

易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基 金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年三月三十一日

§ 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 9 月 10 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6	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	69
8.7	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	69
8.8	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	69
8.9	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	69
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12	投资组合报告附注	69
§ 9	基金份额持有人信息	70
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2	期末上市基金前十名持有人	70
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.4	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	71
§ 10	开放式基金份额变动	71
§ 11	重大事件揭示	71
11.1	基金份额持有人大会决议	71
11.2	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	71
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4	基金投资策略的改变	72
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	72
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8	其他重大事件	76
§ 12	备查文件目录	77
12.1	备查文件目录	77
12.2	存放地点	77
12.3	查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 A500 增强策略 ETF
场内简称	A500 增强、A500 增强 ETF 易方达
基金主代码	563600
交易代码	563600
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 9 月 10 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	60,483,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 9 月 26 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 股票（含存托凭证）投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报，在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优选股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。 此外，为更好地实现投资目标，本基金将综合考虑流动性和收益性，适当

	参与债券和货币市场工具的投资。同时，本基金可投资股指期货、国债期货和股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
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、债券型基金与货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路 21号52层；广东省广州市天河 区珠江东路30号42层；广东省 珠海市横琴新区荣粤道188号6 层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510627；510623；519031	100818
法定代表人		吴欣荣	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
----------------	------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	4,100,754.29
本期利润	5,564,352.31
加权平均基金份额本期利润	0.0464
本期加权平均净值利润率	4.59%
本期基金份额净值增长率	3.79%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	2,153,712.18
期末可供分配基金份额利润	0.0356
期末基金资产净值	62,775,304.44
期末基金份额净值	1.0379
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	3.79%

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。

4.本基金合同于 2025 年 9 月 10 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

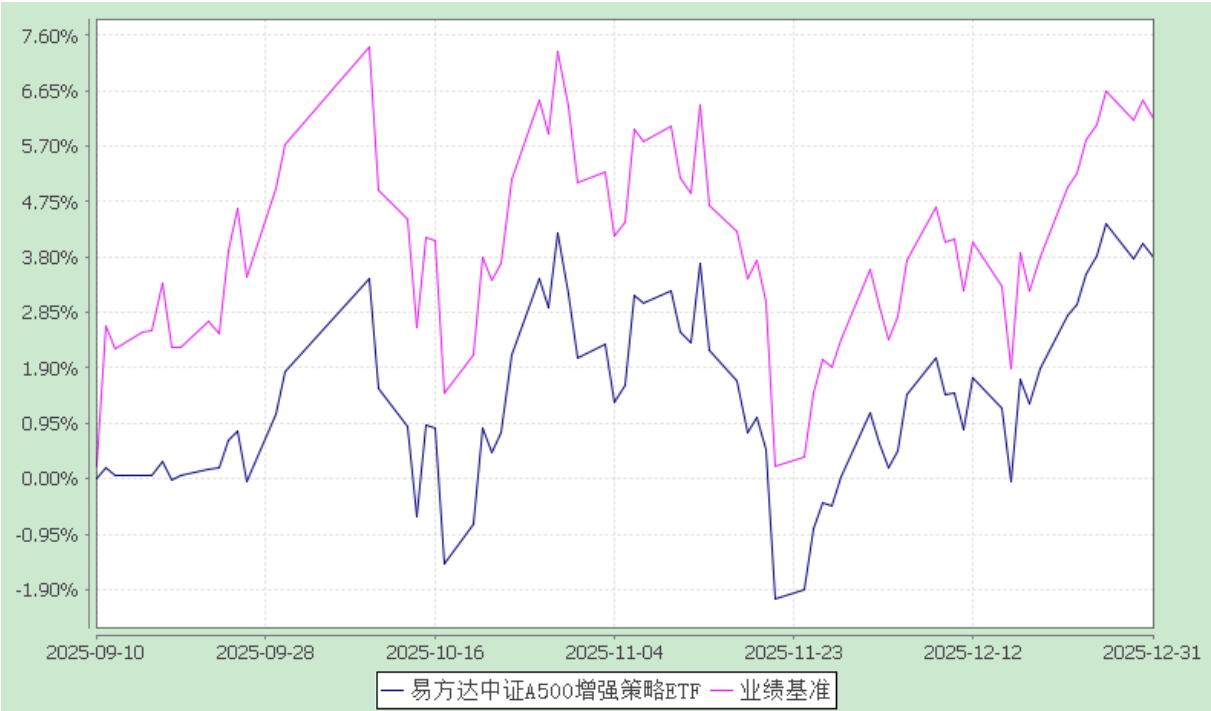
	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	1.91%	0.98%	0.43%	1.05%	1.48%	-0.07%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	3.79%	0.89%	6.18%	1.04%	-2.39%	-0.15%

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

易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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

(2025 年 9 月 10 日至 2025 年 12 月 31 日)



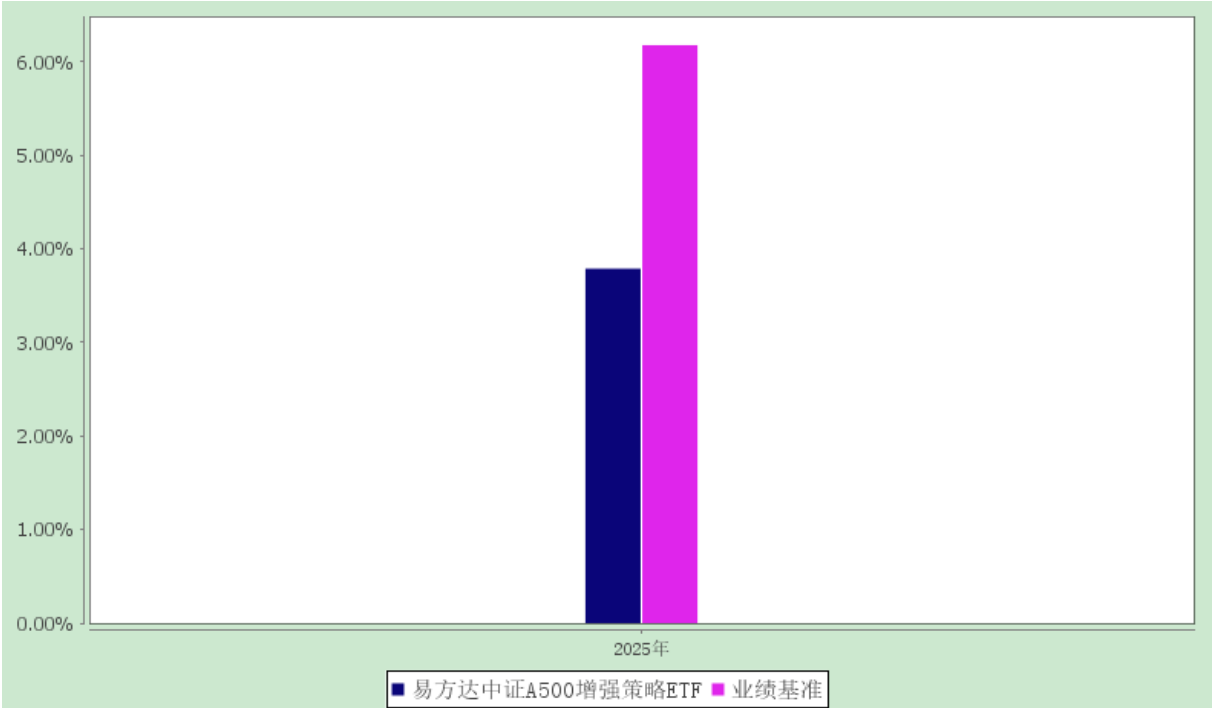
注：1.本基金合同于 2025 年 9 月 10 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 10 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2025 年 9 月 10 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 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		
黄浩东	本基金的基金经理，易方达量化策略精选混合、易方达中证 A500 量化增强的基金经理	2025-09-10	-	5 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量化研究员。
李博扬	本基金的基金经理助理，易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证龙头企业指数、易方达上证 180ETF、易方达上证 180ETF 联接、易方达上证科创板综合 ETF、易方达上证科创板人工智能 ETF 联接、易方达上证科创板 200ETF、易方达中证消费电子主题 ETF 联接发起式、易方达创业板 50ETF、易方达上证科创板新能源 ETF、易方达上证科创板 200ETF 联接、易方达上证 580ETF、易方达上证 580ETF 联接、易方达创业板 50ETF 联接的基金经理，易方达恒生 ETF（QDII）、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证沪深港黄金产业股票指数发起式、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证消费电子主题 ETF 联接发起式（自 2024 年 12 月 14 日至 2025 年 04 月 28 日）、易方达中证生物科技主题 ETF（自 2024 年 12 月 14 日至 2025 年 04 月 28 日）、易方达上证科创板综合 ETF 联接、易方达中证数字经济主题 ETF、易方达上证科创板综合增强策略 ETF 的基金经理助理	2025-09-30	-	5 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任南方基金管理股份有限公司量化交易员、量化及指数研究员，易方达基金管理有限公司研究员。
刘越洲	本基金的基金经理助理，易方达中证电信主题 ETF、易方达中证电信主题 ETF 联接发起式、易方达中证新能源 ETF 联接发起式、易方达中证新能源 ETF、易方达中证石化产业 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式、易方达中证石化产业 ETF、易方达中证沪港深 500ETF、易方达中小企业 100	2025-09-30	-	5 年	硕士研究生，具有基金从业资格。

	指数（LOF）的基金经理，易方达中证沪港深 500ETF（自 2025 年 07 月 12 日至 2025 年 11 月 28 日）、易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式（自 2025 年 08 月 16 日至 2025 年 11 月 28 日）、易方达中证家电龙头 ETF、易方达中证稀土产业 ETF 的基金经理助理，研究员				
徐德晖	本基金的基金经理助理，易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF 的基金经理助理，量化研究员	2025-09-30	-	8 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指数与量化研究员。

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。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中

交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序 and 分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 94 次，其中 80 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，14 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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 2025 全年，国内宏观经济在复杂外部环境与内部结构调整下，呈现“稳中有进、边际改善、结构分化、动能转换”态势，经济复苏虽有波折，但政策协同发力、新旧动能转换贯穿全年，整体展现出较强韧性。生产端韧性凸显，结构持续优化，制造业 PMI 呈现“回升—微调—复苏”态势，但最终重回扩张区间。需求端呈现结构分化特征，消费市场稳步复苏：一季度以旧换新政策带动升级类商品回暖，二季度服务消费成为亮点，但三、四季度增速承压，居民消费信心仍需激发。投资总量承压但结构优化，高技术产业投资增速较快。政策层面协同发力，有效对冲不确定性。证监会推进新“国九条”，激发资本市场活力；三季度以来政策引导行业“反内卷”，推动企业从“价格战”转向“价

值战”，强化新质生产力培育支持。此外，全年 CPI 基本持平、PPI 降幅收窄，就业形势总体稳定，居民收入与经济增长基本同步。

从市场表现来看，2025 年宽基指数整体表现较好，其中上证指数收益率为 18.41%，沪深 300 指数收益率为 17.66%，中证 2000 指数收益率为 36.42%；成长风格的创业板指数收益率为 49.57%。从风格维度来看，全年小盘明显跑赢大盘，成长风格明显跑赢价值风格。

在投资策略上，我们使用多策略的方式来增强中证 A500 指数，策略致力于创造出相对中证 A500 指数稳健的超额收益。在投资策略的使用上，我们致力于底层策略的多元化，在争取提高每个策略超额收益的同时，尽可能使得策略之间保持一定的差异化，通过资金配置的方式来实现投资策略的分散化。展望未来，本基金将继续坚持模型驱动的投资理念，持续迭代投资模型，力争创造出稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0379 元，本报告期份额净值增长率为 3.79%，同期业绩比较基准收益率为 6.18%。年化跟踪误差 5.26%，在合同规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 2026 年，作为“十五五”开局之年，国内宏观经济将在政策协同发力与新质生产力加速赋能下，呈现“稳中向好、质效提升”的核心态势。宏观经济层面，政策“组合拳”将持续发力，成为内需激活与信心提振的核心支撑。财政政策更加积极有为，扩大支出规模、强化重点领域保障。行业走势方面，新质生产力相关赛道将迎来更多催化，延续 2025 年产业升级逻辑，形成“技术落地、规模化应用、政策加持”的三重利好格局。人形机器人产业进入产业化加速期，人工智能产业持续深化，高端装备制造、高技术制造业将持续领跑，新能源、半导体、数字经济等新质生产力相关领域，依托政策支持与技术突破，仍将保持高景气度，成为产业升级的核心引擎。在经济稳中向好、政策持续托底、外部流动性边际改善的多重利好叠加下，权益资产有望呈现“结构强势、稳步向好”的表现；流动性宽松环境将支撑估值修复，而产业催化与企业盈利改善或将成为行情核心驱动力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人紧扣公募基金行业高质量发展主线，根据法律法规、最新监管要求和业务发展需要，围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程，强化对法规和制度执行情况的监督检查，保障旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作情况如下：

（1）坚持投资者利益至上，大力培育良好的合规文化，严格落实从业人员廉洁从业、职业操守

和道德规范相关要求，积极探索合规文化宣贯新形式，组织面向全体员工及不同部门的合规专项培训、考试及承诺函签署等工作，引导员工将合规意识内化于心、外化于行，自觉践行“五要五不”的中国特色金融文化。

(2) 通过系统升级，进一步优化投资交易的日常监控机制，提升投前、投中和投后全链条的合规风控效能。投资合规部门与研究、投资、交易业务部门协同完善内部制度和流程，进一步明确业务执行规范。根据监管要求和业务发展情况，加强程序化交易执行监控，持续巩固公平交易和异常交易管控措施。

(3) 持续优化各类法律文件审核流程，强化全流程合规管控。坚持以投资者为本，积极推进浮动费率基金等创新产品开发论证，审慎评估各项新业务方案，保障公司各项业务稳妥有序开展，更好服务广大投资者财富管理需求。

(4) 严格遵守法律法规及监管规定，持续规范基金销售行为，强化对自媒体账号、社群运营等重点领域的合规管控。不断完善新型基金营销模式管控机制，支持创新业务与服务规范有序落地。积极探索运用数智化技术，开发宣传推介材料智能审核系统，提升合规审核效率。始终坚持以投资者利益为核心，健全投资者适当性管理长效机制，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的科学性与合理性。认真贯彻落实监管部门关于中小投资者保护工作要求，深入推进投诉溯源治理，妥善化解业务纠纷，切实维护投资者合法权益。

(5) 持续督促各部门落实法律法规、自律规则、基金法律文件中各项信息披露规定，优化完善相关制度流程；推进公司级信息披露平台和智能审核系统建设，深度探索人工智能技术在信息披露工作中的应用，以科技赋能有效应对持续增长的信息披露工作，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 深入贯彻落实新《反洗钱法》及配套法规制度要求，全面完善“基于风险”的洗钱风险管理体系，建立健全客户尽职调查和受益所有人识别机制，加强洗钱风险识别管控，推动科技赋能与数据治理，持续提升反洗钱工作有效性水平。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱、境内外子公司等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展年度内控评价、ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，全方位审视公司内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

容诚审字[2026]200Z1309 号

易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基

金管理人管理层计划清算易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

薛竞 周祎

北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2026 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	1,642,188.44
结算备付金		275,014.77
存出保证金		149,434.66
交易性金融资产	7.4.7.2	61,145,120.77
其中：股票投资		61,145,120.77
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		63,211,758.64

负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		75,332.70
应付赎回款		-
应付管理人报酬		29,573.13
应付托管费		5,914.63
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	7.4.7.6	325,633.74
负债合计		436,454.20
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	60,483,000.00
未分配利润	7.4.7.8	2,292,304.44
净资产合计		62,775,304.44
负债和净资产总计		63,211,758.64

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 9 月 10 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 9 月 10 日至 2025 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0379 元，基金份额总额 60,483,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		5,878,256.74
1.利息收入		32,593.88
其中：存款利息收入	7.4.7.9	32,593.88
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）		4,540,205.71
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,120,817.69
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.13	-
股利收益	7.4.7.14	419,388.02
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	1,463,598.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-158,140.87
减：二、营业总支出		313,904.43
1. 管理人报酬		188,528.26
2. 托管费		37,705.66
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	7.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.18	87,670.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,564,352.31
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,564,352.31
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		5,564,352.31

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 10 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 9 月 10 日至 2025 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	246,483,000.00	-	246,483,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-186,000,000.00	2,292,304.44	-183,707,695.56
（一）、综合收益总额	-	5,564,352.31	5,564,352.31
（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）	-186,000,000.00	-3,272,047.87	-189,272,047.87

其中：1.基金申购款	9,000,000.00	41,141.24	9,041,141.24
2.基金赎回款	-195,000,000.00	-3,313,189.11	-198,313,189.11
（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	60,483,000.00	2,292,304.44	62,775,304.44

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 10 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 9 月 10 日至 2025 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]424 号《关于准予易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 246,483,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2025 年 9 月 1 日至 2025 年 9 月 5 日，募集金额总额为人民币 246,501,107.39 元，其中：有效净认购金额为人民币 246,483,000.00 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 18,107.39 元，经安永华明（2025）验字第 70013033_G36 号验资报告予以审验。

7.4.2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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券

投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2025 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅

为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额，以及由本基金申购对价包含可以现金替代时被可以替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式采用现金分红;

2、每一基金份额享有同等分配权;

3、在符合以下有关基金分红条件的情形下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以届时的公告为准:

(1) 本基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过业绩比较基准同期累计报酬率或者基金可供分配利润金额大于 0 元时,基金管理人可进行收益分配,累计报酬率计算方式详见招募说明书;若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2) 当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时,基于本基金的特点,本基金收益分配无需以弥补亏损为前提,收益分配后基金份额净值有可能低于面值;当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时,本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,在履行适当程序后基金管理人可调整基金收益的分配原则;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开

发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继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》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财税[2024]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》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，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。

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8

月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款		1,642,188.44
等于：本金		1,642,033.00
加：应计利息		155.44
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		1,642,188.44

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		59,681,522.75	-	61,145,120.77	1,463,598.02
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		59,681,522.75	-	61,145,120.77	1,463,598.02

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,211.93
其中：交易所市场	19,211.93
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	33,315.07
应付替代款	271,530.54
可退替代款	1,576.20
合计	325,633.74

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	246,483,000.00	246,483,000.00
本期申购	9,000,000.00	9,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-195,000,000.00	-195,000,000.00
本期末	60,483,000.00	60,483,000.00

注：本基金合同于 2025 年 9 月 10 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 246,483,000.00 份基金份额。

7.4.7.8未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,100,754.29	1,463,598.02	5,564,352.31
本期基金份额交易产生的变动数	-1,947,042.11	-1,325,005.76	-3,272,047.87
其中：基金申购款	129,371.28	-88,230.04	41,141.24
基金赎回款	-2,076,413.39	-1,236,775.72	-3,313,189.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,153,712.18	138,592.26	2,292,304.44

7.4.7.9存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	31,817.05
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	662.73
其他	114.10
合计	32,593.88

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,702,358.03
股票投资收益——赎回差价收入	1,418,459.66
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	4,120,817.69

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	173,955,176.23
减：卖出股票成本总额	171,083,030.42
减：交易费用	169,787.78
买卖股票差价收入	2,702,358.03

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	198,313,189.11
减：现金支付赎回款总额	92,162,829.11
减：赎回股票成本总额	104,731,900.34
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,418,459.66

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.12 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。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.14股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年9月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	419,388.02
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	419,388.02

7.4.7.15公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年9月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	1,463,598.02
——股票投资	1,463,598.02
——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	1,463,598.02

7.4.7.16其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年9月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	-
其他	18,107.39
替代损益收入	-176,248.26
合计	-158,140.87

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.18其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年9月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	28,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,955.29
存托服务费	0.15
其他	55,715.07
合计	87,670.51

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2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。

7.4.9关联方关系

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
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东

广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达私募基金管理有限公司	基金管理人的子公司
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
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025年9月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	61,454.08	0.01%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2025年9月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	6.14	0.01%	6.14	0.03%

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

2.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年9月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	188,528.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	39,683.47
应支付基金管理人的净管理费	148,844.79

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年9月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	37,705.66

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 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	
	2025年9月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	1,642,188.44	31,817.05

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
603092	德力佳	2025-10-30	6 个月	新股流通受限	46.68	55.66	36	1,680.48	2,003.76	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6 个月	新股流通受限	24.49	32.82	57	1,395.93	1,870.74	-
603376	大明电子	2025-10-28	6 个月	新股流通受限	12.55	26.21	108	1,355.40	2,830.68	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项停牌	78.81	2026-01-15	86.69	2,800	221,862.48	220,668.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项停牌	272.72	2026-01-05	278.00	708	192,126.55	193,085.76	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、债券型基金与货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。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。

7.4.13.2 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 2025 年 12 月 31 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%。

7.4.13.2.1 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 2025年12月31日
A-1	0.00

A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 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 2025年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.3 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 2025年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.4 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 2025年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、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。

7.4.13.2.5 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 2025年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.6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 2025年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.3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 2025 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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,组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 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	1,642,188.44	-	-	-	1,642,188.44

结算备付金	275,014.77	-	-	-	275,014.77
存出保证金	149,434.66	-	-	-	149,434.66
交易性金融资产	-	-	-	61,145,120.77	61,145,120.77
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	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,066,637.87	-	-	61,145,120.77	63,211,758.64
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	-	-	-	75,332.70	75,332.70
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	29,573.13	29,573.13
应付托管费	-	-	-	5,914.63	5,914.63
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	-	-	-	325,633.74	325,633.74
负债总计	-	-	-	436,454.20	436,454.20
利率敏感度缺口	2,066,637.87	-	-	60,708,666.57	62,775,304.44

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。

7.4.13.4.1.2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。

7.4.13.4.2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。

7.4.13.4.3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。

7.4.13.4.3.1其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	
	2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	61,145,120.77	97.40
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	61,145,120.77	97.40

7.4.13.4.3.2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 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	2,949,974.34
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,949,974.34

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日
第一层次	60,724,661.83
第二层次	413,753.76
第三层次	6,705.18
合计	61,145,120.77

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	4,431.81	4,431.81
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	2,273.37	2,273.37
其中：计入损益的利得或损失	-	2,273.37	2,273.37
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	6,705.18	6,705.18
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	2,273.37	2,273.37

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	6,705.18	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.8285—2.8666	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	61,145,120.77	96.73
	其中：股票	61,145,120.77	96.73
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	1,917,203.21	3.03
8	其他各项资产	149,434.66	0.24

9	合计	63,211,758.64	100.00
---	----	---------------	--------

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 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	207,000.00	0.33
B	采矿业	3,258,757.00	5.19
C	制造业	34,896,744.08	55.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,144,705.00	1.82
E	建筑业	741,560.00	1.18
F	批发和零售业	633,354.00	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,545,652.00	2.46
H	住宿和餐饮业	8,375.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,968,509.00	4.73
J	金融业	7,577,062.00	12.07
K	房地产业	535,967.00	0.85
L	租赁和商务服务业	591,245.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	826,308.00	1.32
N	水利、环境和公共设施管理业	187,228.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	148,048.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	110,706.00	0.18
S	综合	96,449.00	0.15
	合计	55,477,669.08	88.37

8.2.1.2 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	38,160.00	0.06
B	采矿业	288,532.00	0.46
C	制造业	3,601,076.01	5.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	105,402.00	0.17
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	75,706.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	194,824.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	468,830.64	0.75
J	金融业	670,367.00	1.07
K	房地产业	11,387.00	0.02
L	租赁和商务服务业	48,407.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	58,383.04	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	22,415.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,528.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	71,434.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	5,667,451.69	9.03

8.3 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

8.3.1 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	300750	宁德时代	5,600	2,056,656.00	3.28
2	600519	贵州茅台	1,400	1,928,052.00	3.07
3	601318	中国平安	22,800	1,559,520.00	2.48

4	300308	中际旭创	1,900	1,159,000.00	1.85
5	600036	招商银行	25,900	1,090,390.00	1.74
6	601899	紫金矿业	31,500	1,085,805.00	1.73
7	000333	美的集团	11,200	875,280.00	1.39
8	300502	新易盛	1,900	818,672.00	1.30
9	601166	兴业银行	38,200	804,492.00	1.28
10	600030	中信证券	21,200	608,652.00	0.97
11	002475	立讯精密	10,500	595,455.00	0.95
12	600900	长江电力	20,500	557,395.00	0.89
13	300059	东方财富	23,900	554,002.00	0.88
14	300274	阳光电源	3,200	547,328.00	0.87
15	603259	药明康德	5,800	525,712.00	0.84
16	601398	工商银行	65,500	519,415.00	0.83
17	601211	国泰海通	25,200	517,860.00	0.82
18	688981	中芯国际	3,682	452,260.06	0.72
19	603993	洛阳钼业	22,400	448,000.00	0.71
20	600276	恒瑞医药	7,200	428,904.00	0.68
21	600887	伊利股份	14,300	408,980.00	0.65
22	601328	交通银行	51,900	376,275.00	0.60
23	002415	海康威视	12,300	367,032.00	0.58
24	601857	中国石油	35,100	365,391.00	0.58
25	600150	中国船舶	10,800	359,208.00	0.57
26	000651	格力电器	8,700	349,914.00	0.56
27	600031	三一重工	16,500	348,645.00	0.56
28	603986	兆易创新	1,600	342,800.00	0.55
29	000858	五粮液	3,200	339,008.00	0.54
30	601600	中国铝业	27,500	336,050.00	0.54
31	600000	浦发银行	26,500	329,660.00	0.53
32	601288	农业银行	41,000	314,880.00	0.50
33	002230	科大讯飞	6,000	301,740.00	0.48
34	002027	分众传媒	39,000	287,430.00	0.46
35	688002	睿创微纳	2,848	287,078.40	0.46
36	600104	上汽集团	18,800	286,136.00	0.46
37	688256	寒武纪	207	280,598.85	0.45
38	000725	京东方 A	66,600	280,386.00	0.45
39	600019	宝钢股份	37,300	277,885.00	0.44
40	000157	中联重科	29,700	256,311.00	0.41
41	601601	中国太保	6,100	255,651.00	0.41
42	000100	TCL 科技	56,100	254,694.00	0.41
43	002594	比亚迪	2,600	254,072.00	0.40
44	600660	福耀玻璃	3,900	252,603.00	0.40
45	600050	中国联通	47,700	243,747.00	0.39
46	300124	汇川技术	3,200	241,056.00	0.38
47	600372	中航机载	17,900	240,218.00	0.38

48	300433	蓝思科技	7,900	239,133.00	0.38
49	688008	澜起科技	2,025	238,545.00	0.38
50	000338	潍柴动力	13,800	237,360.00	0.38
51	600690	海尔智家	9,000	234,810.00	0.37
52	688041	海光信息	1,043	234,059.63	0.37
53	002028	思源电气	1,500	231,885.00	0.37
54	600989	宝丰能源	11,800	231,634.00	0.37
55	600741	华域汽车	11,500	230,000.00	0.37
56	600039	四川路桥	22,500	223,875.00	0.36
57	300394	天孚通信	1,100	223,333.00	0.36
58	600941	中国移动	2,200	222,310.00	0.35
59	002049	紫光国微	2,800	220,668.00	0.35
60	600988	赤峰黄金	7,000	218,680.00	0.35
61	600066	宇通客车	6,600	215,820.00	0.34
62	600406	国电南瑞	9,600	215,808.00	0.34
63	600183	生益科技	3,005	214,587.05	0.34
64	601225	陕西煤业	10,000	213,200.00	0.34
65	000792	盐湖股份	7,500	211,200.00	0.34
66	002236	大华股份	11,100	210,234.00	0.33
67	603019	中科曙光	2,400	205,536.00	0.33
68	600096	云天化	6,100	203,801.00	0.32
69	002714	牧原股份	4,000	202,320.00	0.32
70	000708	中信特钢	12,300	201,351.00	0.32
71	002074	国轩高科	5,000	195,550.00	0.31
72	600115	中国东航	32,500	195,000.00	0.31
73	688012	中微公司	708	193,085.76	0.31
74	601816	京沪高铁	37,000	190,550.00	0.30
75	002463	沪电股份	2,600	189,982.00	0.30
76	000425	徐工机械	16,200	187,596.00	0.30
77	002493	荣盛石化	15,900	186,189.00	0.30
78	002709	天赐材料	4,000	185,320.00	0.30
79	002271	东方雨虹	13,600	184,824.00	0.29
80	600309	万华化学	2,400	184,032.00	0.29
81	002371	北方华创	400	183,632.00	0.29
82	600011	华能国际	24,600	183,516.00	0.29
83	601088	中国神华	4,400	178,200.00	0.28
84	300476	胜宏科技	600	172,548.00	0.27
85	600089	特变电工	7,700	171,094.00	0.27
86	000001	平安银行	14,900	170,009.00	0.27
87	000733	振华科技	3,200	167,712.00	0.27
88	002008	大族激光	4,000	164,760.00	0.26
89	601360	三六零	14,700	164,199.00	0.26
90	000568	泸州老窖	1,400	162,708.00	0.26
91	301236	软通动力	3,400	161,262.00	0.26

92	002384	东山精密	1,900	160,835.00	0.26
93	002414	高德红外	10,900	159,903.00	0.25
94	601872	招商轮船	17,700	158,946.00	0.25
95	300014	亿纬锂能	2,400	157,824.00	0.25
96	600029	南方航空	19,300	154,593.00	0.25
97	601100	恒立液压	1,400	153,874.00	0.25
98	000933	神火股份	5,500	151,085.00	0.24
99	603501	豪威集团	1,200	151,080.00	0.24
100	300474	景嘉微	2,100	150,927.00	0.24
101	601111	中国国航	15,600	146,172.00	0.23
102	002460	赣锋锂业	2,300	144,647.00	0.23
103	600038	中直股份	4,000	144,520.00	0.23
104	600438	通威股份	7,000	143,640.00	0.23
105	603659	璞泰来	5,200	142,168.00	0.23
106	600795	国电电力	27,800	140,112.00	0.22
107	002156	通富微电	3,700	139,490.00	0.22
108	601766	中国中车	20,300	138,446.00	0.22
109	002050	三花智控	2,500	138,275.00	0.22
110	300003	乐普医疗	8,700	137,547.00	0.22
111	603799	华友钴业	2,000	136,520.00	0.22
112	601168	西部矿业	4,900	135,436.00	0.22
113	601919	中远海控	8,900	135,102.00	0.22
114	300073	当升科技	2,300	132,940.00	0.21
115	002281	光迅科技	1,900	132,905.00	0.21
116	600028	中国石化	21,300	131,634.00	0.21
117	300136	信维通信	2,100	130,200.00	0.21
118	600415	小商品城	8,100	129,195.00	0.21
119	603486	科沃斯	1,600	129,088.00	0.21
120	002312	川发龙蟒	11,800	128,974.00	0.21
121	601319	中国人保	14,400	128,880.00	0.21
122	300033	同花顺	400	128,872.00	0.21
123	600867	通化东宝	15,700	128,269.00	0.20
124	600885	宏发股份	4,200	127,680.00	0.20
125	600392	盛和资源	5,900	127,027.00	0.20
126	300442	润泽科技	2,400	126,720.00	0.20
127	002497	雅化集团	5,100	126,225.00	0.20
128	603288	海天味业	3,400	125,868.00	0.20
129	300866	安克创新	1,100	125,829.00	0.20
130	600426	华鲁恒升	4,000	125,720.00	0.20
131	601728	中国电信	19,800	124,740.00	0.20
132	002625	光启技术	2,500	121,900.00	0.19
133	002558	巨人网络	2,800	121,212.00	0.19
134	002410	广联达	9,600	120,768.00	0.19
135	300972	万辰集团	600	120,642.00	0.19

136	688235	百济神州	443	118,989.80	0.19
137	300408	三环集团	2,600	118,950.00	0.19
138	002241	歌尔股份	4,100	117,793.00	0.19
139	300438	鹏辉能源	2,200	117,084.00	0.19
140	301358	湖南裕能	1,800	116,388.00	0.19
141	688072	拓荆科技	352	116,160.00	0.19
142	002916	深南电路	500	116,145.00	0.19
143	600585	海螺水泥	5,300	115,858.00	0.18
144	600563	法拉电子	1,100	115,445.00	0.18
145	600418	江淮汽车	2,300	113,850.00	0.18
146	601888	中国中免	1,200	113,472.00	0.18
147	601877	正泰电器	4,000	111,560.00	0.18
148	601012	隆基绿能	6,100	111,020.00	0.18
149	300207	欣旺达	4,200	109,830.00	0.17
150	002273	水晶光电	4,300	108,016.00	0.17
151	688271	联影医疗	836	104,918.00	0.17
152	600166	福田汽车	35,900	104,828.00	0.17
153	002294	信立泰	2,100	104,055.00	0.17
154	000630	铜陵有色	17,200	103,372.00	0.16
155	601186	中国铁建	13,400	102,778.00	0.16
156	002738	中矿资源	1,300	102,115.00	0.16
157	002595	豪迈科技	1,200	101,412.00	0.16
158	000408	藏格矿业	1,200	101,280.00	0.16
159	002091	江苏国泰	11,100	100,233.00	0.16
160	601628	中国人寿	2,200	100,100.00	0.16
161	300015	爱尔眼科	9,100	99,918.00	0.16
162	300759	康龙化成	3,500	99,505.00	0.16
163	002152	广电运通	7,200	99,432.00	0.16
164	002603	以岭药业	5,800	99,006.00	0.16
165	601668	中国建筑	19,100	97,983.00	0.16
166	600673	东阳光	4,300	96,449.00	0.15
167	600176	中国巨石	5,600	95,760.00	0.15
168	002001	新和成	3,800	95,722.00	0.15
169	300760	迈瑞医疗	500	95,225.00	0.15
170	600549	厦门钨业	2,300	94,438.00	0.15
171	002195	岩山科技	13,300	94,297.00	0.15
172	002444	巨星科技	2,700	91,854.00	0.15
173	300418	昆仑万维	2,200	91,740.00	0.15
174	600323	瀚蓝环境	3,200	91,520.00	0.15
175	600489	中金黄金	3,900	91,104.00	0.15
176	000301	东方盛虹	8,300	90,387.00	0.14
177	600219	南山铝业	16,800	90,384.00	0.14
178	000975	山金国际	3,700	90,021.00	0.14
179	300496	中科创达	1,300	87,750.00	0.14

180	600111	北方稀土	1,900	87,628.00	0.14
181	000063	中兴通讯	2,300	87,032.00	0.14
182	000963	华东医药	2,200	86,790.00	0.14
183	300724	捷佳伟创	900	86,040.00	0.14
184	000887	中鼎股份	3,700	85,877.00	0.14
185	002436	兴森科技	4,000	84,680.00	0.13
186	600499	科达制造	6,100	84,607.00	0.13
187	300573	兴齐眼药	1,200	84,348.00	0.13
188	601216	君正集团	17,400	83,868.00	0.13
189	601058	赛轮轮胎	5,100	82,518.00	0.13
190	002409	雅克科技	1,100	81,510.00	0.13
191	600938	中国海油	2,700	81,486.00	0.13
192	605499	东鹏饮料	300	80,217.00	0.13
193	600352	浙江龙盛	7,500	79,950.00	0.13
194	000538	云南白药	1,400	79,464.00	0.13
195	300347	泰格医药	1,400	79,380.00	0.13
196	600346	恒力石化	3,500	78,855.00	0.13
197	300919	中伟股份	1,700	78,761.00	0.13
198	600048	保利发展	12,900	78,690.00	0.13
199	002085	万丰奥威	4,900	78,449.00	0.12
200	300017	网宿科技	7,600	77,900.00	0.12
201	600233	圆通速递	4,700	77,174.00	0.12
202	600160	巨化股份	2,000	76,840.00	0.12
203	002340	格林美	9,100	76,076.00	0.12
204	601117	中国化学	10,000	75,300.00	0.12
205	300054	鼎龙股份	2,000	75,200.00	0.12
206	002837	英维克	700	74,823.00	0.12
207	600998	九州通	14,600	74,752.00	0.12
208	002138	顺络电子	2,100	74,613.00	0.12
209	002244	滨江集团	7,400	74,370.00	0.12
210	000423	东阿阿胶	1,500	73,620.00	0.12
211	601658	邮储银行	13,500	73,575.00	0.12
212	002128	电投能源	2,600	72,566.00	0.12
213	600522	中天科技	4,000	72,480.00	0.12
214	601677	明泰铝业	4,900	72,471.00	0.12
215	688126	沪硅产业	3,337	72,212.68	0.12
216	300012	华测检测	5,300	71,815.00	0.11
217	300748	金力永磁	2,100	71,631.00	0.11
218	002202	金风科技	3,500	71,400.00	0.11
219	600362	江西铜业	1,300	71,396.00	0.11
220	000932	华菱钢铁	12,400	69,688.00	0.11
221	600332	白云山	2,700	69,498.00	0.11
222	600141	兴发集团	2,000	69,160.00	0.11
223	300454	深信服	600	69,096.00	0.11

224	600511	国药股份	2,400	69,000.00	0.11
225	001914	招商积余	6,400	68,352.00	0.11
226	300628	亿联网络	1,900	67,735.00	0.11
227	002841	视源股份	1,700	67,371.00	0.11
228	603596	伯特利	1,300	66,651.00	0.11
229	002472	双环传动	1,400	66,374.00	0.11
230	600196	复星医药	2,500	66,225.00	0.11
231	600547	山东黄金	1,700	65,807.00	0.10
232	603606	东方电缆	1,100	65,725.00	0.10
233	600010	包钢股份	26,700	63,546.00	0.10
234	000768	中航西飞	2,500	63,450.00	0.10
235	688111	金山办公	204	62,642.28	0.10
236	600584	长电科技	1,700	62,526.00	0.10
237	600760	中航沈飞	1,100	61,765.00	0.10
238	001979	招商蛇口	7,100	61,344.00	0.10
239	600893	航发动力	1,500	60,045.00	0.10
240	300699	光威复材	1,500	59,190.00	0.09
241	000807	云铝股份	1,800	59,112.00	0.09
242	002245	蔚蓝锂芯	3,300	58,740.00	0.09
243	002185	华天科技	5,300	58,141.00	0.09
244	600886	国投电力	4,400	57,728.00	0.09
245	600745	闻泰科技	1,500	55,920.00	0.09
246	000002	万科 A	12,000	55,800.00	0.09
247	300346	南大光电	1,300	55,770.00	0.09
248	300251	光线传媒	3,400	55,692.00	0.09
249	300142	沃森生物	5,100	55,641.00	0.09
250	300450	先导智能	1,100	54,978.00	0.09
251	600085	同仁堂	1,700	54,842.00	0.09
252	000034	神州数码	1,400	54,474.00	0.09
253	000938	紫光股份	2,200	54,120.00	0.09
254	601800	中国交建	6,500	53,560.00	0.09
255	002532	天山铝业	3,300	53,394.00	0.09
256	600008	首创环保	17,500	52,500.00	0.08
257	300627	华测导航	1,500	52,365.00	0.08
258	300285	国瓷材料	1,900	52,079.00	0.08
259	600497	驰宏锌锗	7,100	51,901.00	0.08
260	002179	中航光电	1,430	50,679.20	0.08
261	600839	四川长虹	5,500	50,050.00	0.08
262	300676	华大基因	1,100	49,896.00	0.08
263	601633	长城汽车	2,200	49,786.00	0.08
264	300088	长信科技	8,100	49,086.00	0.08
265	600026	中远海能	4,200	49,056.00	0.08
266	000400	许继电气	1,900	48,849.00	0.08
267	600486	扬农化工	700	48,573.00	0.08

268	000999	华润三九	1,700	48,382.00	0.08
269	600460	士兰微	1,700	48,297.00	0.08
270	600803	新奥股份	2,300	47,748.00	0.08
271	603087	甘李药业	700	47,649.00	0.08
272	600004	白云机场	5,000	47,300.00	0.08
273	002422	科伦药业	1,600	46,960.00	0.07
274	002155	湖南黄金	2,200	46,398.00	0.07
275	002352	顺丰控股	1,200	45,984.00	0.07
276	002252	上海莱士	7,200	45,648.00	0.07
277	601880	辽港股份	28,500	45,600.00	0.07
278	000035	中国天楹	8,200	45,264.00	0.07
279	002601	龙佰集团	2,300	45,034.00	0.07
280	688188	柏楚电子	330	44,843.70	0.07
281	601866	中远海发	17,500	44,100.00	0.07
282	603077	和邦生物	19,500	44,070.00	0.07
283	688303	大全能源	1,643	44,065.26	0.07
284	601018	宁波港	11,900	43,197.00	0.07
285	600170	上海建工	16,300	43,195.00	0.07
286	600515	海南机场	8,000	42,640.00	0.07
287	002465	海格通信	2,700	42,525.00	0.07
288	600637	东方明珠	4,300	42,355.00	0.07
289	601000	唐山港	11,000	42,240.00	0.07
290	300083	创世纪	4,500	41,445.00	0.07
291	603939	益丰药房	1,900	41,268.00	0.07
292	300751	迈为股份	200	41,198.00	0.07
293	300316	晶盛机电	1,100	40,425.00	0.06
294	600763	通策医疗	1,000	40,210.00	0.06
295	000977	浪潮信息	600	39,960.00	0.06
296	302132	中航成飞	500	39,500.00	0.06
297	600535	天士力	2,600	39,182.00	0.06
298	600208	衢州发展	10,100	39,087.00	0.06
299	000878	云南铜业	1,900	38,969.00	0.06
300	002648	卫星化学	2,200	38,896.00	0.06
301	601689	拓普集团	500	38,590.00	0.06
302	002129	TCL 中环	4,500	38,565.00	0.06
303	601868	中国能建	16,400	38,540.00	0.06
304	300001	特锐德	1,500	38,520.00	0.06
305	000415	渤海租赁	9,500	38,475.00	0.06
306	600316	洪都航空	1,100	38,401.00	0.06
307	003816	中国广核	10,200	38,352.00	0.06
308	600007	中国国贸	1,900	37,658.00	0.06
309	600674	川投能源	2,700	37,530.00	0.06
310	002065	东华软件	4,100	37,515.00	0.06
311	000786	北新建材	1,500	37,455.00	0.06

312	688599	天合光能	2,263	37,452.65	0.06
313	300037	新宙邦	700	36,680.00	0.06
314	688521	芯原股份	265	36,297.05	0.06
315	002078	太阳纸业	2,300	36,225.00	0.06
316	600588	用友网络	2,700	35,802.00	0.06
317	600177	雅戈尔	4,700	35,720.00	0.06
318	300002	神州泰岳	3,100	35,712.00	0.06
319	300763	锦浪科技	500	35,705.00	0.06
320	002459	晶澳科技	3,100	35,495.00	0.06
321	688472	阿特斯	2,380	35,485.80	0.06
322	600862	中航高科	1,500	35,445.00	0.06
323	603979	金诚信	460	35,029.00	0.06
324	601615	明阳智能	2,400	34,752.00	0.06
325	605117	德业股份	400	34,480.00	0.05
326	001965	招商公路	3,400	34,272.00	0.05
327	002130	沃尔核材	1,300	34,216.00	0.05
328	300413	芒果超媒	1,400	34,188.00	0.05
329	605589	圣泉集团	1,200	33,960.00	0.05
330	688223	晶科能源	6,010	33,896.40	0.05
331	600436	片仔癀	200	33,756.00	0.05
332	601618	中国中冶	11,100	32,967.00	0.05
333	688777	中控技术	668	32,959.12	0.05
334	300390	天华新能	600	32,766.00	0.05
335	601567	三星医疗	1,400	32,228.00	0.05
336	000738	航发控制	1,500	31,965.00	0.05
337	000830	鲁西化工	1,900	31,483.00	0.05
338	000683	博源化工	4,200	31,248.00	0.05
339	600845	宝信软件	1,500	31,065.00	0.05
340	000069	华侨城 A	12,300	30,504.00	0.05
341	300604	长川科技	300	30,393.00	0.05
342	300395	菲利华	300	30,090.00	0.05
343	600704	物产中大	5,400	30,078.00	0.05
344	600325	华发股份	7,100	29,962.00	0.05
345	600529	山东药玻	1,500	29,895.00	0.05
346	688063	派能科技	518	29,432.76	0.05
347	600482	中国动力	1,400	28,980.00	0.05
348	300568	星源材质	1,900	28,975.00	0.05
349	300383	光环新网	2,300	28,773.00	0.05
350	600864	哈投股份	4,300	28,509.00	0.05
351	603885	吉祥航空	1,900	28,272.00	0.05
352	000039	中集集团	2,800	28,252.00	0.05
353	300832	新产业	500	28,125.00	0.04
354	603806	福斯特	2,000	27,920.00	0.04
355	000629	钒钛股份	9,000	27,900.00	0.04

356	300144	宋城演艺	3,400	27,846.00	0.04
357	688009	中国通号	5,086	27,820.42	0.04
358	000661	长春高新	300	27,765.00	0.04
359	600312	平高电气	1,600	27,760.00	0.04
360	600018	上港集团	5,100	27,642.00	0.04
361	300567	精测电子	300	27,360.00	0.04
362	600143	金发科技	1,400	27,356.00	0.04
363	002739	万达电影	2,400	27,168.00	0.04
364	600521	华海药业	1,600	27,152.00	0.04
365	002756	永兴材料	500	27,125.00	0.04
366	002223	鱼跃医疗	700	26,747.00	0.04
367	600820	隧道股份	4,100	26,609.00	0.04
368	600859	王府井	1,700	26,401.00	0.04
369	688180	君实生物	772	26,371.52	0.04
370	600879	航天电子	1,200	25,584.00	0.04
371	000960	锡业股份	900	25,092.00	0.04
372	601966	玲珑轮胎	1,700	24,701.00	0.04
373	601127	赛力斯	200	24,192.00	0.04
374	688390	固德威	386	23,982.18	0.04
375	002701	奥瑞金	4,000	23,800.00	0.04
376	300601	康泰生物	1,600	23,632.00	0.04
377	300558	贝达药业	500	23,345.00	0.04
378	600009	上海机场	700	22,932.00	0.04
379	002120	韵达股份	3,400	22,916.00	0.04
380	600905	三峡能源	5,600	22,904.00	0.04
381	300070	碧水源	5,800	22,736.00	0.04
382	601006	大秦铁路	4,400	22,704.00	0.04
383	600655	豫园股份	4,400	22,572.00	0.04
384	002466	天齐锂业	400	22,152.00	0.04
385	300118	东方日升	1,500	21,990.00	0.04
386	300529	健帆生物	1,100	21,637.00	0.03
387	002353	杰瑞股份	300	21,249.00	0.03
388	002456	欧菲光	2,000	21,240.00	0.03
389	688122	西部超导	283	21,106.14	0.03
390	601390	中国中铁	3,900	21,099.00	0.03
391	002544	普天科技	600	20,694.00	0.03
392	300457	赢合科技	700	19,495.00	0.03
393	600498	烽火通信	600	19,248.00	0.03
394	600118	中国卫星	200	18,990.00	0.03
395	000625	长安汽车	1,600	18,976.00	0.03
396	600699	均胜电子	600	18,816.00	0.03
397	601179	中国西电	2,000	18,200.00	0.03
398	002131	利欧股份	3,200	18,048.00	0.03
399	688396	华润微	341	18,025.26	0.03

400	603392	万泰生物	400	17,976.00	0.03
401	600895	张江高科	400	17,560.00	0.03
402	002318	久立特材	600	17,370.00	0.03
403	000617	中油资本	1,700	16,320.00	0.03
404	300253	卫宁健康	1,800	15,876.00	0.03
405	000988	华工科技	200	15,866.00	0.03
406	603833	欧派家居	300	15,627.00	0.02
407	603568	伟明环保	600	15,228.00	0.02
408	300896	爱美客	100	14,172.00	0.02
409	688166	博瑞医药	276	13,540.56	0.02
410	603899	晨光股份	500	13,530.00	0.02
411	600398	海澜之家	2,100	12,705.00	0.02
412	002266	浙富控股	3,000	12,480.00	0.02
413	600487	亨通光电	500	12,365.00	0.02
414	601727	上海电气	1,400	12,054.00	0.02
415	601021	春秋航空	200	11,900.00	0.02
416	002064	华峰化学	1,000	11,000.00	0.02
417	601669	中国电建	2,000	10,400.00	0.02
418	002891	中宠股份	200	10,352.00	0.02
419	002938	鹏鼎控股	200	10,116.00	0.02
420	002180	纳思达	500	10,110.00	0.02
421	688578	艾力斯	97	10,102.55	0.02
422	000032	深桑达 A	500	9,675.00	0.02
423	002389	航天彩虹	400	9,592.00	0.02
424	600765	中航重机	500	9,580.00	0.02
425	300122	智飞生物	500	9,435.00	0.02
426	601233	桐昆股份	500	8,605.00	0.01
427	600258	首旅酒店	500	8,375.00	0.01
428	002044	美年健康	1,500	7,920.00	0.01
429	300068	南都电源	500	7,770.00	0.01
430	002007	华兰生物	500	7,565.00	0.01
431	601607	上海医药	400	7,144.00	0.01
432	601985	中国核电	800	6,920.00	0.01
433	002572	索菲亚	500	6,805.00	0.01
434	600161	天坛生物	400	6,536.00	0.01
435	601238	广汽集团	800	6,528.00	0.01
436	600667	太极实业	700	5,579.00	0.01
437	000998	隆平高科	500	4,680.00	0.01
438	600153	建发股份	500	4,625.00	0.01
439	600516	方大炭素	800	4,552.00	0.01
440	002292	奥飞娱乐	500	4,425.00	0.01
441	002405	四维图新	400	3,604.00	0.01
442	300459	汤姆猫	500	2,295.00	0.00

8.3.2 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	601898	中煤能源	7,800	97,032.00	0.15
2	688113	联测科技	2,221	87,796.13	0.14
3	688312	燕麦科技	2,493	82,717.74	0.13
4	601138	工业富联	1,300	80,665.00	0.13
5	002824	和胜股份	4,000	77,600.00	0.12
6	300926	博俊科技	2,300	75,394.00	0.12
7	600507	方大特钢	12,800	75,392.00	0.12
8	000589	贵州轮胎	14,500	75,110.00	0.12
9	000600	建投能源	8,800	75,064.00	0.12
10	605305	中际联合	1,800	74,988.00	0.12
11	300861	美畅股份	5,000	74,650.00	0.12
12	688107	安路科技	2,714	73,766.52	0.12
13	600188	兖矿能源	5,600	73,640.00	0.12
14	300851	交大思诺	2,700	72,333.00	0.12
15	002454	松芝股份	8,300	72,293.00	0.12
16	688146	中船特气	1,769	71,467.60	0.11
17	600100	同方股份	8,000	71,360.00	0.11
18	600926	杭州银行	4,300	65,704.00	0.10
19	601128	常熟银行	9,300	65,472.00	0.10
20	002807	江阴银行	13,900	63,523.00	0.10
21	601838	成都银行	3,900	62,868.00	0.10
22	601577	长沙银行	5,600	54,320.00	0.09
23	002897	意华股份	1,000	54,070.00	0.09
24	601975	招商南油	17,800	53,756.00	0.09
25	002284	亚太股份	3,600	53,748.00	0.09
26	300098	高新兴	7,900	48,190.00	0.08
27	688702	盛科通信	333	47,182.77	0.08
28	600552	凯盛科技	3,700	45,880.00	0.07
29	688172	燕东微	1,547	44,770.18	0.07
30	688101	三达膜	2,682	44,092.08	0.07
31	688001	华兴源创	1,400	42,252.00	0.07
32	000576	甘化科工	4,000	42,120.00	0.07
33	300182	捷成股份	7,500	41,400.00	0.07
34	600269	赣粤高速	7,600	39,444.00	0.06
35	688181	八亿时空	1,202	38,848.64	0.06
36	002041	登海种业	4,000	38,160.00	0.06
37	002240	盛新锂能	1,100	37,873.00	0.06
38	603680	今创集团	2,400	36,984.00	0.06

39	300357	我武生物	1,300	36,855.00	0.06
40	688015	交控科技	1,600	36,448.00	0.06
41	600195	中牧股份	4,400	34,628.00	0.06
42	600801	华新建材	1,400	34,356.00	0.05
43	000603	盛达资源	1,100	34,056.00	0.05
44	688387	信科移动	2,633	33,965.70	0.05
45	603890	春秋电子	2,100	33,873.00	0.05
46	300953	震裕科技	200	33,604.00	0.05
47	603185	弘元绿能	1,100	33,550.00	0.05
48	002839	张家港行	7,200	32,904.00	0.05
49	002258	利尔化学	2,500	32,625.00	0.05
50	000062	深圳华强	1,300	32,006.00	0.05
51	000895	双汇发展	1,200	31,764.00	0.05
52	603160	汇顶科技	400	31,600.00	0.05
53	300259	新天科技	7,000	31,080.00	0.05
54	688327	云从科技	2,151	30,909.87	0.05
55	300852	四会富仕	800	30,544.00	0.05
56	600999	招商证券	1,800	29,952.00	0.05
57	301606	绿联科技	500	29,370.00	0.05
58	002334	英威腾	3,200	28,864.00	0.05
59	603025	大豪科技	1,600	28,736.00	0.05
60	601881	中国银河	1,800	28,296.00	0.05
61	301665	泰禾股份	1,000	28,240.00	0.04
62	002142	宁波银行	1,000	28,090.00	0.04
63	601326	秦港股份	8,000	27,920.00	0.04
64	300130	新国都	1,000	27,730.00	0.04
65	300515	三德科技	1,400	27,524.00	0.04
66	300735	光弘科技	1,100	27,346.00	0.04
67	002010	传化智联	4,700	27,307.00	0.04
68	002448	中原内配	2,100	27,153.00	0.04
69	600884	杉杉股份	2,000	27,020.00	0.04
70	300445	康斯特	1,000	26,060.00	0.04
71	688363	华熙生物	591	25,814.88	0.04
72	601698	中国卫通	700	25,011.00	0.04
73	002612	朗姿股份	1,200	24,528.00	0.04
74	300775	三角防务	800	24,320.00	0.04
75	002518	科士达	500	24,260.00	0.04
76	300302	同有科技	1,300	23,582.00	0.04
77	000973	佛塑科技	1,600	23,520.00	0.04
78	601958	金钼股份	1,500	23,370.00	0.04
79	600098	广州发展	3,500	22,890.00	0.04
80	601009	南京银行	2,000	22,860.00	0.04
81	601156	东航物流	1,200	22,092.00	0.04
82	000902	新洋丰	1,400	21,868.00	0.03

83	605020	永和股份	800	21,512.00	0.03
84	000612	焦作万方	1,900	20,938.00	0.03
85	600919	江苏银行	2,000	20,800.00	0.03
86	301216	万凯新材	1,200	20,232.00	0.03
87	603323	苏农银行	4,000	20,200.00	0.03
88	300634	彩讯股份	800	20,184.00	0.03
89	002043	兔宝宝	1,400	20,174.00	0.03
90	300224	正海磁材	1,300	20,098.00	0.03
91	601688	华泰证券	800	18,872.00	0.03
92	003035	南网能源	4,100	18,778.00	0.03
93	600395	盘江股份	4,000	18,640.00	0.03
94	688006	杭可科技	636	18,628.44	0.03
95	601939	建设银行	2,000	18,560.00	0.03
96	603379	三美股份	300	18,216.00	0.03
97	603969	银龙股份	1,800	18,198.00	0.03
98	300180	华峰超纤	2,600	18,018.00	0.03
99	301316	慧博云通	400	17,872.00	0.03
100	003027	同兴科技	800	17,840.00	0.03
101	000012	南玻 A	4,000	17,720.00	0.03
102	688046	药康生物	1,139	17,495.04	0.03
103	000990	诚志股份	2,200	17,424.00	0.03
104	002508	老板电器	900	17,415.00	0.03
105	601963	重庆银行	1,600	17,328.00	0.03
106	600496	精工钢构	4,100	17,015.00	0.03
107	300596	利安隆	400	16,884.00	0.03
108	688758	赛分科技	937	16,613.01	0.03
109	688116	天奈科技	349	16,455.35	0.03
110	002815	崇达技术	1,200	16,392.00	0.03
111	688677	海泰新光	378	16,314.48	0.03
112	600335	国机汽车	2,500	16,275.00	0.03
113	688236	春立医疗	711	16,267.68	0.03
114	600933	爱柯迪	800	16,080.00	0.03
115	002888	惠威科技	800	15,672.00	0.02
116	600986	浙文互联	2,000	15,640.00	0.02
117	601019	山东出版	1,800	15,552.00	0.02
118	600873	梅花生物	1,500	15,195.00	0.02
119	300170	汉得信息	800	15,136.00	0.02
120	601231	环旭电子	500	15,000.00	0.02
121	300035	中科电气	700	14,903.00	0.02
122	000923	河钢资源	700	14,819.00	0.02
123	002545	东方铁塔	800	14,760.00	0.02
124	300674	宇信科技	600	14,556.00	0.02
125	600320	振华重工	2,800	14,420.00	0.02
126	000917	电广传媒	1,400	14,392.00	0.02

127	301095	广立微	200	14,342.00	0.02
128	688549	中巨芯	1,564	14,263.68	0.02
129	002831	裕同科技	500	14,255.00	0.02
130	600908	无锡银行	2,400	14,232.00	0.02
131	301107	瑜欣电子	500	14,120.00	0.02
132	601108	财通证券	1,600	13,952.00	0.02
133	300075	数字政通	900	13,806.00	0.02
134	002626	金达威	700	13,797.00	0.02
135	600016	民生银行	3,600	13,788.00	0.02
136	300102	乾照光电	500	13,780.00	0.02
137	600057	厦门象屿	1,600	13,632.00	0.02
138	000801	四川九洲	800	13,568.00	0.02
139	688459	哈铁科技	1,400	13,510.00	0.02
140	000728	国元证券	1,600	13,360.00	0.02
141	002452	长高电新	1,600	13,168.00	0.02
142	603507	振江股份	500	13,155.00	0.02
143	300741	华宝股份	700	13,006.00	0.02
144	000703	恒逸石化	1,200	12,924.00	0.02
145	688185	康希诺	204	12,821.40	0.02
146	300447	全信股份	700	12,656.00	0.02
147	300296	利亚德	2,000	12,640.00	0.02
148	605098	行动教育	300	12,528.00	0.02
149	003015	日久光电	800	12,480.00	0.02
150	300850	新强联	300	12,411.00	0.02
151	000401	金隅冀东	2,800	12,348.00	0.02
152	601717	中创智领	500	12,275.00	0.02
153	002396	星网锐捷	400	12,120.00	0.02
154	002643	万润股份	800	11,992.00	0.02
155	002546	新联电子	1,700	11,883.00	0.02
156	301200	大族数控	100	11,877.00	0.02
157	300292	吴通控股	2,600	11,726.00	0.02
158	688085	三友医疗	648	11,676.96	0.02
159	600221	海航控股	6,400	11,584.00	0.02
160	601169	北京银行	2,100	11,508.00	0.02
161	002222	福晶科技	200	11,268.00	0.02
162	600315	上海家化	500	11,260.00	0.02
163	002440	闰土股份	1,500	11,205.00	0.02
164	603858	步长制药	700	10,948.00	0.02
165	603556	海兴电力	300	10,920.00	0.02
166	003008	开普检测	500	10,775.00	0.02
167	002987	京北方	500	10,765.00	0.02
168	600732	爱旭股份	800	10,720.00	0.02
169	301381	赛维时代	500	10,295.00	0.02
170	002690	美亚光电	500	10,285.00	0.02

171	300314	戴维医疗	800	10,064.00	0.02
172	603063	禾望电气	300	9,921.00	0.02
173	000915	华特达因	300	9,912.00	0.02
174	002056	横店东磁	500	9,750.00	0.02
175	002494	华斯股份	1,800	9,702.00	0.02
176	002539	云图控股	800	9,456.00	0.02
177	002048	宁波华翔	300	9,438.00	0.02
178	002946	新乳业	500	9,265.00	0.01
179	300286	安科瑞	400	9,232.00	0.01
180	603489	八方股份	300	9,174.00	0.01
181	002246	北化股份	500	9,010.00	0.01
182	600850	电科数字	300	8,892.00	0.01
183	002303	美盈森	2,200	8,866.00	0.01
184	002032	苏泊尔	200	8,816.00	0.01
184	003011	海象新材	400	8,816.00	0.01
186	300595	欧普康视	600	8,814.00	0.01
187	300619	金银河	200	8,780.00	0.01
188	600871	石化油服	4,000	8,640.00	0.01
189	000828	东莞控股	800	8,608.00	0.01
190	301367	瑞迈特	100	8,571.00	0.01
191	300328	宜安科技	500	8,535.00	0.01
192	600575	淮河能源	2,500	8,500.00	0.01
193	688358	祥生医疗	281	8,458.10	0.01
194	002980	华盛昌	400	8,428.00	0.01
195	600268	国电南自	800	8,384.00	0.01
196	601818	光大银行	2,400	8,376.00	0.01
197	002966	苏州银行	1,000	8,290.00	0.01
198	600776	东方通信	500	8,250.00	0.01
199	000581	威孚高科	400	8,248.00	0.01
200	002373	千方科技	700	8,239.00	0.01
201	301215	中汽股份	1,200	8,220.00	0.01
202	300389	艾比森	500	8,115.00	0.01
203	688319	欧林生物	319	8,089.84	0.01
204	000930	中粮科技	1,400	8,078.00	0.01
205	600131	国网信通	500	8,070.00	0.01
206	601928	凤凰传媒	800	8,032.00	0.01
207	300407	凯发电气	700	7,924.00	0.01
208	002408	齐翔腾达	1,600	7,808.00	0.01
209	600729	重庆百货	300	7,800.00	0.01
210	603225	新凤鸣	400	7,784.00	0.01
211	300382	斯莱克	500	7,780.00	0.01
212	300168	万达信息	1,200	7,752.00	0.01
212	603896	寿仙谷	400	7,752.00	0.01
214	300348	长亮科技	500	7,740.00	0.01

215	605567	春雪食品	700	7,700.00	0.01
216	002416	爱施德	600	7,548.00	0.01
217	002836	新宏泽	500	7,490.00	0.01
218	001286	陕西能源	800	7,448.00	0.01
219	300315	掌趣科技	1,500	7,410.00	0.01
219	300658	延江股份	500	7,410.00	0.01
221	300749	顶固集创	600	7,242.00	0.01
222	600129	太极集团	400	7,220.00	0.01
223	002014	永新股份	600	7,152.00	0.01
224	002439	启明星辰	500	7,060.00	0.01
225	000557	西部创业	1,400	6,972.00	0.01
226	688690	纳微科技	270	6,968.70	0.01
227	000563	陕国投 A	2,000	6,900.00	0.01
228	600015	华夏银行	1,000	6,870.00	0.01
229	601001	晋控煤业	500	6,575.00	0.01
230	002736	国信证券	500	6,560.00	0.01
231	600676	交运股份	1,100	6,468.00	0.01
232	601949	中国出版	1,000	6,450.00	0.01
233	002600	领益智造	400	6,216.00	0.01
234	600968	海油发展	1,600	6,144.00	0.01
235	300146	汤臣倍健	500	6,005.00	0.01
236	003022	联泓新科	300	5,943.00	0.01
237	601636	旗滨集团	1,000	5,930.00	0.01
238	000778	新兴铸管	1,400	5,852.00	0.01
239	600848	上海临港	500	5,850.00	0.01
240	600528	中铁工业	700	5,726.00	0.01
241	688329	艾隆科技	268	5,705.72	0.01
242	601808	中海油服	400	5,616.00	0.01
243	601083	锦江航运	500	5,580.00	0.01
244	600866	星湖科技	800	5,560.00	0.01
245	600663	陆家嘴	700	5,537.00	0.01
246	601901	方正证券	700	5,460.00	0.01
247	603700	宁水集团	400	5,436.00	0.01
248	688469	芯联集成	800	5,352.00	0.01
249	301227	森鹰窗业	100	5,302.00	0.01
250	603269	海鸥股份	400	5,236.00	0.01
251	002372	伟星新材	500	5,215.00	0.01
252	002653	海思科	100	5,132.00	0.01
253	300166	东方国信	500	5,110.00	0.01
254	300971	博亚精工	200	4,892.00	0.01
255	600601	方正科技	400	4,688.00	0.01
256	603599	广信股份	400	4,592.00	0.01
257	600596	新安股份	400	4,588.00	0.01
258	002033	丽江股份	500	4,575.00	0.01

259	601077	渝农商行	700	4,522.00	0.01
260	000503	国新健康	500	4,440.00	0.01
261	002298	中电鑫龙	400	4,176.00	0.01
262	300019	硅宝科技	200	4,130.00	0.01
263	000800	一汽解放	600	4,068.00	0.01
264	300254	仟源医药	400	4,048.00	0.01
265	600662	外服控股	800	4,016.00	0.01
266	002588	史丹利	400	3,992.00	0.01
267	600350	山东高速	400	3,900.00	0.01
268	600490	鹏欣资源	500	3,865.00	0.01
269	600109	国金证券	400	3,720.00	0.01
270	002467	二六三	600	3,654.00	0.01
271	000676	智度股份	400	3,452.00	0.01
272	002478	常宝股份	400	3,388.00	0.01
273	600733	北汽蓝谷	400	3,212.00	0.01
274	300928	华安鑫创	100	3,115.00	0.00
275	002376	新北洋	400	3,088.00	0.00
276	601998	中信银行	400	3,080.00	0.00
277	001259	利仁科技	100	3,001.00	0.00
278	002476	宝莫股份	400	2,896.00	0.00
279	603376	大明电子	108	2,830.68	0.00
280	001234	泰慕士	100	2,712.00	0.00
281	603866	桃李面包	500	2,630.00	0.00
282	002063	远光软件	400	2,428.00	0.00
283	600959	江苏有线	700	2,408.00	0.00
284	002903	宇环数控	100	2,300.00	0.00
285	000553	安道麦 A	400	2,192.00	0.00
286	300639	凯普生物	400	2,152.00	0.00
287	003040	楚天龙	100	2,068.00	0.00
288	603092	德力佳	36	2,003.76	0.00
289	600252	中恒集团	700	1,918.00	0.00
290	002004	华邦健康	400	1,912.00	0.00
291	300549	优德精密	100	1,886.00	0.00
292	603334	丰倍生物	57	1,870.74	0.00
293	002697	红旗连锁	300	1,782.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	--------------------

1	600519	贵州茅台	11,977,483.00	19.08
2	300750	宁德时代	9,367,482.48	14.92
3	601318	中国平安	5,561,196.00	8.86
4	600036	招商银行	4,685,229.00	7.46
5	300308	中际旭创	4,006,324.00	6.38
6	000333	美的集团	3,931,685.00	6.26
7	601899	紫金矿业	3,744,108.00	5.96
8	601166	兴业银行	3,697,959.00	5.89
9	300502	新易盛	3,490,185.00	5.56
10	300059	东方财富	3,142,581.79	5.01
11	002475	立讯精密	3,116,927.48	4.97
12	600276	恒瑞医药	3,000,991.80	4.78
13	600030	中信证券	2,897,069.00	4.61
14	600900	长江电力	2,697,070.00	4.30
15	688981	中芯国际	2,578,156.70	4.11
16	688256	寒武纪	2,447,908.13	3.90
17	688008	澜起科技	2,405,192.05	3.83
18	603259	药明康德	2,386,535.00	3.80
19	601398	工商银行	2,180,848.00	3.47
20	000858	五粮液	2,135,668.00	3.40
21	300274	阳光电源	2,053,552.00	3.27
22	000725	京东方 A	2,039,301.00	3.25
23	688041	海光信息	2,025,865.12	3.23
24	002594	比亚迪	2,006,106.00	3.20
25	600887	伊利股份	1,963,976.00	3.13
26	002714	牧原股份	1,905,091.00	3.03
27	600660	福耀玻璃	1,803,722.00	2.87
28	603986	兆易创新	1,759,293.00	2.80
29	600919	江苏银行	1,713,864.00	2.73
30	000651	格力电器	1,615,874.71	2.57
31	601288	农业银行	1,577,050.00	2.51
32	601668	中国建筑	1,570,066.00	2.50
33	002027	分众传媒	1,518,092.00	2.42
34	002463	沪电股份	1,517,650.00	2.42
35	600031	三一重工	1,506,335.00	2.40
36	300760	迈瑞医疗	1,476,226.00	2.35
37	600000	浦发银行	1,472,100.00	2.35
38	601857	中国石油	1,457,991.00	2.32
39	002049	紫光国微	1,457,661.00	2.32
40	600183	生益科技	1,436,064.90	2.29
41	603501	豪威集团	1,431,084.00	2.28
42	600150	中国船舶	1,428,885.13	2.28
43	300124	汇川技术	1,415,136.00	2.25
44	601328	交通银行	1,409,042.00	2.24

45	000063	中兴通讯	1,388,082.00	2.21
46	600104	上汽集团	1,374,632.00	2.19
47	603019	中科曙光	1,357,145.00	2.16
48	601766	中国中车	1,330,840.00	2.12
49	002415	海康威视	1,270,078.00	2.02

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	7,756,943.10	12.36
2	300308	中际旭创	3,406,629.00	5.43
3	000333	美的集团	3,112,491.00	4.96
4	300502	新易盛	2,886,077.00	4.60
5	002475	立讯精密	2,494,464.00	3.97
6	300059	东方财富	2,435,547.00	3.88
7	688256	寒武纪	2,128,906.82	3.39
8	300274	阳光电源	1,742,334.00	2.78
9	000725	京东方 A	1,728,090.00	2.75
10	002594	比亚迪	1,710,854.00	2.73
11	000858	五粮液	1,687,857.00	2.69
12	688041	海光信息	1,685,573.62	2.69
13	002714	牧原股份	1,602,681.00	2.55
14	002463	沪电股份	1,338,137.60	2.13
15	000063	中兴通讯	1,319,538.00	2.10
16	300760	迈瑞医疗	1,301,078.00	2.07
17	002049	紫光国微	1,284,815.20	2.05
18	000651	格力电器	1,267,665.00	2.02
19	000807	云铝股份	1,163,336.00	1.85
20	002027	分众传媒	1,151,198.00	1.83

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。

8.4.3 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	330,412,133.51
卖出股票收入（成交）总额	173,955,176.23

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中, 兴业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。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福建省龙岩市上杭县住房和城乡建设局的处罚。

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。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	149,434.66

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	149,434.66

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,232	49,093.34	3,914,500.00	6.47%	56,568,500.00	93.53%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张昕	1,897,800.00	3.14%
2	高仲远	1,790,500.00	2.96%
3	付晓梅	1,500,000.00	2.48%
4	上海申九资产管理有限公司	1,171,300.00	1.94%

5	尹志华	1,100,000.00	1.82%
6	胡满生	1,000,000.00	1.65%
7	牛恒亮	1,000,000.00	1.65%
8	谭凯元	1,000,000.00	1.65%
9	郑婷	1,000,000.00	1.65%
10	北京北达晶源科技发展有限公司	939,300.00	1.55%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

9.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025 年 9 月 10 日)基金份额总额	246,483,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	195,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,483,000.00

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 10 日。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担

任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。本基金管理人于 2025 年 9 月 30 日发布公告，自 2025 年 9 月 29 日起张清华先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 28,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《货币市场基金监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管部门对管理人上述方面部分制度机制不完善、规定执行不严格提出整改意见，管理人已及时通过完善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改，整改成果已经监管部门验收通过。

其他	/
----	---

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，本基金相关从业人员未受到调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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	
北京证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	61,454.08	0.01%	6.14	0.01%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	84,644,203.78	16.78%	8,465.44	16.78%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华兴证券	1	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	83,052,444.26	16.47%	8,306.20	16.47%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	22,796.00	0.00%	2.28	0.00%	-
中金公司	2	14,376,709.38	2.85%	1,436.53	2.85%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	15,912,470.57	3.16%	1,591.34	3.16%	-
中信证券	2	306,245,293.30	60.72%	30,630.42	60.73%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为国泰海通证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为北京证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、高盛（中国）证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联民生证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰海通证券股份有限公司、国新证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、华福证券股份有限公司、华兴证券有限公司、华源证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、瑞银证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、天风证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司。

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。本年度内基金证券经营机构的选择标准有调整，调整后的标准如下：

- 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。

11.7.2 基金租用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
北京证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华兴证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-11
2	易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-23
3	易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-23
4	易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证券时报	2025-09-23
5	易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-26
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-30
7	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-09-30
8	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中航证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-03
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-24
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加世纪证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-22

§ 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 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.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

二〇二六年三月三十一日