易方达中证 800 指数增强型证券投资基金

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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	易方达中证 800 增强
基金主代码	026359
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 1 月 15 日
报告期末基金份额总额	307,188,964.82 份
投资目标	本基金为指数增强型股票基金，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。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，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 0.5%，年化跟踪误差不超过 4%；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，在控制组合风险与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。本基金通过采取多个定量投资模型，力争分散模型风险，提高投资组合表现。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,本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资管理。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权，并可参与转融通证券出借业务、融资业务。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
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，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 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。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 800 增强 A	易方达中证 800 增强 C
下属分级基金的交易代码	026359	026360
报告期末下属分级基金的份额总额	224,758,362.18 份	82,430,602.64 份

§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)	
	易方达中证 800 增强 A	易方达中证 800 增强 C
1.本期已实现收益	1,207,145.78	779,227.74
2.本期利润	-17,906,279.07	-7,908,976.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0791	-0.0880
4.期末基金资产净值	223,214,771.03	81,631,837.98
5.期末基金份额净值	0.9931	0.9903

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

易方达中证 800 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	-8.33%	1.37%	-13.29%	1.37%	4.96%	0.00%
过去六个月	4.96%	1.32%	-2.00%	1.34%	6.96%	-0.02%
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	-0.69%	1.22%	-8.06%	1.26%	7.37%	-0.04%

易方达中证 800 增强 C

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	-8.43%	1.38%	-13.29%	1.37%	4.86%	0.01%
过去六个月	4.74%	1.33%	-2.00%	1.34%	6.74%	-0.01%
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	-0.97%	1.22%	-8.06%	1.26%	7.09%	-0.04%

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

易方达中证 800 指数增强型证券投资基金

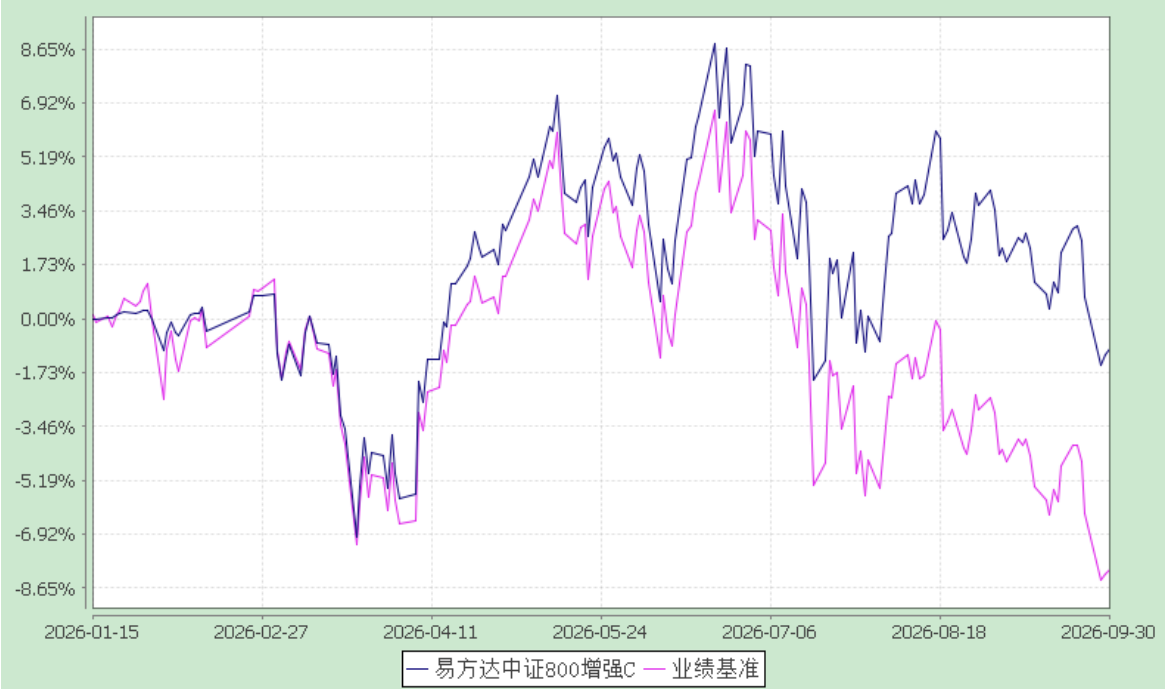
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2026 年 1 月 15 日至 2026 年 9 月 30 日）

易方达中证 800 增强 A



易方达中证 800 增强 C



注：1.本基金合同于 2026 年 1 月 15 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，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§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		
刘文贵	本基金的基金经理，易方达中证 500 量化增强、易方达智享混合的基金经理，易方达丰惠混合的基金经理助理，投资经理	2026-01-15	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任松河资本管理公司量化研究员，上海泓信投资管理有限公司衍生品投资总监，深圳市弘源泰平资产管理有限公司量化投资总监。

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
刘文贵	公募基金	3	4,973,070,672.90	2023-11-09
	私募资产管理计划	2	2,291,576,281.55	2019-04-25
	其他组合	2	3,136,875,415.71	2026-02-06
	合计	7	10,401,522,370.16	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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

进入三季度，经济运行在二季度“高开后趋稳”的基础上延续，并呈现出边际动能温和修复的迹象。截至报告期末的最新数据，7 月、8 月规模以上工业增加值同比分别约为 4.5%和 5.2%；制造业 PMI 在 9 月份录得 50.1%，重返扩张区间。支撑三季度经济的核心因素，在于稳增长政策与“两新”“两重”政策的持续显效、财政资金与专项债的加快落地，以及出口、高技术制造链条的较强韧性。与此同时，地产销售与投资仍在筑底，居民商品消费内生修复的弹性依然偏弱，三季度宏观主线由此前的“新旧动能切换”，逐步演绎为“新旧动能切换深化与稳增长政策传导形成共振”的阶段，为权益市场提供了相对平稳的宏观底色。

与一季度“天量见顶、其后成交持续萎缩”和二季度“季初低位—逐级抬升—高位运行”的放量路径不同，三季度成交额呈现“高位区间震荡、重心边际下移”的特征，在增量资金边际放缓、前期热门方向获利盘累积较大的背景下，市场进入震荡博弈加剧、波动区间收窄的阶段，交易主导逻辑也由二季度的“增量资金

支撑下的科技成长主线”，切换为“存量资金驱动下的结构再平衡”。从风格表现来看，二季度演绎至极致的“科技成长领航、价值消费掉队”的分化格局在三季度出现阶段性再平衡：前期涨幅较大的成长与主题板块短期波动明显放大，部分相对滞涨的低估值、高股息与顺周期方向获得资金的阶段性回补，市场风格由“极致分化”向“均衡回归”方向过渡；不过成长的产业趋势与比较逻辑并未根本反转，本季度的风格变化更多体现为高位震荡与筹码再平衡，而非趋势意义上的风格反转。在这样风格分化仍存、结构轮动加快的环境中，能否在严格约束组合相对基准的行业与风格偏离、减少系统性风格冲击的前提下，把握结构性轮动节奏，成为三季度模型获取稳健超额收益的核心。

本基金为指数增强型基金，主要采用基金管理人自主开发的多因子量化选股模型作为投资策略。本基金管理人以基准指数的构成为基础，严格控制组合相对基准指数的行业与风格偏离，减少系统性风格冲击，通过对个股的超低配，力求在跟踪指数的基础上，获取较为稳健的超额收益。

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 0.9931 元，本报告期份额净值增长率为-8.33%，同期业绩比较基准收益率为-13.29%；C 类基金份额净值为 0.9903 元，本报告期份额净值增长率为-8.43%，同期业绩比较基准收益率为-13.29%。年化跟踪误差 2.27%，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	257,767,635.51	84.21
	其中：股票	257,767,635.51	84.21

2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	44,425,346.95	14.51
7	其他资产	3,920,399.95	1.28
8	合计	306,113,382.41	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	225,479.00	0.07
B	采矿业	353,624.96	0.12
C	制造业	17,974,557.65	5.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	405,848.68	0.13
E	建筑业	191,828.00	0.06
F	批发和零售业	462,621.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	426,074.00	0.14
H	住宿和餐饮业	10,170.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,395,870.06	0.46
J	金融业	148,912.00	0.05
K	房地产业	263,869.00	0.09
L	租赁和商务服务业	580,297.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	247,810.00	0.08

N	水利、环境和公共设施管理业	387,312.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	438,198.00	0.14
Q	卫生和社会工作	16,614.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	35,652.00	0.01
S	综合	7,848.00	0.00
	合计	23,572,585.35	7.73

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	517,373.75	0.17
B	采矿业	12,571,274.00	4.12
C	制造业	142,171,998.61	46.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,391,985.16	2.42
E	建筑业	2,483,639.62	0.81
F	批发和零售业	2,344,461.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	6,236,045.60	2.05
H	住宿和餐饮业	299,630.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,229,772.92	3.68
J	金融业	40,802,109.10	13.38
K	房地产业	1,369,848.00	0.45
L	租赁和商务服务业	803,385.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	4,550,600.20	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	706,432.20	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	74,721.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	641,774.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	234,195,050.16	76.82

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	9,200	7,437,648.00	2.44
2	300750	宁德时代	17,500	5,094,425.00	1.67
3	600519	贵州茅台	3,758	4,729,893.96	1.55
4	601318	中国平安	83,300	4,439,057.00	1.46
5	600036	招商银行	91,800	3,787,668.00	1.24
6	603259	药明康德	22,600	3,781,884.00	1.24
7	601899	紫金矿业	126,500	3,768,435.00	1.24
8	300502	新易盛	9,193	3,576,077.00	1.17
9	000333	美的集团	36,500	2,923,650.00	0.96
10	600900	长江电力	89,174	2,545,025.96	0.83

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	48,267	1,865,519.55	0.61
2	301666	大普微	1,220	403,990.80	0.13
3	301716	鸿富诚	654	371,619.12	0.12
4	688808	联讯仪器	241	360,866.17	0.12
5	688820	盛合晶微	2,391	268,891.86	0.09

5.4 报告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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2703	IC2703	5	7,149,800.00	-171,433.33	在本报告期内，基金利用股指期货进行多头套保，以应对由于基金申购而带来的对基金净值及跟踪误差的影响。
IF2703	IF2703	14	17,783,640.00	-569,460.00	在本报告期内，基金利用股指期货进行多头套保，以应对由于基金申购而带来的对基金净值及跟踪误差的影响。
公允价值变动总额合计(元)					-740,893.33
股指期货投资本期收益(元)					-1,625,338.88
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-1,361,384.70

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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	3,633,276.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	287,123.62
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,920,399.95

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	1,865,519.55	0.61	新股流通受限
2	301666	大普微	403,990.80	0.13	新股流通受限
3	688808	联讯仪器	360,866.17	0.12	新股流通受限
4	688820	盛合晶微	268,891.86	0.09	新股流通

					受限
5	301716	鸿富诚	26,698.32	0.01	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证800增强A	易方达中证800增强C
报告期期初基金份额总额	207,122,392.11	91,913,636.82
报告期期间基金总申购份额	109,969,935.85	28,939,176.15
减：报告期期间基金总赎回份额	92,333,965.78	38,422,210.33
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	224,758,362.18	82,430,602.64

§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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

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.中国证监会准予易方达中证 800 指数增强型证券投资基金注册的文件；

2.《易方达中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达中证 800 指数增强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。

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