易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	318,078,890.83 份
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。	
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	
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	317,612,966.19 份	465,924.64 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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 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
1.本期已实现收益	-18,783,792.64	-6,082.78
2.本期利润	-97,226,441.96	-70,432.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3105	-0.2947
4.期末基金资产净值	983,882,500.19	1,446,346.07
5.期末基金份额净值	3.0977	3.1042

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	净值增长率①	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	-9.29%	1.27%	-11.88%	1.22%	2.59%	0.05%
过去六个月	1.38%	1.22%	-1.92%	1.22%	3.30%	0.00%
过去一年	0.78%	1.08%	-5.72%	1.08%	6.50%	0.00%
过去三年	29.68%	1.11%	17.46%	1.09%	12.22%	0.02%
过去五年	-4.30%	1.11%	-9.55%	1.07%	5.25%	0.04%
过去七年	30.08%	1.17%	14.26%	1.12%	15.82%	0.05%
过去十年	76.15%	1.13%	33.28%	1.10%	42.87%	0.03%
自基金合同生效起至今	209.77%	1.29%	74.65%	1.26%	135.12%	0.03%

易方达沪深 300 量化增强 Y

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

		②	率③	率标准差④		
过去三个月	-9.18%	1.27%	-11.88%	1.22%	2.70%	0.05%
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	-5.53%	1.24%	-8.20%	1.24%	2.67%	0.00%

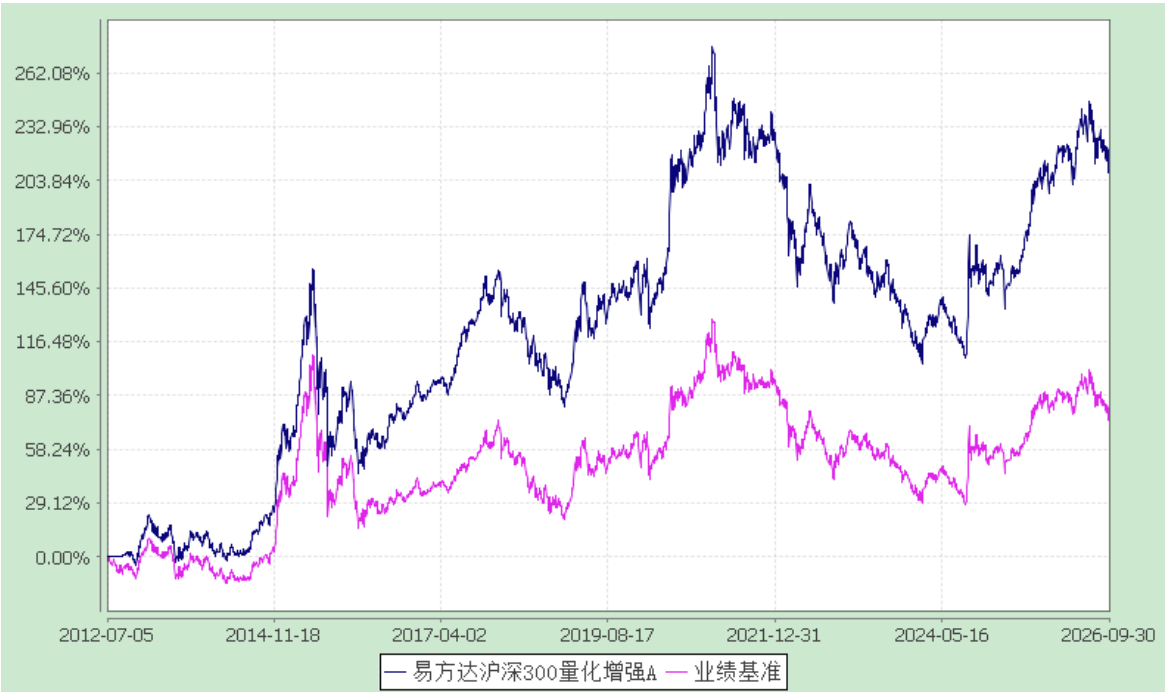
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

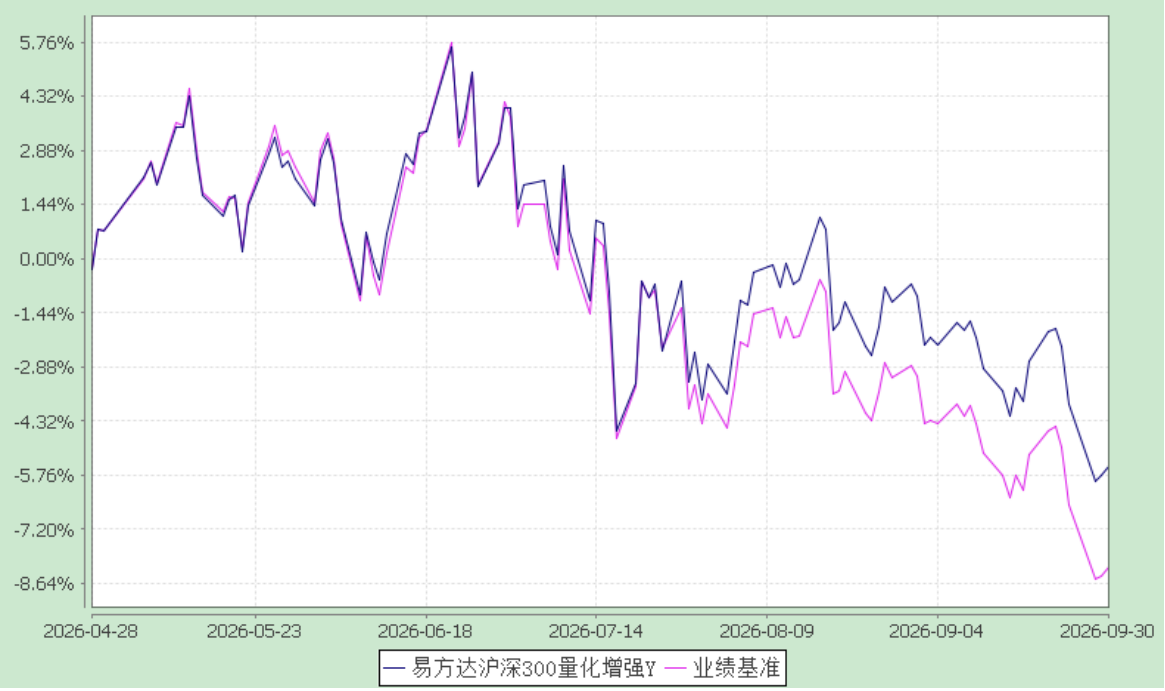
易方达沪深 300 量化增强 A

（2012 年 7 月 5 日至 2026 年 9 月 30 日）



易方达沪深 300 量化增强 Y

（2026 年 4 月 28 日至 2026 年 9 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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 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（自 2025 年 04 月 24 日至 2026 年 07 月 09 日）、易方达高股息量化选股股票发起式（自 2025 年	2021-09-04	2026-07-04	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

	05 月 07 日至 2026 年 07 月 03 日）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				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、易方达量化策略精选混合的基金经理。
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，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 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	1	48,216,145.41	2022-09-23
	私募资产管理计划	5	9,839,086,524.40	2019-07-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	6	9,887,302,669.81	-

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3只公募基金已离任。根据相关公告，自2026年7月4日起，王建军不再担任易方达高股息量化选股股票型发起式证券投资基金、易方达沪深300量化增强证券投资基金的基金经理；自2026年7月10日起，王建军不再担任易方达上证科创板100增强策略交易型开放式指数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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 公平交易专项说明

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 62 次，其中 59 次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，3 次为不同投资经理管理的组合因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾本报告期，国内经济运行总体平稳，经济结构持续优化，新兴技术产业的增速高于传统经济，新旧动能转换初见成效。生产端，8 月全国规模以上工业增加值同比增长 5.2%，其中高技术制造业增加值增速达 16.7%，明显高于整体工业，显示出结构上的优势。需求端修复相对偏弱，8 月社会消费品零售总额同比增长 0.4%；1-8 月固定资产投资完成额累计同比下降 7.2%，其中房地产开发投资累计同比下降 19.9%，仍是主要拖累因素。

在经济基本面偏弱、市场风险偏好回落的背景下，三季度 A 股主要指数普遍下跌，上证指数下跌 6.16%，沪深 300 指数下跌 12.49%，中证 500 指数下跌 17.67%，创业板指数下跌 27.80%。从行业表现来看，煤炭、石油石化、农林牧渔等资源板块和银行等防御性板块表现较好，电子、通信、电力设备、建筑材料等成长制造板块跌幅居前。从市场风格来看，价值风格表现好于成长风格，

大盘风格优于小盘风格。

报告期内，作为量化指数增强型基金，本基金严格遵照量化指数增强的投资模式进行操作，一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面坚持基本面量化投资的投资理念和投资方法，配置基本面量化优选且性价比占优的标的，积极调整投资组合，力求在跟踪指数的基础上实现超越业绩比较基准的投资回报。

4.5 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 3.0977 元，本报告期份额净值增长率为-9.29%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%；Y 类基金份额净值为 3.1042 元，本报告期份额净值增长率为-9.18%，同期业绩比较基准收益率为-11.88%。年化跟踪误差 2.48%，在合同约定的目标控制范围之内。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	924,877,141.74	93.36
	其中：股票	924,877,141.74	93.36
2	固定收益投资	1,418,818.96	0.14
	其中：债券	1,418,818.96	0.14
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	63,566,523.10	6.42
7	其他资产	808,635.96	0.08
8	合计	990,671,119.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1积极投资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	172,313.00	0.02
B	采矿业	3,920,047.16	0.40
C	制造业	104,000,852.69	10.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,693,754.00	0.58
E	建筑业	1,338,409.00	0.14
F	批发和零售业	1,371,327.88	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	755,373.48	0.08
H	住宿和餐饮业	23,465.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,663,140.25	0.57
J	金融业	18,788,321.32	1.91
K	房地产业	1,650,145.00	0.17
L	租赁和商务服务业	327,914.60	0.03
M	科学研究和技术服务业	3,958,660.73	0.40
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	109,168.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	47,807.00	0.00
S	综合	3,802.00	0.00
	合计	147,824,501.11	15.00

5.2.1.2指数投资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	203,298.00	0.02
B	采矿业	41,778,286.40	4.24
C	制造业	435,107,674.10	44.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,402,716.18	2.07
E	建筑业	4,137,036.42	0.42
F	批发和零售业	1,339,772.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	15,049,619.66	1.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,782,783.73	4.04
J	金融业	187,056,804.14	18.98
K	房地产业	4,362,455.00	0.44
L	租赁和商务服务业	2,947,852.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	23,477,802.00	2.38
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	1,258,446.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	148,095.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	777,052,640.63	78.86

5.3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

5.3.1 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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	45,380	36,687,007.20	3.72

2	600519	贵州茅台	24,277	30,555,517.74	3.10
3	601318	中国平安	497,688	26,521,793.52	2.69
4	300750	宁德时代	85,987	25,031,675.57	2.54
5	300502	新易盛	64,084	24,928,676.00	2.53
6	603259	药明康德	140,300	23,477,802.00	2.38
7	600036	招商银行	360,647	14,880,295.22	1.51
8	601899	紫金矿业	444,074	13,228,964.46	1.34
9	600030	中信证券	499,575	12,919,009.50	1.31
10	688256	寒武纪	11,537	11,640,948.37	1.18

5.3.2 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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	688825	长鑫科技	163,864	6,688,697.98	0.68
2	002078	太阳纸业	246,200	3,372,940.00	0.34
3	600256	广汇能源	473,700	3,159,579.00	0.32
4	600409	三友化工	471,600	2,905,056.00	0.29
5	601665	齐鲁银行	402,000	2,866,260.00	0.29

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,418,718.96	0.14
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）	100.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	1,418,818.96	0.14

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	102317	国债 2519	14,000	1,418,718.96	0.14
2	123288	隆新转债	1	100.00	0.00

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 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。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到苏尼特左旗应急管理局的处罚。

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。

5.11.2 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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）

1	存出保证金	93,542.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	715,093.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	808,635.96

5.11.4报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688825	长鑫科技	5,482,386.55	0.56	新股流通受限

§6 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
报告期期初基金份额总额	285,408,558.94	109,709.93
报告期期间基金总申购份额	58,594,229.33	429,923.74
减：报告期期间基金总赎回份额	26,389,822.08	73,709.03
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

报告期期末基金份额总额	317,612,966.19	465,924.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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
报告期期初管理人持有的本基金份额	16,318,489.99	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	16,318,489.99	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	5.1379	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

9.3 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

二〇二六年十月二十七日