.00	0.12
39	002993	奥海科技	16,700	1,195,887.00	0.12
40	688498	源杰科技	613	1,156,118.00	0.12
41	000050	深天马 A	113,900	1,128,749.00	0.12
42	002484	江海股份	10,500	1,102,500.00	0.11
43	300548	长芯博创	3,900	1,084,200.00	0.11
44	000683	博源化工	171,700	988,992.00	0.10
45	002851	麦格米特	5,700	952,926.00	0.10
46	000712	锦龙股份	106,600	944,476.00	0.10
47	300776	帝尔激光	4,300	924,328.00	0.09
48	601665	齐鲁银行	159,700	921,469.00	0.09
49	300814	中富电路	4,500	920,250.00	0.09
50	600352	浙江龙盛	63,900	773,829.00	0.08
51	603886	元祖股份	58,300	745,074.00	0.08
52	600298	安琪酵母	20,300	734,860.00	0.08
53	688536	思瑞浦	2,012	732,549.08	0.08
54	300083	创世纪	53,700	731,394.00	0.08
55	688110	东芯股份	3,576	728,431.20	0.07
56	603027	千禾味业	103,900	724,183.00	0.07
57	000661	长春高新	10,800	719,280.00	0.07
58	300322	硕贝德	27,800	700,560.00	0.07
59	002821	凯莱英	4,300	696,600.00	0.07
60	601126	四方股份	11,000	695,200.00	0.07
61	600153	建发股份	87,300	692,289.00	0.07
62	301580	爱迪特	10,680	687,044.40	0.07
63	688775	影石创新	4,944	685,485.60	0.07
64	688046	药康生物	27,960	676,632.00	0.07
65	000933	神火股份	31,800	674,160.00	0.07
66	603010	万盛股份	36,400	659,568.00	0.07
67	688090	瑞松科技	5,945	632,845.25	0.06
68	300573	兴齐眼药	15,220	620,367.20	0.06
69	300558	贝达药业	9,400	611,658.00	0.06
70	001337	四川黄金	16,600	608,556.00	0.06
71	300382	斯莱克	26,300	607,793.00	0.06
72	688390	固德威	5,490	595,719.90	0.06
73	002568	百润股份	34,300	580,356.00	0.06
74	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.06
75	002271	东方雨虹	47,000	557,890.00	0.06
76	688676	金盘科技	6,559	555,153.76	0.06

77	002673	西部证券	85,300	553,597.00	0.06
78	603011	合锻智能	16,500	545,820.00	0.06
79	002245	蔚蓝锂芯	29,012	542,814.52	0.06
80	002518	科士达	10,000	535,900.00	0.05
81	601577	长沙银行	60,300	525,213.00	0.05
82	301358	湖南裕能	6,700	508,329.00	0.05
83	002653	海思科	7,600	504,184.00	0.05
84	301536	星宸科技	3,900	501,969.00	0.05
85	300568	星源材质	26,600	497,952.00	0.05
86	300073	当升科技	10,300	494,812.00	0.05
87	688580	伟思医疗	9,220	491,149.40	0.05
88	300919	中伟新材	10,700	468,125.00	0.05
89	300347	泰格医药	9,200	441,600.00	0.05
90	600155	华创云信	79,300	437,736.00	0.04
91	603757	大元泵业	5,700	431,832.00	0.04
92	002734	利民股份	25,100	430,967.00	0.04
93	688410	山外山	29,796	427,870.56	0.04
94	002797	第一创业	65,000	427,050.00	0.04
95	600201	生物股份	36,400	424,060.00	0.04
96	300751	迈为股份	1,500	423,690.00	0.04
97	002926	华西证券	49,400	403,598.00	0.04
98	688677	海泰新光	3,971	401,587.23	0.04
99	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.04
100	603826	坤彩科技	14,600	373,176.00	0.04
101	300438	鹏辉能源	4,400	364,540.00	0.04
102	603198	迎驾贡酒	12,200	361,120.00	0.04
103	603127	昭衍新药	9,400	359,268.00	0.04
104	002963	豪尔赛	16,600	349,596.00	0.04
105	000783	长江证券	34,900	340,275.00	0.03
106	300206	理邦仪器	27,700	338,771.00	0.03
107	300284	苏交科	67,300	336,500.00	0.03
108	688475	萤石网络	12,285	335,994.75	0.03
109	600884	杉杉股份	24,600	333,330.00	0.03
110	601233	桐昆股份	15,200	329,080.00	0.03
111	688275	万润新能	2,539	323,849.45	0.03
112	002444	巨星科技	10,300	320,330.00	0.03
113	002841	视源股份	9,200	317,676.00	0.03
114	601108	财通证券	36,700	317,455.00	0.03
115	300458	全志科技	8,000	315,680.00	0.03
116	003018	金富科技	4,100	312,543.00	0.03
117	000703	恒逸石化	22,700	308,039.00	0.03
118	300604	长川科技	900	307,278.00	0.03
119	600458	时代新材	18,500	306,175.00	0.03
120	603195	公牛集团	7,800	305,370.00	0.03

121	600177	雅戈尔	40,400	304,212.00	0.03
122	600872	中炬高新	17,300	300,328.00	0.03
123	300475	香农芯创	1,000	300,000.00	0.03
124	688147	微导纳米	1,825	295,431.00	0.03
125	002557	洽洽食品	16,400	294,544.00	0.03
126	301098	金埔园林	35,900	294,380.00	0.03
127	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.03
128	000415	渤海租赁	71,400	290,598.00	0.03
129	688777	中控技术	2,427	285,172.50	0.03
130	603137	恒尚节能	21,800	282,092.00	0.03
131	000810	创维数字	21,200	280,900.00	0.03
132	300972	万辰集团	1,600	277,456.00	0.03
133	601001	晋控煤业	15,800	274,762.00	0.03
134	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.03
135	601666	平煤股份	37,200	265,980.00	0.03
136	000779	甘咨询	34,000	264,860.00	0.03
137	300620	光库科技	700	264,740.00	0.03
138	600366	宁波韵升	17,900	262,772.00	0.03
139	000786	北新建材	14,500	262,305.00	0.03
140	688484	南芯科技	4,620	260,983.80	0.03
141	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.03
142	002136	安纳达	19,400	253,752.00	0.03
143	600487	亨通光电	2,300	251,482.00	0.03
144	601231	环旭电子	7,700	249,480.00	0.03
145	000419	通程控股	55,200	248,952.00	0.03
146	688387	信科移动	12,496	247,920.64	0.03
147	301571	国科天成	3,800	247,684.00	0.03
148	688652	京仪装备	1,236	247,410.12	0.03
149	000548	湖南投资	60,300	246,627.00	0.03
150	688469	芯联集成	23,142	245,536.62	0.03
151	300860	锋尚文化	9,500	243,200.00	0.02
152	002008	大族激光	1,600	240,176.00	0.02
153	688690	纳微科技	5,435	239,683.50	0.02
154	688702	盛科通信	614	239,453.86	0.02
155	001286	陕西能源	23,400	237,276.00	0.02
156	002780	三夫户外	19,500	236,730.00	0.02
157	603214	爱婴室	19,300	233,723.00	0.02
158	301500	飞南资源	8,900	231,845.00	0.02
159	300012	华测检测	16,700	231,462.00	0.02
160	300387	富邦科技	33,900	230,181.00	0.02
161	603183	建研院	64,500	228,975.00	0.02
162	300564	筑博设计	19,000	228,190.00	0.02
163	603908	牧高笛	13,500	227,880.00	0.02
164	688180	君实生物	6,734	227,743.88	0.02

165	300675	建科院	19,200	227,520.00	0.02
165	300694	蠡湖股份	23,700	227,520.00	0.02
167	002968	新大正	26,300	222,498.00	0.02
168	603071	物产环能	20,000	221,200.00	0.02
169	300732	设研院	39,600	220,572.00	0.02
170	002722	物产金轮	18,500	218,115.00	0.02
171	688820	盛合晶微	1,537	217,470.13	0.02
172	300823	建科智能	14,900	217,242.00	0.02
173	003023	彩虹集团	11,100	215,784.00	0.02
174	002154	报喜鸟	60,400	215,024.00	0.02
175	301156	美农生物	19,720	214,356.40	0.02
176	001389	广合科技	900	213,525.00	0.02
177	600259	中稀有色	2,100	213,381.00	0.02
178	688203	海正生材	21,312	212,693.76	0.02
179	002635	安洁科技	10,400	212,680.00	0.02
180	000550	江铃汽车	13,100	212,482.00	0.02
181	601061	中信金属	19,700	212,169.00	0.02
182	600148	长春一东	14,600	211,846.00	0.02
183	300342	天银机电	4,500	211,500.00	0.02
184	002593	日上集团	52,100	207,879.00	0.02
185	603162	海通发展	23,012	206,417.64	0.02
186	002391	长青股份	42,200	205,514.00	0.02
187	301037	保立佳	17,100	205,200.00	0.02
188	002105	信隆健康	41,500	205,010.00	0.02
189	002432	九安医疗	2,900	204,972.00	0.02
190	301519	舜禹股份	18,800	203,980.00	0.02
191	600885	宏发股份	5,900	203,491.00	0.02
192	605138	盛泰集团	36,399	200,922.48	0.02
193	002820	桂发祥	23,900	200,760.00	0.02
194	605151	西上海	11,400	200,754.00	0.02
195	603317	天味食品	15,300	199,053.00	0.02
196	000709	河钢股份	101,700	197,298.00	0.02
197	600320	振华重工	47,700	197,001.00	0.02
198	002216	三全食品	16,900	194,857.00	0.02
199	600523	贵航股份	18,200	192,010.00	0.02
200	603338	浙江鼎力	4,500	191,250.00	0.02
201	603699	纽威股份	3,800	191,140.00	0.02
202	000589	贵州轮胎	46,800	190,008.00	0.02
203	001395	亚联机械	8,140	189,662.00	0.02
204	002810	山东赫达	7,600	187,720.00	0.02
205	688321	微芯生物	7,129	187,706.57	0.02
206	600499	科达制造	13,600	187,680.00	0.02
207	301489	思泉新材	1,140	187,621.20	0.02
208	600359	新农开发	34,400	185,760.00	0.02

209	688696	极米科技	2,843	183,487.22	0.02
210	603719	良品铺子	20,700	179,055.00	0.02
211	603345	安井食品	2,200	176,418.00	0.02
212	301371	敷尔佳	6,700	174,200.00	0.02
213	688279	峰昭科技	773	173,492.12	0.02
214	000039	中集集团	21,000	170,310.00	0.02
215	301216	万凯新材	7,300	167,827.00	0.02
216	688408	中信博	5,022	161,457.30	0.02
217	603818	曲美家居	53,800	159,786.00	0.02
218	603833	欧派家居	5,100	153,561.00	0.02
219	001399	惠科股份	5,488	152,182.24	0.02
220	002135	东南网架	22,300	151,417.00	0.02
221	605338	巴比食品	8,300	148,570.00	0.02
222	600833	第一医药	16,300	147,026.00	0.02
223	000921	海信家电	5,300	144,796.00	0.01
224	003003	天元股份	14,500	144,275.00	0.01
225	688717	艾罗能源	1,741	143,754.37	0.01
226	002799	环球印务	23,300	140,965.00	0.01
227	300030	阳普医疗	24,200	140,602.00	0.01
228	301126	达嘉维康	16,400	140,220.00	0.01
229	603396	金辰股份	5,100	135,150.00	0.01
230	000877	天山股份	35,000	127,050.00	0.01
231	301370	国科恒泰	15,700	127,013.00	0.01
232	603507	振江股份	3,800	124,982.00	0.01
233	603939	益丰药房	6,900	124,062.00	0.01
234	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
235	603185	弘元绿能	7,200	120,168.00	0.01
236	600566	济川药业	5,300	117,607.00	0.01
237	688330	宏力达	3,413	115,461.79	0.01
238	601311	骆驼股份	14,800	115,292.00	0.01
239	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
240	002767	先锋电子	6,700	111,019.00	0.01
241	300207	欣旺达	5,700	108,243.00	0.01
242	002452	长高电气	8,300	105,991.00	0.01
243	300556	丝路视觉	6,100	105,957.00	0.01
244	603381	永臻股份	6,800	104,788.00	0.01
245	300360	炬华科技	8,600	101,050.00	0.01
246	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
247	300654	世纪天鸿	9,900	96,228.00	0.01
248	688099	晶晨股份	888	91,375.20	0.01
249	002546	新联电子	12,300	89,544.00	0.01
250	688557	兰剑智能	2,870	89,056.10	0.01
251	000878	云南铜业	5,600	88,928.00	0.01
252	002876	三利谱	2,500	88,025.00	0.01

253	688021	奥福科技	4,268	82,628.48	0.01
254	603098	森特股份	7,400	78,070.00	0.01
255	688689	银河微电	1,183	76,563.76	0.01
256	603083	剑桥科技	300	76,461.00	0.01
257	688561	奇安信	3,069	73,594.62	0.01
258	301366	一博科技	1,200	73,404.00	0.01
259	600697	欧亚集团	6,900	67,068.00	0.01
260	001339	智微智能	650	66,482.00	0.01
261	002439	启明星辰	5,100	64,515.00	0.01
262	300613	富瀚微	800	64,064.00	0.01
263	688102	斯瑞新材	1,336	63,032.48	0.01
264	688721	龙图光罩	1,066	62,233.08	0.01
265	688699	明微电子	759	62,200.05	0.01
266	300709	精研科技	1,100	61,875.00	0.01
267	600536	中国软件	2,200	61,864.00	0.01
268	301303	真兰仪表	3,600	61,740.00	0.01
269	300283	温州宏丰	3,000	61,650.00	0.01
270	688378	奥来德	979	60,698.00	0.01
271	301086	鸿富瀚	280	58,598.40	0.01
272	301275	汉朔科技	1,300	58,370.00	0.01
273	301160	翔楼新材	1,215	56,679.75	0.01
274	688156	路德科技	1,860	56,265.00	0.01
275	301568	思泰克	500	55,800.00	0.01
276	002718	友邦吊顶	500	55,125.00	0.01
277	300293	蓝英装备	2,700	54,945.00	0.01
278	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
279	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
280	688661	和林微纳	332	52,781.36	0.01
281	688173	希荻微	2,756	52,749.84	0.01
282	688692	达梦数据	215	52,522.35	0.01
283	603068	博通集成	1,300	52,299.00	0.01
284	688235	百济神州	205	52,195.05	0.01
285	300938	信测标准	1,040	51,875.20	0.01
286	002832	比音勒芬	2,500	51,600.00	0.01
287	300825	阿尔特	3,600	51,408.00	0.01
288	688796	百奥赛图	467	51,089.80	0.01
289	688181	八亿时空	816	51,081.60	0.01
290	688592	司南导航	1,225	50,764.00	0.01
291	688428	诺诚健华	1,768	50,334.96	0.01
292	688231	隆达股份	1,368	50,246.64	0.01
293	688148	芳源股份	5,739	49,240.62	0.01
294	300665	飞鹿股份	4,800	49,104.00	0.01
295	300039	上海凯宝	11,500	48,990.00	0.01
296	603207	小方制药	2,185	48,856.60	0.01

297	300693	盛弘股份	1,000	48,750.00	0.00
298	002637	赞宇科技	4,600	48,438.00	0.00
299	301428	世纪恒通	1,400	48,398.00	0.00
300	002372	伟星新材	5,900	48,321.00	0.00
301	000800	一汽解放	8,100	48,195.00	0.00
302	300195	长荣股份	8,200	48,134.00	0.00
303	300791	仙乐健康	3,000	48,060.00	0.00
304	301376	致欧科技	2,700	47,844.00	0.00
305	603617	君禾股份	6,700	47,704.00	0.00
306	002910	庄园牧场	4,300	47,644.00	0.00
307	600761	安徽合力	2,900	47,444.00	0.00
308	002738	中矿资源	800	47,192.00	0.00
309	002609	捷顺科技	6,100	46,482.00	0.00
310	300745	欣锐科技	1,100	46,442.00	0.00
311	002833	弘亚数控	2,400	46,296.00	0.00
312	300453	三鑫医疗	5,100	46,104.00	0.00
313	688358	祥生医疗	1,505	46,007.85	0.00
314	300375	鹏翎股份	11,200	45,920.00	0.00
315	002239	奥特佳	18,500	45,695.00	0.00
316	002807	江阴银行	12,300	45,633.00	0.00
317	603298	杭叉集团	1,900	45,334.00	0.00
318	300800	力合科技	4,900	45,325.00	0.00
319	301397	溯联股份	1,400	45,304.00	0.00
320	600653	申华控股	30,200	45,300.00	0.00
321	603316	诚邦股份	2,200	45,298.00	0.00
322	601128	常熟银行	7,760	45,163.20	0.00
323	002930	宏川智慧	4,900	45,080.00	0.00
324	300482	万孚生物	2,700	44,847.00	0.00
325	300406	九强生物	4,100	44,813.00	0.00
326	000404	长虹华意	5,700	44,802.00	0.00
327	301149	隆华新材	4,200	44,436.00	0.00
328	300337	银邦股份	3,800	44,308.00	0.00
329	002606	大连电瓷	3,300	44,253.00	0.00
330	603309	维力医疗	3,900	43,758.00	0.00
331	000516	国际医学	11,200	43,568.00	0.00
332	002458	益生股份	5,600	43,512.00	0.00
333	603228	景旺电子	600	43,446.00	0.00
334	605098	行动教育	800	43,328.00	0.00
335	300298	三诺生物	3,100	43,245.00	0.00
336	600699	均胜电子	2,000	43,220.00	0.00
337	603927	中科软	3,400	43,214.00	0.00
338	300890	翔丰华	1,300	43,121.00	0.00
339	301179	泽宇智能	2,100	42,966.00	0.00
340	603188	亚邦股份	10,800	42,768.00	0.00

341	688247	宣泰医药	5,677	42,691.04	0.00
342	300768	迪普科技	3,100	42,687.00	0.00
343	002301	齐心集团	5,900	42,657.00	0.00
344	002695	煌上煌	4,200	42,630.00	0.00
345	603408	建霖家居	4,400	42,460.00	0.00
346	301439	泓淋电力	2,700	42,444.00	0.00
347	300525	博思软件	5,700	42,408.00	0.00
348	301429	森泰股份	2,700	42,309.00	0.00
349	002196	方正电机	3,500	42,210.00	0.00
350	603836	海程邦达	5,340	42,186.00	0.00
351	300299	富春股份	8,600	42,140.00	0.00
352	300713	英可瑞	3,300	42,042.00	0.00
353	301135	瑞德智能	2,520	41,504.40	0.00
354	600834	申通地铁	6,300	41,454.00	0.00
355	603511	爱慕股份	3,600	41,400.00	0.00
356	002864	盘龙药业	1,600	41,280.00	0.00
357	603912	佳力图	5,300	41,234.00	0.00
358	603048	浙江黎明	2,300	40,802.00	0.00
359	600763	通策医疗	1,200	40,656.00	0.00
360	688778	厦钨新能	746	40,582.40	0.00
361	301025	读客文化	5,200	40,352.00	0.00
362	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
363	300226	上海钢联	2,620	40,112.20	0.00
364	688553	汇宇制药	3,771	40,085.73	0.00
365	301206	三元生物	1,800	40,014.00	0.00
366	301062	上海艾录	7,000	39,970.00	0.00
367	300182	捷成股份	8,400	39,900.00	0.00
368	300324	旋极信息	10,700	39,804.00	0.00
369	002097	山河智能	5,500	39,765.00	0.00
370	001218	丽臣实业	1,800	39,708.00	0.00
371	000426	兴业银锡	1,200	39,552.00	0.00
372	002697	红旗连锁	9,500	39,520.00	0.00
373	688513	苑东生物	898	39,476.08	0.00
374	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
375	000058	深赛格	6,400	39,296.00	0.00
376	301335	天元宠物	2,000	39,260.00	0.00
377	002612	朗姿股份	3,500	39,235.00	0.00
378	603866	桃李面包	10,600	39,008.00	0.00
379	688575	亚辉龙	4,446	38,946.96	0.00
380	301393	昊帆生物	600	38,862.00	0.00
381	603059	倍加洁	1,600	38,800.00	0.00
382	300517	海波重科	4,100	38,622.00	0.00
383	001914	招商积余	4,700	38,352.00	0.00
384	002858	力盛体育	3,500	38,185.00	0.00

385	002382	蓝帆医疗	7,500	38,100.00	0.00
386	300761	立华股份	2,300	37,743.00	0.00
387	002599	盛通股份	7,400	37,740.00	0.00
388	688313	仕佳光子	201	37,114.65	0.00
389	600389	江山股份	1,900	37,088.00	0.00
390	605136	丽人丽妆	5,200	37,076.00	0.00
391	603037	凯众股份	3,700	37,074.00	0.00
392	300740	水羊股份	2,000	36,820.00	0.00
393	600498	烽火通信	500	36,800.00	0.00
394	300785	值得买	1,000	36,670.00	0.00
395	300904	威力传动	900	36,531.00	0.00
396	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
397	301101	明月镜片	1,300	35,412.00	0.00
398	603051	鹿山新材	1,800	34,704.00	0.00
399	301598	博科测试	700	34,664.00	0.00
400	002862	实丰文化	2,700	34,641.00	0.00
401	002812	恩捷股份	500	33,455.00	0.00
402	301265	华新科技	1,200	33,060.00	0.00
403	002531	天顺风能	3,900	32,877.00	0.00
404	301173	毓恬冠佳	1,100	32,681.00	0.00
405	002545	东方铁塔	2,000	32,440.00	0.00
406	300567	精测电子	100	31,760.00	0.00
407	002078	太阳纸业	2,500	31,225.00	0.00
408	688551	科威尔	426	29,935.02	0.00
409	600801	华新建材	1,900	29,640.00	0.00
410	301522	上大股份	1,100	28,787.00	0.00
411	688819	天能股份	1,285	28,527.00	0.00
412	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
413	300491	通合科技	700	26,733.00	0.00
414	300664	鹏鹞环保	6,300	26,712.00	0.00
415	002281	光迅科技	100	25,694.00	0.00
416	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
417	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
418	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
419	300390	天华新能	200	18,702.00	0.00
420	603124	江南新材	100	18,698.00	0.00
421	603301	振德医疗	200	17,432.00	0.00
422	300031	宝通科技	600	17,142.00	0.00
423	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
424	600022	山东钢铁	12,700	15,748.00	0.00
425	300373	扬杰科技	100	15,723.00	0.00
426	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
427	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
428	001393	维通利	387	15,089.13	0.00

429	603202	天有为	305	14,987.70	0.00
430	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
431	688035	德邦科技	158	14,504.40	0.00
432	688360	德马科技	798	14,284.20	0.00
433	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
434	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
435	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
436	688237	超卓航科	237	12,660.54	0.00
437	688516	奥特维	220	12,625.80	0.00
438	603115	海星股份	100	12,247.00	0.00
439	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
440	603329	上海雅仕	1,300	11,674.00	0.00
441	688011	新光光电	163	11,388.81	0.00
442	688698	伟创电气	217	11,381.65	0.00
443	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
444	300773	拉卡拉	660	10,098.00	0.00
445	301590	优优绿能	73	9,595.85	0.00
446	301387	光大同创	100	9,242.00	0.00
447	002222	福晶科技	100	9,228.00	0.00
448	300737	科顺股份	1,400	9,198.00	0.00
449	688319	欧林生物	209	9,191.82	0.00
450	301031	中熔电气	72	8,600.40	0.00
451	688028	沃尔德	53	8,261.11	0.00
452	603688	石英股份	100	8,261.00	0.00
453	600808	马钢股份	3,300	8,250.00	0.00
454	603092	德力佳	146	7,879.62	0.00
455	603379	三美股份	100	7,589.00	0.00
456	002138	顺络电子	100	7,310.00	0.00
457	301479	弘景光电	120	7,224.00	0.00
458	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
459	688678	福立旺	288	6,960.96	0.00
460	603119	浙江荣泰	100	6,634.00	0.00
461	601933	永辉超市	2,300	6,532.00	0.00
462	001221	悍高集团	160	6,435.20	0.00
463	688601	力芯微	105	6,357.75	0.00
464	000034	神州数码	228	6,327.00	0.00
465	601216	君正集团	1,400	6,244.00	0.00
466	300748	金力永磁	200	6,170.00	0.00
467	301297	富乐德	100	6,124.00	0.00
468	301035	润丰股份	130	6,032.00	0.00
469	002006	精工科技	400	5,884.00	0.00
470	603659	璞泰来	200	5,786.00	0.00
471	300508	维宏股份	100	5,743.00	0.00
472	301018	申菱环境	49	5,664.89	0.00

473	002756	永兴材料	100	5,664.00	0.00
474	002555	三七互娱	300	5,661.00	0.00
475	688211	中科微至	158	5,438.36	0.00
476	601168	西部矿业	200	5,428.00	0.00
477	688023	安恒信息	145	5,324.40	0.00
478	600988	赤峰黄金	200	5,264.00	0.00
479	301662	宏工科技	50	5,066.00	0.00
480	603179	新泉股份	100	4,965.00	0.00
481	688409	富创精密	16	4,900.00	0.00
482	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
483	000553	安道麦 A	900	4,815.00	0.00
484	600141	兴发集团	100	4,697.00	0.00
485	002240	盛新锂能	100	4,483.00	0.00
486	002847	盐津铺子	100	4,460.00	0.00
487	002335	科华数据	105	4,457.25	0.00
488	300590	移为通信	300	4,305.00	0.00
489	603786	科博达	100	4,091.00	0.00
490	002991	甘源食品	100	3,951.00	0.00
491	300049	福瑞医科	100	3,888.00	0.00
492	002870	香山股份	100	3,854.00	0.00
493	605090	九丰能源	100	3,717.00	0.00
494	002158	汉钟精机	100	3,708.00	0.00
495	603596	伯特利	148	3,676.32	0.00
496	300085	银之杰	100	3,497.00	0.00
497	002824	和胜股份	100	3,458.00	0.00
498	301360	荣旗科技	50	3,424.50	0.00
499	600673	东阳光	100	3,358.00	0.00
500	600391	航发科技	100	3,345.00	0.00
501	000062	深圳华强	100	3,182.00	0.00
502	300957	贝泰妮	100	3,151.00	0.00
503	002838	道恩股份	100	3,062.00	0.00
504	600096	云天化	100	3,040.00	0.00
505	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
506	002261	拓维信息	100	2,801.00	0.00
507	001298	好上好	130	2,697.50	0.00
508	001388	信通电子	94	2,582.18	0.00
509	688058	宝兰德	121	2,531.32	0.00
510	688659	元琛科技	239	2,495.16	0.00
511	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
512	300735	光弘科技	100	2,274.00	0.00
513	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
514	300923	研奥股份	100	2,228.00	0.00
515	002014	永新股份	200	2,112.00	0.00
516	002595	豪迈科技	45	2,097.00	0.00

517	002915	中欣氟材	100	2,051.00	0.00
518	300432	富临精工	100	2,009.00	0.00
519	600332	白云山	100	2,004.00	0.00
520	605555	德昌股份	156	1,950.00	0.00
521	603697	有友食品	200	1,918.00	0.00
522	300019	硅宝科技	100	1,906.00	0.00
523	600980	北矿科技	100	1,875.00	0.00
524	000887	中鼎股份	100	1,789.00	0.00
525	300304	云意电气	100	1,785.00	0.00
526	003020	立方制药	120	1,777.20	0.00
527	605369	拱东医疗	100	1,754.00	0.00
528	000581	威孚高科	100	1,702.00	0.00
529	603730	岱美股份	149	1,664.33	0.00
530	002645	华宏科技	60	1,650.60	0.00
531	601156	东航物流	100	1,612.00	0.00
532	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
533	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
534	001289	龙源电力	100	1,563.00	0.00
535	301367	瑞迈特	40	1,546.40	0.00
536	600143	金发科技	100	1,545.00	0.00
537	300529	健帆生物	100	1,540.00	0.00
538	002603	以岭药业	100	1,500.00	0.00
539	001207	联科科技	100	1,492.00	0.00
540	300493	润欣科技	100	1,491.00	0.00
541	603368	柳药集团	100	1,467.00	0.00
542	002508	老板电器	100	1,462.00	0.00
543	002468	申通快递	100	1,456.00	0.00
544	002690	美亚光电	100	1,433.00	0.00
545	002831	裕同科技	40	1,422.40	0.00
546	002966	苏州银行	200	1,392.00	0.00
547	688489	三未信安	61	1,384.70	0.00
548	600601	方正科技	100	1,384.00	0.00
549	002755	奥赛康	100	1,362.00	0.00
550	605228	神通科技	100	1,343.00	0.00
551	300549	优德精密	100	1,302.00	0.00
552	300017	网宿科技	100	1,301.00	0.00
553	002258	利尔化学	100	1,271.00	0.00
554	603237	五芳斋	100	1,238.00	0.00
555	600995	南网储能	100	1,230.00	0.00
556	603135	中重科技	100	1,210.00	0.00
557	300084	海默科技	100	1,203.00	0.00
558	601965	中国汽研	100	1,196.00	0.00
559	300227	光韵达	100	1,190.00	0.00
560	300003	乐普医疗	100	1,185.00	0.00

561	603700	宁水集团	100	1,161.00	0.00
562	002772	众兴菌业	100	1,136.00	0.00
563	688720	艾森股份	11	1,111.00	0.00
564	002085	万丰奥威	100	1,109.00	0.00
565	300349	金卡智能	100	1,094.00	0.00
566	300407	凯发电气	100	1,080.00	0.00
567	603208	江山欧派	100	1,070.00	0.00
568	601865	福莱特	100	1,051.00	0.00
569	002948	青岛银行	200	1,016.00	0.00
570	600590	泰豪科技	100	1,010.00	0.00
571	601963	重庆银行	100	1,008.00	0.00
572	600178	东安动力	100	983.00	0.00
573	002911	佛燃能源	100	949.00	0.00
574	002456	欧菲光	100	946.00	0.00
575	300146	汤臣倍健	100	904.00	0.00
576	600908	无锡银行	164	833.12	0.00
577	300254	仟源医药	100	801.00	0.00
578	600507	方大特钢	192	777.60	0.00
579	002298	中电鑫龙	100	762.00	0.00
580	002244	滨江集团	100	760.00	0.00
581	600848	上海临港	100	749.00	0.00
582	600222	太龙药业	100	726.00	0.00
583	600032	浙江新能	100	705.00	0.00
584	600956	新天绿能	100	699.00	0.00
585	600839	四川长虹	100	698.00	0.00
586	001258	立新能源	100	692.00	0.00
587	002608	江苏国信	100	690.00	0.00
587	002615	哈尔斯	100	690.00	0.00
589	601187	厦门银行	100	683.00	0.00
590	600663	陆家嘴	100	628.00	0.00
591	002320	海峡股份	100	627.00	0.00
592	600195	中牧股份	100	590.00	0.00
593	600057	厦门象屿	100	542.00	0.00
594	600398	海澜之家	100	523.00	0.00
595	301353	普莱得	30	498.30	0.00
596	001311	多利科技	30	483.90	0.00
597	000591	太阳能	100	460.00	0.00
598	600395	盘江股份	100	456.00	0.00
599	603300	海南华铁	100	455.00	0.00
600	002252	上海莱士	100	434.00	0.00
601	601975	招商南油	100	373.00	0.00
602	600369	西南证券	91	365.82	0.00
603	601162	天风证券	100	337.00	0.00
604	601326	秦港股份	100	316.00	0.00

605	600850	电科数字	20	291.20	0.00
606	300532	今天国际	40	249.20	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000338	潍柴动力	22,228,557.00	2.16
2	300274	阳光电源	17,696,622.59	1.72
3	600036	招商银行	17,526,352.00	1.71
4	300750	宁德时代	16,167,018.00	1.57
5	300502	新易盛	15,768,420.00	1.53
6	000425	徐工机械	15,703,180.12	1.53
7	688041	海光信息	15,348,802.78	1.49
8	002594	比亚迪	15,287,035.43	1.49
9	002028	思源电气	14,723,297.52	1.43
10	300308	中际旭创	14,550,766.69	1.42
11	600312	平高电气	13,666,405.51	1.33
12	603986	兆易创新	12,663,163.00	1.23
13	600489	中金黄金	12,660,566.00	1.23
14	601166	兴业银行	12,659,937.00	1.23
15	600919	江苏银行	12,501,198.00	1.22
16	300408	三环集团	12,068,930.54	1.17
17	601816	京沪高铁	12,009,120.00	1.17
18	600089	特变电工	11,951,969.70	1.16
19	002384	东山精密	11,945,459.00	1.16
20	600039	四川路桥	11,881,684.28	1.16

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000338	潍柴动力	23,328,211.00	2.27
2	600036	招商银行	19,697,072.00	1.92
3	300502	新易盛	18,766,169.00	1.83
4	002594	比亚迪	17,803,815.49	1.73
5	000425	徐工机械	17,740,587.00	1.73
6	601857	中国石油	17,014,954.00	1.66
7	300274	阳光电源	16,691,880.70	1.62
8	600519	贵州茅台	16,436,515.00	1.60
9	600039	四川路桥	16,340,775.00	1.59

10	601166	兴业银行	16,033,016.00	1.56
11	300308	中际旭创	15,900,673.00	1.55
12	000792	盐湖股份	15,567,564.00	1.52
13	600188	兖矿能源	14,945,731.00	1.45
14	688041	海光信息	14,539,847.40	1.42
15	002028	思源电气	14,499,160.00	1.41
16	300750	宁德时代	14,361,233.00	1.40
17	600312	平高电气	14,042,070.84	1.37
18	300394	天孚通信	13,685,458.00	1.33
19	600989	宝丰能源	13,450,198.64	1.31
20	300408	三环集团	12,754,029.51	1.24

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	2,362,908,549.66
卖出股票收入（成交）总额	2,474,746,952.24

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	1,414,689.26	0.15
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,414,689.26	0.15

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	102317	国债 2519	14,000	1,414,689.26	0.15

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	105,087.31
2	应收清算款	1,130,829.64

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,570,853.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,806,770.48

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	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.26	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 300 量化增强 A	35,475	8,045.34	18,958,752.47	6.64%	266,449,806.47	93.36%
易方达沪深 300 量化增强 Y	87	1,261.03	0.00	0.00%	109,709.93	100.00 %

合计	35,562	8,028.75	18,958,752.47	6.64%	266,559,516.40	93.36%
----	--------	----------	---------------	-------	----------------	--------

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 300 量化增强 A	435,480.12	0.1526%
	易方达沪深 300 量化增强 Y	4,015.60	3.6602%
	合计	439,495.72	0.1539%

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	易方达沪深 300 量化增强 A	10~50
	易方达沪深 300 量化增强 Y	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达沪深 300 量化增强 A	10~50
	易方达沪深 300 量化增强 Y	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达沪深 300 量化增强 A	易方达沪深 300 量化增强 Y
基金合同生效日（2012 年 7 月 5 日）基金份额总额	248,871,987.37	-
本报告期期初基金份额总额	330,629,766.85	-
本报告期基金总申购份额	72,404,468.25	123,984.09
减：本报告期基金总赎回份额	117,625,676.16	14,274.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	285,408,558.94	109,709.93

注：本基金 A 类基金份额由原基金份额变更而来，并于 2026 年 4 月 27 日起增设 Y 类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§ 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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
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	635,744,724.69	13.15%	63,579.84	13.15%	-
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	2,678,716,035.69	55.40%	267,872.35	55.40%	-
中信证券	2	1,520,541,825.14	31.45%	152,060.73	31.45%	-
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	
	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
财通证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
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	141,084.50	9.08%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	2,001.51	0.13%	-	-	-	-
中信证券	1,411,188.69	90.79%	-	-	-	-
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
6	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
7	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
8	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
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	易方达沪深 300 量化增强证券投资基金之 Y 类份额开放日常申购、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	2026-04-23
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金	上海证券报、基金管理人	2026-04-23

	增设 Y 类基金份额并修订基金合同、托管协议的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
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	2026-04-23
13	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
14	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
15	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
16	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
17	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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量化衍伸股票型证券投资基金募集的文件；
- 2.中国证监会《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》；
- 3.《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金托管协议》；
- 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