

易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	44
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45

7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 盈利投资者数量占比	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.4 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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
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	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金	
基金简称	易方达高质量增长量化精选股票	
基金主代码	014139	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 5 月 6 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	62,034,429.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达高质量增长量化精选股票 A	易方达高质量增长量化精选股票 C
下属分级基金的交易代码	014139	014140
报告期末下属分级基金的份额总额	41,084,889.55 份	20,949,539.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要采用量化策略精选高质量增长公司进行投资，在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	资产配置方面，本基金将综合考虑宏观与微观经济、市场与政策等因素，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。股票投资方面，本基金主要采用多因子量化模型并结合组合优化模型，精选高质量增长股票构建投资组合，在控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。多因子量化模型利用定量方法，综合考虑宏观经济、上市公司基本面、市场情绪与投资者预期等多种因素，对上市公司的质量和成长性进行评价，并对股票的投资价值进行统计评估，力争利用市场中价格与价值的偏差获取长期持续的超额收益。本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行。债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×15%+中债总指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	易方达基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	王玉	张姗
	联系电话	020-85102688	400-61-95555
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	400-61-95555
传真		020-38798812	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		510627；510623；519031	518040
法定代表人		吴欣荣	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江西路21号52层； 广东省广州市天河区珠江东路30号42层； 广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026年1月1日至2026年6月30日）	
	易方达高质量增长量化精选股票 A	易方达高质量增长量化精选股票 C
本期已实现收益	9,651,391.17	7,195,686.63
本期利润	5,349,882.31	4,042,470.34
加权平均基金份额本期利润	0.1015	0.0917
本期加权平均净值利润率	9.92%	9.11%

本期基金份额净值增长率	9.39%	9.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达高质量增长量化精选股票 A	易方达高质量增长量化精选股票 C
期末可供分配利润	3,358,827.19	1,421,682.63
期末可供分配基金份额利润	0.0818	0.0679
期末基金资产净值	44,443,716.74	22,371,222.39
期末基金份额净值	1.0818	1.0679
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达高质量增长量化精选股票 A	易方达高质量增长量化精选股票 C
基金份额累计净值增长率	8.18%	6.79%

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

易方达高质量增长量化精选股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.78%	1.64%	8.09%	1.05%	6.69%	0.59%
过去六个月	9.39%	1.48%	5.42%	1.00%	3.97%	0.48%
过去一年	33.44%	1.33%	20.87%	0.89%	12.57%	0.44%
过去三年	25.62%	1.53%	28.02%	0.96%	-2.40%	0.57%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.18%	1.43%	26.95%	0.93%	-18.77%	0.50%

易方达高质量增长量化精选股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	14.73%	1.64%	8.09%	1.05%	6.64%	0.59%
过去六个月	9.24%	1.48%	5.42%	1.00%	3.82%	0.48%
过去一年	32.99%	1.33%	20.87%	0.89%	12.12%	0.44%
过去三年	24.58%	1.53%	28.02%	0.96%	-3.44%	0.57%

过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.79%	1.43%	26.95%	0.93%	-20.16%	0.50%

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

易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022 年 5 月 6 日至 2026 年 6 月 30 日)

易方达高质量增长量化精选股票 A



易方达高质量增长量化精选股票 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
杜才鸣	本基金的基金经理，易方达中证港股通综合量化增强的基金经理	2022-05-06	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、量化研究员、投资经理助理、投资经理，易方达量化策略精选混合、易方达沪深 300 量化增强的基金经理。

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。

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，国内经济总体延续温和运行态势，但内需偏弱、结构分化的特征较为明显。从宏观经济数据来看，2026 年上半年 GDP 同比增长 4.7%，其中一季度 GDP 同比增长 5.0%，二季度 GDP 同比增长 4.3%，同比增速趋缓。细分领域来看，经济新动能持续发力，高技术产业、知识产权产品等新兴领域投资保持高增长；内需修复节奏偏缓，固定资产投资、社会消费整体承压，房地产开发投资持续低迷，成为拖累经济复苏的主要因素。此外，中东地缘冲突等外部事件对资本市场形成阶段性情绪冲击，但未改变国内经济中长期稳定复苏的基本面。

从股票市场来看，上半年 A 股先抑后扬，在流动性充裕与科技产业趋势共振下走出结构性牛市行情，上证指数收益率为 3.16%，沪深 300 指数收益率为 7.55%，中证 500 指数收益率为 20.97%，

创业板指数收益率为 35.58%。从行业表现来看，电子、通信和建筑材料等科技硬件与 AI 产业链相关行业表现较好，商贸零售、农林牧渔和美容护理等行业表现较差。从市场风格来看，成长风格显著好于价值风格，大小盘风格相对均衡。

报告期内，本基金依托量化选股模型，立足中长期投资逻辑，优选公司质地好、盈利能力强、成长性突出的个股进行均衡配置，尽量回避拥挤度过高的热点主题。期间港股市场受基本面悲观预期和流动性的影响，走势较差，本基金因配置部分港股仓位，收益率受到一定拖累。由于本基金配置的港股龙头公司盈利能力依然出色，我们仍将坚持对这些公司的配置。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 1.0818 元，本报告期份额净值增长率为 9.39%，同期业绩比较基准收益率为 5.42%；C 类基金份额净值为 1.0679 元，本报告期份额净值增长率为 9.24%，同期业绩比较基准收益率为 5.42%。

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，宏观政策有望在稳增长、扩内需等方向持续发力，新兴产业、新质生产力将持续驱动经济高质量发展，经济整体韧性将持续凸显。宏观流动性预计保持充裕，科技产业趋势仍在演进，股票市场风险偏好有望维持，我们继续看好 A 股和港股后续的表现。

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、成长性好的公司进行配置，争取获得较好的回报。

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

易方达高质量增长量化精选股票 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达高质量增长量化精选股票 C:本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万万元的情形。

§ 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	8,941,101.10	12,997,560.95

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	62,695,554.93	122,878,761.27
其中：股票投资		62,695,554.93	122,878,761.27
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		1,501,557.08	7,316,776.19
应收股利		89,775.09	-
应收申购款		55,441.20	9,065.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		73,283,429.40	143,202,163.86
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		-	-
应付赎回款		6,301,875.39	6,276,555.11
应付管理人报酬		71,800.12	144,912.44
应付托管费		11,966.67	24,152.08
应付销售服务费		9,355.09	23,279.01
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	6.4.7.6	73,493.00	148,330.92
负债合计		6,468,490.27	6,617,229.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	62,034,429.31	138,853,306.31
未分配利润	6.4.7.8	4,780,509.82	-2,268,372.01
净资产合计		66,814,939.13	136,584,934.30
负债和净资产总计		73,283,429.40	143,202,163.86

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0818 元，C 类基金份额净值 1.0679 元；
基金份额总额 62,034,429.31 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 41,084,889.55

份，C 类基金份额总额 20,949,539.76 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,254,732.58	9,268,150.58
1.利息收入		7,834.27	22,075.53
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,834.27	22,075.53
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）		17,688,786.38	5,971,728.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	16,994,432.49	3,884,888.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	31,742.01
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	694,353.89	2,055,098.05
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	-7,454,725.15	3,264,868.33
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	12,837.08	9,478.44
减：二、营业总支出		862,379.93	1,457,610.06
1. 管理人报酬		589,234.74	1,035,180.05
2. 托管费		98,205.75	172,529.91
3. 销售服务费		88,999.69	163,755.53
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		-	0.13
8. 其他费用	6.4.7.18	85,939.75	86,144.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,392,352.65	7,810,540.52
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,392,352.65	7,810,540.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,392,352.65	7,810,540.52

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	138,853,306.31	-2,268,372.01	136,584,934.30
二、本期期初净资产	138,853,306.31	-2,268,372.01	136,584,934.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-76,818,877.00	7,048,881.83	-69,769,995.17
（一）、综合收益总额	-	9,392,352.65	9,392,352.65
（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）	-76,818,877.00	-2,343,470.82	-79,162,347.82
其中：1.基金申购款	9,757,677.70	458,921.40	10,216,599.10
2.基金赎回款	-86,576,554.70	-2,802,392.22	-89,378,946.92
（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	62,034,429.31	4,780,509.82	66,814,939.13
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	185,905,358.81	-43,253,985.79	142,651,373.02
二、本期期初净资产	185,905,358.81	-43,253,985.79	142,651,373.02

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,093,926.28	5,466,191.43	15,560,117.71
（一）、综合收益总额	-	7,810,540.52	7,810,540.52
（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）	10,093,926.28	-2,344,349.09	7,749,577.19
其中：1.基金申购款	71,060,243.30	-14,895,801.16	56,164,442.14
2.基金赎回款	-60,966,317.02	12,551,452.07	-48,414,864.95
（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	195,999,285.09	-37,787,794.36	158,211,490.73

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

易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3378 号《关于准予易方达中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达高质量增长量化精选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，《易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金基金合同》于 2022 年 5 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 467,833,026.43 份基金份额，其中认购资金利息折合 296,131.41 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、

各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部 税务总局公告 2021 年第 33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如

下：

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

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

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

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

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,716,996.92
等于：本金	1,716,806.03
加：应计利息	190.89
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	7,224,104.18
等于：本金	7,224,026.22
加：应计利息	77.96
合计	8,941,101.10

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		59,342,453.59	-	62,695,554.93	3,353,101.34
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	59,342,453.59	-	62,695,554.93	3,353,101.34

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	101.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,391.88
合计	73,493.00

6.4.7.7 实收基金

易方达高质量增长量化精选股票 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	74,399,207.60	74,399,207.60

本期申购	5,508,604.87	5,508,604.87
本期赎回（以“-”号填列）	-38,822,922.92	-38,822,922.92
本期末	41,084,889.55	41,084,889.55

易方达高质量增长量化精选股票 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	64,454,098.71	64,454,098.71
本期申购	4,249,072.83	4,249,072.83
本期赎回（以“-”号填列）	-47,753,631.78	-47,753,631.78
本期末	20,949,539.76	20,949,539.76

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

易方达高质量增长量化精选股票 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	-3,135,510.17	2,312,515.67	-822,994.50
本期期初	-3,135,510.17	2,312,515.67	-822,994.50
本期利润	9,651,391.17	-4,301,508.86	5,349,882.31
本期基金份额交易产生的变动数	-423,039.26	-745,021.36	-1,168,060.62
其中：基金申购款	481,423.00	-148,990.33	332,432.67
基金赎回款	-904,462.26	-596,031.03	-1,500,493.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,092,841.74	-2,734,014.55	3,358,827.19

易方达高质量增长量化精选股票 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	-3,583,473.34	2,138,095.83	-1,445,377.51
本期期初	-3,583,473.34	2,138,095.83	-1,445,377.51
本期利润	7,195,686.63	-3,153,216.29	4,042,470.34
本期基金份额交易产生的变动数	-878,365.55	-297,044.65	-1,175,410.20
其中：基金申购款	72,399.99	54,088.74	126,488.73
基金赎回款	-950,765.54	-351,133.39	-1,301,898.93

本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,733,847.74	-1,312,165.11	1,421,682.63

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	5,546.47
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,287.76
结算备付金利息收入	-
其他	0.04
合计	7,834.27

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	16,994,432.49
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	16,994,432.49

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	173,823,156.84
减：卖出股票成本总额	156,542,493.68
减：交易费用	286,230.67
买卖股票差价收入	16,994,432.49

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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	694,353.89
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	694,353.89

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	-7,454,725.15
——股票投资	-7,454,725.15
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——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	-7,454,725.15

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	12,837.08
合计	12,837.08

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	13,884.51
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,583.07
港股通证券组合费	964.80

银行间账户维护费	9,000.00
合计	85,939.75

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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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	589,234.74	1,035,180.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	243,656.18	385,031.17
应支付基金管理人的净管理费	345,578.56	650,148.88

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

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	98,205.75	172,529.91

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

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		
	易方达高质量增长量化精选股票A	易方达高质量增长量化精选股票C	合计
易方达基金管理有限公司	-	1,497.62	1,497.62

招商银行	-	8,269.10	8,269.10
易方达财富	-	40.61	40.61
合计	-	9,807.33	9,807.33
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		
	易方达高质量增长量化精选股票A	易方达高质量增长量化精选股票C	合计
易方达基金管理有限公司	-	52,616.21	52,616.21
招商银行	-	16,061.51	16,061.51
合计	-	68,677.72	68,677.72

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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

易方达高质量增长量化精选股票 A

无。

易方达高质量增长量化精选股票 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	1,716,996.92	5,546.47	3,660,385.29	8,202.37

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

易方达高质量增长量化精选股票 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达高质量增长量化精选股票 C

本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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

标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(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	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

合计	0.00	0.00
----	------	------

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	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。本基金可通过港股通投资香港市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。香港证券市场每日证券交易价格并无涨跌幅限制，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

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	8,941,101.10	-	-	-	8,941,101.10
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	62,695,554.93	62,695,554.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,501,557.08	1,501,557.08
应收股利	-	-	-	89,775.09	89,775.09
应收申购款	-	-	-	55,441.20	55,441.20
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,941,101.10	-	-	64,342,328.30	73,283,429.40
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	-	-	-	6,301,875.39	6,301,875.39
应付管理人报酬	-	-	-	71,800.12	71,800.12
应付托管费	-	-	-	11,966.67	11,966.67
应付销售服务费	-	-	-	9,355.09	9,355.09
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	-	-	-	73,493.00	73,493.00
负债总计	-	-	-	6,468,490.27	6,468,490.27
利率敏感度缺口	8,941,101.10	-	-	57,873,838.03	66,814,939.13
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	12,997,560.95	-	-	-	12,997,560.95
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	122,878,761.27	122,878,761.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	7,316,776.19	7,316,776.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,065.45	9,065.45
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,997,560.95	-	-	130,204,602.91	143,202,163.86
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	-	-	-	6,276,555.11	6,276,555.11
应付管理人报酬	-	-	-	144,912.44	144,912.44
应付托管费	-	-	-	24,152.08	24,152.08
应付销售服务费	-	-	-	23,279.01	23,279.01
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	-	-	-	148,330.92	148,330.92
负债总计	-	-	-	6,617,229.56	6,617,229.56
利率敏感度缺口	12,997,560.95	-	-	123,587,373.35	136,584,934.30

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2026年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	15,206,202.61	-	15,206,202.61
资产合计	-	15,206,202.61	-	15,206,202.61
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	15,206,202.61	-	15,206,202.61
项目	上年度末			
	2025年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	34,977,683.15	-	34,977,683.15
资产合计	-	34,977,683.15	-	34,977,683.15
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	34,977,683.15	-	34,977,683.15

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变	
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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-760,310.13	-1,748,884.16
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	760,310.13	1,748,884.16

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	62,695,554.93	93.83	122,878,761.27	89.97
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	62,695,554.93	93.83	122,878,761.27	89.97

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%	3,687,973.81	7,228,162.43
	2.业绩比较基准下降 5%	-3,687,973.81	-7,228,162.43

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	62,685,444.93
第二层次	10,110.00
第三层次	-
合计	62,695,554.93

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	62,695,554.93	85.55
	其中：股票	62,695,554.93	85.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	8,941,101.10	12.20
8	其他各项资产	1,646,773.37	2.25
9	合计	73,283,429.40	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 15,206,202.61 元，占净值比例 22.76%。

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

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	-	-
B	采矿业	5,600,669.00	8.38
C	制造业	32,174,967.95	48.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,110.00	0.02
E	建筑业	46.92	0.00
F	批发和零售业	2,066,570.00	3.09
G	交通运输、仓储和邮政业	2,458,229.00	3.68

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,012,104.05	3.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,383,121.40	3.57
N	水利、环境和公共设施管理业	783,534.00	1.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	47,489,352.32	71.08

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	29,461.22	0.04
材料	1,042,525.78	1.56
工业	1,019,782.80	1.53
非必需消费品	2,466,465.75	3.69
必需消费品	642,393.47	0.96
保健	1,691,468.11	2.53
金融	3,799,830.72	5.69
信息技术	1,692,386.17	2.53
电信服务	1,798,648.09	2.69
公用事业	385,809.91	0.58
房地产	637,430.59	0.95
合计	15,206,202.61	22.76

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 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	2,200	2,794,000.00	4.18
2	603259	药明康德	19,140	2,383,121.40	3.57
2	02359	药明康德	2,500	333,740.34	0.50
3	601899	紫金矿业	75,900	1,908,126.00	2.86

3	02899	紫金矿业	16,000	380,772.32	0.57
4	600519	贵州茅台	1,900	2,252,431.00	3.37
5	601138	工业富联	30,800	2,222,220.00	3.33
6	300750	宁德时代	5,380	2,114,393.80	3.16
7	002463	沪电股份	12,900	1,971,120.00	2.95
8	300857	协创数据	5,100	1,733,490.00	2.59
9	001309	德明利	1,800	1,697,220.00	2.54
10	300475	香农芯创	5,600	1,680,000.00	2.51
11	00700	腾讯控股	4,500	1,679,862.56	2.51
12	603993	洛阳钼业	74,600	1,309,230.00	1.96
12	03993	洛阳钼业	18,000	237,322.60	0.36
13	301308	江波龙	2,001	1,408,303.80	2.11
14	600150	中国船舶	38,800	1,311,052.00	1.96
15	09988	阿里巴巴-W	16,100	1,298,382.37	1.94
16	600549	厦门钨业	15,200	1,295,040.00	1.94
17	001389	广合科技	4,400	1,043,900.00	1.56
18	688002	睿创微纳	6,154	951,962.26	1.42
19	601872	招商轮船	52,900	929,453.00	1.39
20	300037	新宙邦	9,600	891,360.00	1.33
21	301377	鼎泰高科	1,600	881,440.00	1.32
22	01299	友邦保险	13,200	819,164.25	1.23
23	688111	金山办公	3,661	779,976.05	1.17
24	000807	云铝股份	35,100	777,114.00	1.16
25	605117	德业股份	7,300	775,114.00	1.16
26	000408	藏格矿业	10,814	749,626.48	1.12
27	688411	海博思创	2,568	747,801.60	1.12
28	002558	巨人网络	26,500	730,340.00	1.09
29	00388	香港交易所	2,300	725,152.40	1.09
30	600489	中金黄金	38,700	698,535.00	1.05
31	688578	艾力斯	6,117	667,976.40	1.00
32	000703	恒逸石化	48,200	654,074.00	0.98
33	600026	中远海能	35,900	644,046.00	0.96
34	600426	华鲁恒升	24,400	583,648.00	0.87
35	601958	金钼股份	20,600	579,066.00	0.87
36	688036	传音控股	9,741	574,231.95	0.86
37	600988	赤峰黄金	21,600	568,512.00	0.85
38	000975	山金国际	31,600	537,200.00	0.80
39	002532	天山铝业	49,200	527,916.00	0.79
40	00981	中芯国际	6,500	504,714.41	0.76
41	603444	吉比特	1,400	501,788.00	0.75
42	600233	圆通速递	30,000	472,500.00	0.71
43	000895	双汇发展	20,500	459,200.00	0.69
44	002266	浙富控股	88,700	448,822.00	0.67
45	06160	百济神州	3,000	444,002.76	0.66

46	000739	普洛药业	25,300	421,498.00	0.63
47	603345	安井食品	5,200	416,988.00	0.62
48	000429	粤高速 A	30,200	412,230.00	0.62
49	688617	惠泰医疗	2,256	409,599.36	0.61
50	600535	天士力	29,800	394,254.00	0.59
51	603939	益丰药房	21,500	386,570.00	0.58
52	01810	小米集团－W	20,200	379,667.52	0.57
53	002568	百润股份	21,800	368,856.00	0.55
54	02269	药明生物	12,000	360,621.96	0.54
55	301606	绿联科技	5,900	360,018.00	0.54
56	00005	汇丰控股	2,800	359,683.93	0.54
57	002032	苏泊尔	9,000	356,400.00	0.53
58	600132	重庆啤酒	8,400	346,920.00	0.52
59	600292	电投水电	27,800	334,712.00	0.50
60	01579	颐海国际	27,000	298,529.32	0.45
61	02628	中国人寿	12,000	277,866.52	0.42
62	00522	ASMPT	1,300	269,632.66	0.40
63	02228	晶泰控股	38,000	252,487.49	0.38
64	02319	蒙牛乳业	18,000	251,549.45	0.38
65	00753	中国国航	64,000	235,689.73	0.35
66	01055	中国南方航空股份	80,000	235,550.76	0.35
67	06049	保利物业	10,400	232,688.02	0.35
68	00968	信义光能	128,000	229,019.26	0.34
69	01888	建滔积层板	2,500	215,291.83	0.32
70	09880	优必选	2,400	214,288.66	0.32
71	01211	比亚迪股份	3,400	213,949.92	0.32
72	02318	中国平安	4,500	199,527.65	0.30
73	03690	美团－W	3,300	196,335.73	0.29
74	01336	新华保险	4,900	195,856.29	0.29
75	01818	招金矿业	13,000	185,061.95	0.28
76	03908	中金公司	10,000	182,395.50	0.27
77	02669	中海物业	65,000	182,352.07	0.27
78	00257	光大环境	44,000	174,265.87	0.26
79	03931	中创新航	8,500	173,049.90	0.26
80	00966	中国太平	11,000	172,163.98	0.26
81	01288	农业银行	37,000	171,608.11	0.26
82	01816	中广核电力	73,000	169,923.12	0.25
83	03988	中国银行	39,000	169,028.52	0.25
84	03320	华润医药	45,500	167,560.67	0.25
85	01398	工商银行	30,000	167,543.30	0.25
86	02331	李宁	13,000	166,205.73	0.25
87	01972	太古地产	9,200	164,128.16	0.25
88	01658	邮储银行	41,000	162,740.21	0.24

89	00998	中信银行	28,000	161,724.01	0.24
90	01772	赣锋锂业	3,600	157,277.03	0.24
91	00902	华能国际电力股份	32,000	152,308.93	0.23
92	00669	创科实业	1,000	112,477.23	0.17
93	01801	信达生物	1,000	69,136.58	0.10
94	00002	中电控股	1,000	63,577.86	0.10
95	02020	安踏体育	1,000	61,710.48	0.09
96	01024	快手—W	1,700	61,423.86	0.09
97	00175	吉利汽车	4,000	58,575.01	0.09
98	09987	百胜中国	200	55,517.72	0.08
99	09992	泡泡玛特	400	53,745.87	0.08
100	02423	贝壳—W	1,200	39,147.29	0.06
101	09868	小鹏集团—W	800	35,193.65	0.05
102	01378	中国宏桥	2,000	34,846.23	0.05
103	09633	农夫山泉	1,000	34,411.95	0.05
104	00857	中国石油股份	4,000	29,461.22	0.04
105	02382	舜宇光学科技	500	26,490.78	0.04
106	02057	中通快递—W	150	22,356.48	0.03
107	01530	三生制药	1,500	22,004.71	0.03
108	00300	美的集团	300	21,522.67	0.03
109	02099	中国黄金国际	200	21,279.48	0.03
110	09626	哔哩哔哩—W	180	20,589.85	0.03
111	06618	京东健康	700	19,966.23	0.03
112	01177	中国生物制药	5,000	19,151.53	0.03
113	01209	华润万象生活	600	19,115.05	0.03
114	02018	瑞声科技	500	18,543.54	0.03
115	02888	渣打集团	100	18,378.52	0.03
116	01928	金沙中国有限公司	1,600	18,135.32	0.03
117	00241	阿里健康	6,000	16,050.80	0.02
118	09863	零跑汽车	500	14,973.80	0.02
119	00780	同程旅行	1,200	12,496.70	0.02
120	00425	敏实集团	500	11,473.55	0.02
121	02618	京东物流	1,100	11,226.01	0.02
122	605499	东鹏饮料	90	11,108.70	0.02
123	09660	地平线机器人—W	3,000	10,631.05	0.02
124	00136	中国儒意	8,000	10,353.12	0.02
125	00268	金蝶国际	2,000	10,283.63	0.02
126	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.02
127	06862	海底捞	1,000	9,224.00	0.01
128	02367	巨子生物	400	9,206.63	0.01
129	00285	比亚迪电子	500	9,085.03	0.01

130	02525	禾赛-W	80	9,005.13	0.01
131	09896	名创优品	400	8,192.16	0.01
132	02400	心动公司	200	7,730.10	0.01
133	03888	金山软件	400	7,705.78	0.01
134	02259	紫金黄金国际	100	7,686.67	0.01
135	01929	周大福	800	7,573.76	0.01
136	03998	波司登	2,000	7,434.79	0.01
137	01787	山东黄金	500	7,252.39	0.01
138	02282	美高梅中国	800	7,045.68	0.01
139	06690	海尔智家	400	6,941.45	0.01
140	03939	万国黄金集团	1,000	6,757.32	0.01
141	01357	美图公司	2,000	6,514.13	0.01
142	06682	范式智能	300	6,222.29	0.01
143	06855	亚盛医药	200	5,767.17	0.01
144	01128	永利澳门	1,200	5,263.41	0.01
145	02611	国泰海通	400	5,159.19	0.01
146	09688	再鼎医药	400	5,023.69	0.01
147	03759	康龙化成	300	4,755.31	0.01
148	06060	众安在线	600	4,690.17	0.01
149	02050	三花智控	200	4,592.89	0.01
150	09899	网易云音乐	50	4,468.69	0.01
151	09690	途虎-W	400	4,412.23	0.01
152	03330	灵宝黄金	400	4,269.79	0.01
153	01833	平安好医生	700	4,243.74	0.01
154	09973	奇瑞汽车	200	4,228.10	0.01
155	03738	阜博集团	2,000	3,995.33	0.01
156	00763	中兴通讯	200	3,967.54	0.01
157	02498	速腾聚创	200	3,859.84	0.01
158	09985	卫龙美味	600	3,746.92	0.01
159	002595	豪迈科技	80	3,728.00	0.01
160	02208	金风科技	400	3,654.86	0.01
161	01910	新秀丽	300	3,548.90	0.01
162	02313	申洲国际	100	3,418.61	0.01
163	01788	国泰君安国际	2,000	3,404.72	0.01
164	02276	康耐特光学	100	2,728.98	0.00
165	09636	九方智投控股	100	2,657.76	0.00
166	06979	珍酒李渡	400	2,539.64	0.00
167	00880	澳博控股	2,000	2,536.17	0.00
168	02273	固生堂	100	2,239.12	0.00
169	00460	四环医药	2,000	1,441.79	0.00
170	02517	锅圈	800	1,306.30	0.00
171	09699	顺丰同城	200	1,268.08	0.00
172	02858	易鑫集团	1,000	1,085.69	0.00
173	02013	微盟集团	1,000	981.46	0.00

174	01610	中粮家佳康	1,000	842.49	0.00
175	603606	东方电缆	20	830.20	0.00
176	02158	医渡科技	200	806.01	0.00
177	02555	茶百道	200	785.17	0.00
178	688183	生益电子	1	132.40	0.00
179	600039	四川路桥	6	46.92	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	600519	贵州茅台	2,741,257.00	2.01
2	603993	洛阳钼业	1,634,598.00	1.20
2	03993	洛阳钼业	779,862.97	0.57
3	02899	紫金矿业	1,240,455.35	0.91
3	601899	紫金矿业	649,328.00	0.48
4	000708	中信特钢	1,626,708.00	1.19
5	600150	中国船舶	1,615,251.00	1.18
6	300857	协创数据	1,480,353.00	1.08
7	001389	广合科技	1,454,416.00	1.06
8	002050	三花智控	1,432,412.00	1.05
8	02050	三花智控	14,327.13	0.01
9	01810	小米集团－W	1,310,132.59	0.96
10	600329	达仁堂	1,295,279.00	0.95
11	301308	江波龙	1,277,392.60	0.94
12	000807	云铝股份	1,236,901.00	0.91
13	001309	德明利	1,231,938.00	0.90
14	600026	中远海能	847,992.00	0.62
14	01138	中远海能	379,798.74	0.28
15	01299	友邦保险	1,209,884.23	0.89
16	02359	药明康德	685,909.67	0.50
16	603259	药明康德	520,184.00	0.38
17	300475	香农芯创	1,160,624.00	0.85
18	03690	美团－W	1,088,471.10	0.80
19	600989	宝丰能源	1,082,204.00	0.79
20	601958	金钼股份	1,057,343.00	0.77

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	300502	新易盛	8,148,674.00	5.97
2	601318	中国平安	4,505,153.00	3.30
2	02318	中国平安	2,749,950.98	2.01
3	300308	中际旭创	5,794,085.00	4.24
4	002475	立讯精密	5,458,918.00	4.00
5	00700	腾讯控股	5,354,212.63	3.92
6	300394	天孚通信	4,848,748.00	3.55
7	300274	阳光电源	4,189,448.00	3.07
8	600183	生益科技	4,020,809.00	2.94
9	601899	紫金矿业	3,167,258.00	2.32
9	02899	紫金矿业	676,555.08	0.50
10	300059	东方财富	3,834,283.00	2.81
11	09988	阿里巴巴-W	3,750,301.64	2.75
12	603259	药明康德	2,902,364.00	2.12
12	02359	药明康德	483,602.35	0.35
13	02269	药明生物	3,196,550.95	2.34
14	300750	宁德时代	3,092,031.00	2.26
15	01055	中国南方航空股份	3,048,348.92	2.23
16	00753	中国国航	2,882,339.45	2.11
17	601138	工业富联	2,799,774.00	2.05
18	600989	宝丰能源	2,761,669.00	2.02
19	002916	深南电路	2,734,538.00	2.00
20	001389	广合科技	2,560,906.00	1.87

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	103,814,012.49
卖出股票收入（成交）总额	173,823,156.84

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	1,501,557.08
3	应收股利	89,775.09
4	应收利息	-
5	应收申购款	55,441.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,646,773.37

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达高质量增长量化精选股票 A	1,661	24,735.03	220,273.04	0.54%	40,864,616.51	99.46%
易方达高质量增长量化精选股票 C	645	32,479.91	11,846,398.68	56.55%	9,103,141.08	43.45%
合计	2,306	26,901.31	12,066,671.72	19.45%	49,967,757.59	80.55%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	96.24%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 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	易方达高质量增长量化精选股票 A	714,223.59	1.7384%
	易方达高质量增长量化精选股票 C	100.10	0.0005%
	合计	714,323.69	1.1515%

8.4 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	易方达高质量增长量化精选股票 A	0
	易方达高质量增长量化精选股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达高质量增长量化精选股票 A	50~100
	易方达高质量增长量化精选股票 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达高质量增长量化精选股票 A	易方达高质量增长量化精选股票 C
基金合同生效日（2022 年 5 月 6 日）基金份额总额	325,278,052.64	142,554,973.79
本报告期期初基金份额总额	74,399,207.60	64,454,098.71
本报告期基金总申购份额	5,508,604.87	4,249,072.83
减：本报告期基金总赎回份额	38,822,922.92	47,753,631.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,084,889.55	20,949,539.76

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	
华西证券	3	277,627,059.33	100.00%	97,173.37	100.00%	-

注：a）本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》中关于交易佣金分仓的规定。

b）本基金选择的证券经纪商为华西证券股份有限公司。本基金管理人与华西证券股份有限公司不存在关联方关系。

c）本报告期本基金的平均佣金费率为：股票 0.03500%。

d）本基金管理人负责选择证券经营机构，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。

e) 本报告期内基金的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经纪服务协议。

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
华西证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售(广州)有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2026-01-22
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-21
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
7	关于易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金 2026 年因港股通不提供服务暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
8	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 7 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
9	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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网	2026-03-31

	度)	站	
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报	2026-03-31
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2026-04-22
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
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	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23
18	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026 年 01 月 01 日~2026 年 06 月 29 日	42,264,193.78	0.00	30,538,102.87	11,726,090.91	18.90 %
产品特有风险							
报告期内, 本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况, 由此可能导致的特有风险主要包括: 当投资者持有份额占比较为集中时, 个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响; 极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请, 可能带来流动性风险; 如个别投资者大额赎回引发巨额赎回, 基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请, 可能影响投资者赎回业务办理; 若个别投资者大额赎回后本基							

金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金变更注册的文件；
- 2.《易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达高质量增长量化精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日