

易米远景量化选股股票型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:易米基金管理有限公司

基金托管人:江苏银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年3月17日（基金合同生效日）起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§8 基金份额持有人信息	75

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	75
§9 开放式基金份额变动	76
§10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议	76
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	77
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	78
10.8 其他重大事件	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息	79
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	79
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点	80
12.3 查阅方式	80

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易米远景量化选股股票型证券投资基金	
基金简称	易米远景量化选股股票	
基金主代码	025877	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026年03月17日	
基金管理人	易米基金管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	166,954,974.79份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易米远景量化选股股票A	易米远景量化选股股票C
下属分级基金的交易代码	025877	025878
报告期末下属分级基金的份额总额	159,064,639.14份	7,890,335.65份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过量化方法综合考虑标的表现，精选个股构建投资组合，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	大类资产配置策略方面，本基金将兼顾市场风险控制和收益获取，在大类资产配置策略方面，从宏观经济环境、市场流动性水平、政策因素、估值水平等方面，采取定性与定量结合的分析方法，对证券市场投资的收益与风险进行综合研判。股票投资策略方面，本基金采用量化选股策略，通过定性和定量分析相结合的方法对上市公司基本面及市场面指标等进行深入分析，精选综合评分较高的上市公司股票构建投资组合，并根据市场状况及变化，定期或不定期对模型进行调整，改进模型有效性，力争取得更高的投资回报。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易米基金管理有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	安萍	田作全
	联系电话	021-60857133	025-58588321
	电子邮箱	Anp@yimifund.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		4006-046-899	95319
传真		021-60857112	025-58588155
注册地址		上海市虹口区保定路450号9幢320室	南京市中华路26号
办公地址		上海市浦东新区杨高南路759号29层02单元	南京市中华路26号
邮政编码		200127	210001
法定代表人		李毅	袁军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.yimifund.com
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区杨高南路759号29层02单元

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易米基金管理有限公司	上海市浦东新区杨高南路759号29层02单元

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年03月17日（基金合同生效日） -
---------------	--------------------------------

	2026年06月30日)	
	易米远景量化选股股票A	易米远景量化选股股票C
本期已实现收益	4,631,748.12	106,948.03
本期利润	-136,024.67	-150,456.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0006	-0.0152
本期加权平均净值利润率	-0.06%	-1.49%
本期基金份额净值增长率	-1.51%	-1.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	-2,409,346.55	-128,505.97
期末可供分配基金份额利润	-0.0151	-0.0163
期末基金资产净值	156,655,292.59	7,761,829.68
期末基金份额净值	0.9849	0.9837
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.51%	-1.63%

注：1.本报告期自2026年3月17日（基金合同生效日）起至2026年6月30日止。

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.本报告所列示的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；

4.期末可供分配利润采用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孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易米远景量化选股股票A

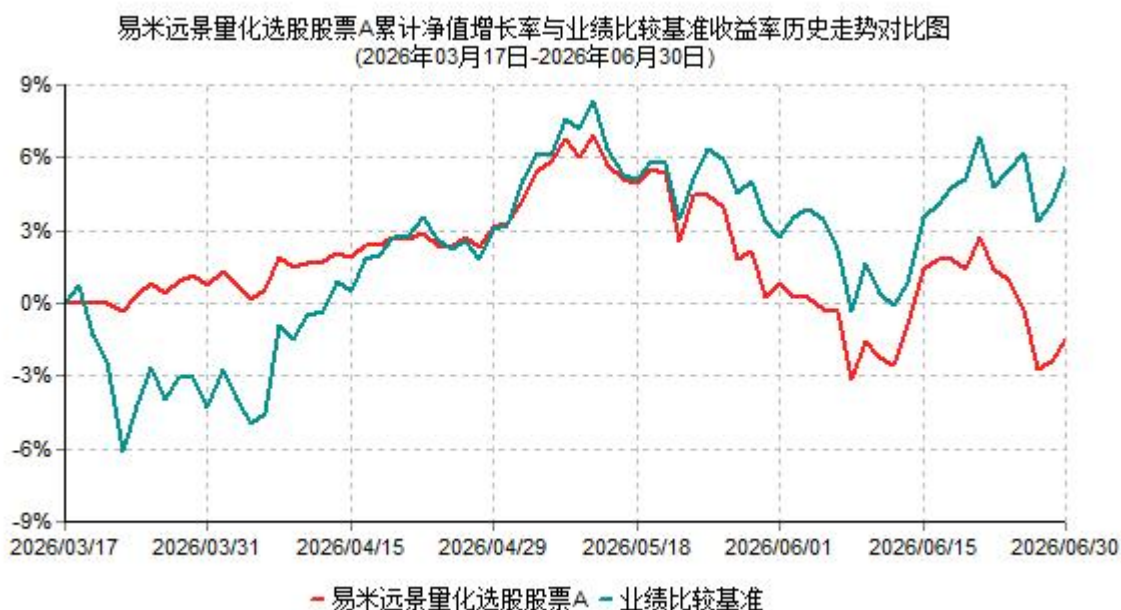
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.23%	1.03%	10.40%	1.27%	-12.63%	-0.24%
自基金合同	-1.51%	0.95%	5.63%	1.35%	-7.14%	-0.40%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

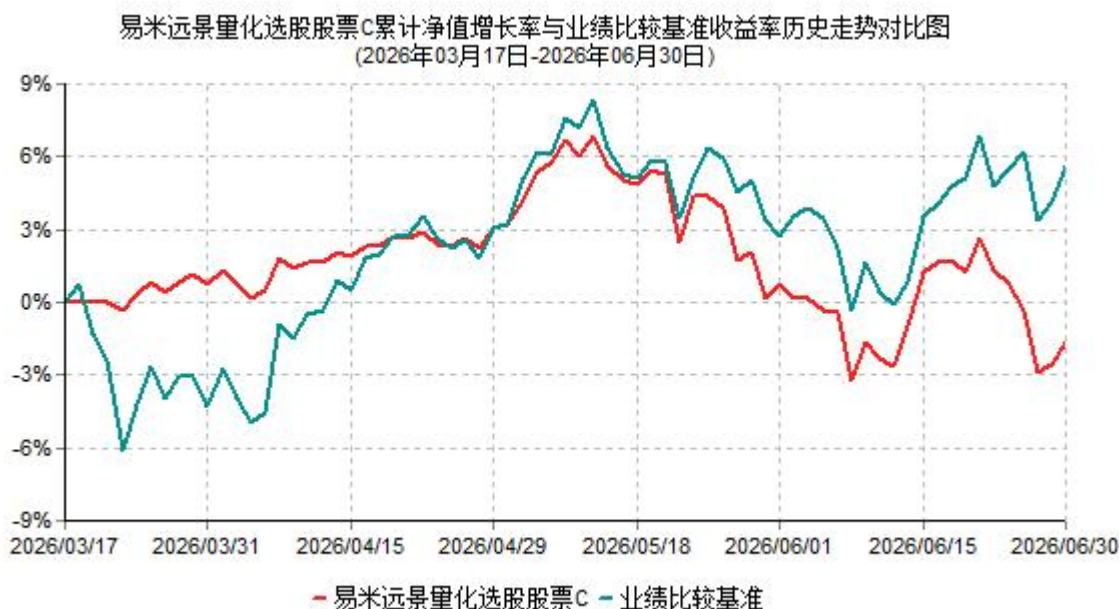
易米远景量化选股股票C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-2.33%	1.03%	10.40%	1.27%	-12.73%	-0.24%
自基金合同 生效起至今	-1.63%	0.95%	5.63%	1.35%	-7.26%	-0.40%

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



注：1.本基金基金合同于2026年3月17日生效，截至本报告披露日尚不满1年。
2.本基金建仓期为2026年3月17日至2026年5月19日。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合合同约定。



注：1.本基金基金合同于2026年3月17日生效，截至本报告披露日尚不满1年。
2.本基金建仓期为2026年3月17日至2026年5月19日。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§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

本基金管理人为易米基金管理有限公司。公司成立于2017年5月24日，2020年7月24日取得中国证监会《关于核准设立易米基金管理有限公司的批复》，2021年7月12日获得《经营证券期货业务许可证》。公司注册资本1.5亿元人民币，注册地上海市，经营范围为公开募集证券投资基金管理、私募资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2026年6月30日，易米基金管理有限公司共管理七只公募基金，为易米开鑫价值优选混合型证券投资基金、易米开泰混合型证券投资基金、易米和丰债券型证券投资基金、易米鑫选品质混合型证券投资基金、易米远见价值一年定期开放混合型证券投资基金、易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和易米远景量化选股股票型证券投资基金。

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		

魏鑫	本基金基金经理	2026-03-17	-	11	魏鑫先生，硕士研究生。曾任海默科技股份有限公司研发中心工程师，东海证券股份有限公司TMT行业组长，海通证券股份有限公司计算机行业高级研究员，华泰资产管理有限公司高级投资经理，中国旅游产业基金管理有限公司投资部副总裁，现任易米基金管理有限公司多策略投资部副总经理、基金经理。
吕晓晗	本基金基金经理	2026-03-17	-	10	吕晓晗女士，毕业于中国科学技术大学，本科学历。曾任国泰安信息技术有限公司产品经理，广州科微软件有限公司产品经理，杭州念觉资产管理有限公司基金经理、风控合规，上海念空数据科技中心（有限合伙）数据分析师、策略研究员，现任易米基金管理有限公司基金经理。

注：1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

3.本基金无基金经理助理。

4.本基金本报告期内没有基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《易米远景量化选股股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定，无违法、违规行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《易米基金管理有限公司公平交易制度》和《易米基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。本基金管理人通过建立科学的公平交易体系，将公平交易理念贯彻投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评价等环节，确保各个投资组合享有公平的投资决策机会。

报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本季度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人旗下管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情形。

报告期内，本基金管理人未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

今年上半年，中证全指、沪深300、中证500和中证1000指数分别上涨10.69%、7.55%、20.97%和15.99%，市场整体表现较好。然而从微观结构来看，A股市场表现得一波三折，远比表面呈现的要复杂得多。1月，市场在多重因素的驱动下迎来“春季躁动”行情，市场整体表现较好；2月，市场从普涨转向结构性分化行情；3月，随着美以伊冲突爆发，地缘政治局势扰动带来的高油价引发包括A股在内的全球资本市场出现大幅波动；二季度伊始，包括A股市场在内的全球资本市场开始免疫于2月底爆发的中东地缘冲突，从市场低位回暖。尽管期间市场整体表现较好，但在这期间，A股市场出现非常极致的结构化行情：期间各大宽基指数涨幅逾10%，然而在31个申万一级行业指数中，只有6个行业指数是上涨的，其余行业均录得程度不等的跌幅。

在略显复杂的市场行情中，本基金于今年3月中旬成立，并于今年5月中旬开放日常申赎，整体运作相对平稳。不过，期间A股市场趋于极致的结构化行情演绎给我们一直以来坚持的量化投资策略带来了很大的挑战，本基金的投资业绩整体不及预期。复盘这背后的原因，主要有两方面：1.量化策略往往强调行业及个股的分散，以力求积小胜为大胜，极致的结构性行情与量化策略适应的市场环境存在天然的不匹配；2.A股历史上绝大多数时候均呈现出明显的反转效应，而量化策略会充分借鉴学习历史经验，因此我

们的策略也是偏反转的，这使得我们策略在强动量的极端市场环境下表现出不适应。总结而言，业绩短期波动的最大原因还是来自于市场极致的结构化行情。然而从过去20年A股历史来看，如此极致的结构化行情是非常罕见且难以长期持续下去的。因此，与其相信“这一次不一样”，我们更相信常识，认为市场风格存在着较强的再平衡需求。鉴于此，期间我们保持了策略的一以贯之。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末易米远景量化选股股票A基金份额净值为0.9849元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.51%，同期业绩比较基准收益率为5.63%；截至报告期末易米远景量化选股股票C基金份额净值为0.9837元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.63%，同期业绩比较基准收益率为5.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A股市场在经过过去近两年时间持续的行情演绎后，市场整体波动开始逐渐放大。在这样偏高波的市场环境中，市场风格切换频繁，赚钱效应有所减弱，保持均衡配置将是较优选择。具体到本基金，未来本基金将在保持策略基本框架稳定的基础上，持续迭代策略，以期给投资者带来更优的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

为合理、公允地对基金所投资品种进行估值，保护基金份额持有人利益，本基金管理人设立估值委员会，专门负责讨论和决策基金估值的重大问题，直接向公司管理层负责，在确定公司旗下基金的估值方法、估值模型选择、估值模型假设及估值政策和程序的建立等方面为公司管理层提供参考意见，为业务部门的操作提供指导意见并对执行情况进行监督。估值委员会设主任委员一名，由公司分管运营副总经理担任，常务副主任委员一名，由运营部负责人担任，专业委员若干名，由投资、研究、交易、监察稽核、市场、运营等相关部门的指定人员组成。估值委员会的职责主要包括有：

- （1）制定、修订估值管理办法，并提交有权机构审批；
- （2）制订合理、公允的估值方法；
- （3）对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；
- （4）评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；
- （5）对是否暂停估值及是否启用摆动定价、侧袋估值等估值技术作出决定；
- （6）讨论、决定其他与估值相关的重大问题。

参与估值流程的各方还包括基金托管人和会计师事务所。基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，基金托管人有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法律法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无应说明的预警信息。

§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，本基金托管人--江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，本基金托管人--江苏银行股份有限公司未发现易米基金管理有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易米远景量化选股股票型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	11,709,359.29
结算备付金		62,885.95
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	153,975,238.38
其中：股票投资		153,970,238.10
基金投资		-
债券投资		5,000.28
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		200,552.69
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		165,948,036.31
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		1,248,387.22
应付管理人报酬		183,633.51
应付托管费		30,605.58
应付销售服务费		2,871.81
应付投资顾问费		-
应交税费		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	65,415.92
负债合计		1,530,914.04
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	166,954,974.79
未分配利润	6.4.7.8	-2,537,852.52
净资产合计		164,417,122.27
负债和净资产总计		165,948,036.31

注：1.本报告期自2026年3月17日（基金合同生效日）起至2026年6月30日止。
2.报告截止日2026年06月30日，基金份额总额166,954,974.79份。其中，A类基金份额总额159,064,639.14份，基金份额净值0.9849元；C类基金份额总额7,890,335.65份，基金份额净值0.9837元。

6.2 利润表

会计主体：易米远景量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年03月17日（基金合同生效日） 至2026年06月30日
一、营业总收入		728,993.32
1.利息收入		250,528.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	124,372.18
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		126,156.12
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,893,445.21
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,965,468.20
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	2,122.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	925,854.25
其他投资收益		-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,025,176.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	610,196.70
减：二、营业总支出		1,015,474.06
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	808,036.16
2.托管费	6.4.10.2.2	134,672.70
3.销售服务费	6.4.10.2.3	11,591.24
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-
7.税金及附加		464.20
8.其他费用	6.4.7.20	60,709.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-286,480.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-286,480.74
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-286,480.74

6.3 净资产变动表

会计主体：易米远景量化选股股票型证券投资基金

本报告期：2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	252,980,396.11	-	252,980,396.11
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-86,025,421.32	-2,537,852.52	-88,563,273.84
（一）、综合收益总额	-	-286,480.74	-286,480.74
（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）	-86,025,421.32	-2,251,371.78	-88,276,793.10
其中：1.基金申购款	27,478,153.00	877,914.75	28,356,067.75

2.基金赎回款	-113,503,574.32	-3,129,286.53	-116,632,860.85
(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	166,954,974.79	-2,537,852.52	164,417,122.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

李毅

李毅

伍军华

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易米远景量化选股股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]2225号《关于准予易米远景量化选股股票型证券投资基金注册的批复》注册,由易米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《易米远景量化选股股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币252,971,007.61元,业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2026]200Z0064号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《易米远景量化选股股票型证券投资基金基金合同》于2026年3月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为252,980,396.11份基金份额,其中认购资金利息折合9,388.50份基金份额。本基金的基金管理人为易米基金管理有限公司,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《易米远景量化选股股票型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《易米远景量化选股股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票以及存托凭证)、沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票及深港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上

市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金的股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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》、本基金基金合同和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年3月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日止期间的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2026年6月30日的财务状况以及2026年3月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为2026年3月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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主要为债券投资和资产支持证券投资，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。本基金目前暂无金融负债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。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。

6.4.4.4 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，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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。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。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所

属的类别中(该类别次于其他所有工具类别),所有工具具有相同的特征(例如它们都必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具,是指根据合同约定,持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利,或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时,自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同:(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响);(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

6.4.4.8 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。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)。

6.4.4.9 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后的净额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。

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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 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，本基金确定以下类别股票投资和债券投资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和债券，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、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、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》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，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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026年06月30日
活期存款	7,654,878.03
等于：本金	7,652,820.85
加：应计利息	2,057.18
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	4,054,481.26
等于：本金	4,054,371.02
加：应计利息	110.24
减：坏账准备	-
合计	11,709,359.29

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		158,995,414.99	-	153,970,238.10	-5,025,176.89
贵金属投资- 金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,000.00	0.28	5,000.28	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,000.00	0.28	5,000.28	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	159,000,414.99	0.28	153,975,238.38	-5,025,176.89
----	----------------	------	----------------	---------------

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4 其他债权投资

6.4.7.4.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.5 其他权益工具投资

6.4.7.5.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	516.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	16,448.02
预提费用-信息披露费	43,861.74
其他应付	4,589.22
合计	65,415.92

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 易米远景量化选股股票A

金额单位：人民币元

项目 (易米远景量化选股股票A)	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	242,719,769.67	242,719,769.67
本期申购	25,083,825.71	25,083,825.71
本期赎回（以“-”号填列）	-108,738,956.24	-108,738,956.24
本期末	159,064,639.14	159,064,639.14

6.4.7.7.2 易米远景量化选股股票C

金额单位：人民币元

项目 (易米远景量化选股股票C)	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,260,626.44	10,260,626.44
本期申购	2,394,327.29	2,394,327.29
本期赎回（以“-”号填列）	-4,764,618.08	-4,764,618.08
本期末	7,890,335.65	7,890,335.65

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润**6.4.7.8.1 易米远景量化选股股票A**

单位：人民币元

项目 (易米远景量化选股股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,631,748.12	-4,767,772.79	-136,024.67
本期基金份额交易产生的变动数	-3,421,512.00	1,148,190.12	-2,273,321.88
其中：基金申购款	1,243,837.23	-451,616.24	792,220.99
基金赎回款	-4,665,349.23	1,599,806.36	-3,065,542.87

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,210,236.12	-3,619,582.67	-2,409,346.55

6.4.7.8.2 易米远景量化选股股票C

单位：人民币元

项目 (易米远景量化选股股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	106,948.03	-257,404.10	-150,456.07
本期基金份额交易产生的 变动数	-56,050.74	78,000.84	21,950.10
其中：基金申购款	113,994.52	-28,300.76	85,693.76
基金赎回款	-170,045.26	106,301.60	-63,743.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,897.29	-179,403.26	-128,505.97

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	34,480.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	771.75
结算备付金利息收入	88,951.95
其他	167.93
合计	124,372.18

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出股票成交总额	967,080,681.71
减：卖出股票成本总额	961,997,658.16
减：交易费用	1,117,555.35
买卖股票差价收入	3,965,468.20

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至 2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	2,783.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-660.42
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,122.76

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,302,106.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,286,051.00
减：应计利息总额	11,796.50
减：交易费用	4,919.42
买卖债券差价收入	-660.42

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	925,854.25
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	925,854.25

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-5,025,176.89
——股票投资	-5,025,176.89
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-5,025,176.89

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
基金赎回费收入	585,423.62
转换费收入	24,773.08
合计	610,196.70

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，并全额计入基金财产。

2.本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日
审计费用	16,448.02
信息披露费	43,861.74
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	60,709.76

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易米基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
江苏银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本报告期，本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至
----	-----------------------------

	2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	808,036.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	393,153.01
应支付基金管理人的净管理费	414,883.15

注：1.支付基金管理人易米基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月17日（基金合同生效日）至 2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	134,672.70

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期，本基金无应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年03月17日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行股份有限公司	7,654,878.03	34,480.55

注：本基金的活期银行存款由基金托管人江苏银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内无本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功认购日	受限期	流通受	认购价	期末	数量（单	期末成	期末估	备

代码	名称			限类型	格	估值 单价	位：股)	本总额	值总额	注
001248	华润新能	2026-06-23	7个 交易日	新股 未上市	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成 本总额	期末估 值总额	备 注
118070	南芯转债	2026-06-22	14个 交易日	新债 未上市	100.00	100.01	50	5,000.00	5,000.28	-

注：1.基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2.基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3.基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4.基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌开 盘单价	数量 (股)	期末成 本总额	期末估 值总额	备 注
300332	天壕能源	2026-06-26	拟筹划重大资产重组	4.30	2026-07-09	4.64	10,600	47,510.40	45,580.00	-
603722	阿科力	2026-06-29	拟筹划重大资产重组	39.60	2026-07-06	43.56	3,200	118,759.76	126,720.00	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	拟筹划重大资产重组	832.00	2026-07-13	890.99	200	86,299.63	166,400.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，通过量化方法综合考虑标的表现，精选个股构建投资组合，以实现投资组合的积极管理与风险控制。本基金在日常经营活动中面临的与金融工具相关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在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。公司风险控制的体系由公司董事会、风险控制与审计委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各部门风险控制组成。在全面风险管理体系的框架下，董事会对有效的风险管理承担最终责任确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略。董事会下设风险控制与审计委员会，制定相应的议事规则，负责对涉及风险管控方面的专项问题进行研究指导，为董事会决策提供参考意见。公司总经理对有效的风险管理承担直接责任，负责具体执行公司日常经营管理中的风险控制工作。公司经营层下设置风险管理委员会，风险管理委员会为公司日常运作的最高风险管理机构，负责确定风险管理理念、原则、目标和方法，促进风险管理环境、文化的形成，组织风险管理体系建设，审议风险管理制度和流程，审议重大风险事件。公司监察稽核部作为独立负责风险管理的部门，负责落实市场风险、信用风险、流动性风险、合规风险的管理，监督各业务部门实施管理操作风险、声誉风险等，督促、检查各业务部门、各业务环节的风险管理工作落实情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的基金托管人江苏银行股份有限公司，其他存款存放在东方证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日
AAA	-
AAA以下	5,000.28
未评级	-
合计	5,000.28

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投

资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。本基金的基金管理人以专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力满足投资者赎回需求。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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，有效保障基金份额持有人利益。

于2026年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《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，由独立的风险管理人员对本基金的综合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2026年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计占基金资产净值的比例为0.21%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2026年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

6.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,709,359.29	-	-	-	11,709,359.29
结算备付金	62,885.95	-	-	-	62,885.95
交易性金融资产	5,000.28	-	-	153,970,238.10	153,975,238.38
应收申购款	-	-	-	200,552.69	200,552.69
资产总计	11,777,245.52	-	-	154,170,790.79	165,948,036.31
负债					

应付赎回款	-	-	-	1,248,387.22	1,248,387.22
应付管理人报酬	-	-	-	183,633.51	183,633.51
应付托管费	-	-	-	30,605.58	30,605.58
应付销售服务费	-	-	-	2,871.81	2,871.81
其他负债	-	-	-	65,415.92	65,415.92
负债总计	-	-	-	1,530,914.04	1,530,914.04
利率敏感度缺口	11,777,245.52	-	-	152,639,876.75	164,417,122.27

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例较小，因此市场利率的变动对本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。

本基金为股票型基金，通过量化方法综合考虑标的表现，精选个股构建投资组合，以实现投资组合的积极管理与风险控制，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，本基金投资于股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为80%-95%，其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产0-50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30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	153,970,238.10	93.65
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,000.28	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	153,975,238.38	93.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 2026年06月30日
	沪深300上升5%	3,899,296.28
	沪深300下降5%	-3,899,296.28

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日
第一层次	153,626,483.10
第二层次	348,755.28
第三层次	-
合计	153,975,238.38

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	153,970,238.10	92.78

	其中：股票	153,970,238.10	92.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,000.28	0.00
	其中：债券	5,000.28	0.00
	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	11,772,245.24	7.09
8	其他各项资产	200,552.69	0.12
9	合计	165,948,036.31	100.00

7.2 报告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	663,168.00	0.40
B	采矿业	12,577,453.00	7.65
C	制造业	107,732,110.65	65.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,243,071.00	2.58
E	建筑业	592,570.00	0.36
F	批发和零售业	2,440,043.27	1.48
G	交通运输、仓储和邮政业	2,714,292.00	1.65
H	住宿和餐饮业	78,624.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,712,791.55	4.08
J	金融业	7,031,660.06	4.28
K	房地产业	1,067,975.00	0.65
L	租赁和商务服务业	2,158,434.00	1.31
M	科学研究和技术服务业	2,668,901.57	1.62
N	水利、环境和公共设施管理业	2,003,645.00	1.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	98,912.00	0.06

R	文化、体育和娱乐业	874,932.00	0.53
S	综合	311,655.00	0.19
	合计	153,970,238.10	93.65

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例(%)
1	600938	中国海油	50,900	1,381,935.00	0.84
2	600030	中信证券	40,900	1,175,057.00	0.71
3	002379	宏桥控股	69,185	1,021,862.45	0.62
4	002443	金洲管道	101,000	962,530.00	0.59
5	601857	中国石油	104,900	910,532.00	0.55
6	601336	新华保险	14,700	877,002.00	0.53
7	601898	中煤能源	72,000	876,960.00	0.53
8	300862	蓝盾光电	38,400	800,256.00	0.49
9	600031	三一重工	45,700	789,696.00	0.48
10	601600	中国铝业	92,000	756,240.00	0.46
11	600989	宝丰能源	36,700	746,111.00	0.45
12	601225	陕西煤业	36,300	738,705.00	0.45
13	002415	海康威视	21,500	735,300.00	0.45
14	603400	华之杰	13,600	734,672.00	0.45
15	601127	赛力斯	11,600	710,500.00	0.43
16	600988	赤峰黄金	26,600	700,112.00	0.43
17	688146	中船特气	2,000	699,980.00	0.43
18	002023	海特高新	53,500	693,360.00	0.42
19	603501	豪威集团	7,300	692,405.00	0.42
20	600362	江西铜业	15,900	688,470.00	0.42
21	300804	广康生化	22,000	687,720.00	0.42
22	600426	华鲁恒升	28,700	686,504.00	0.42
23	601012	隆基绿能	51,200	671,744.00	0.41
24	002449	国星光电	85,900	665,725.00	0.40
25	301560	众捷汽车	24,700	660,231.00	0.40

26	300616	尚品宅配	62,000	646,040.00	0.39
27	601601	中国太保	22,100	630,292.00	0.38
28	301040	中环海陆	25,800	628,746.00	0.38
29	000967	盈峰环境	59,500	626,535.00	0.38
30	000807	云铝股份	28,200	624,348.00	0.38
31	000933	神火股份	29,100	616,920.00	0.38
32	600547	山东黄金	26,600	614,194.00	0.37
33	002545	东方铁塔	37,300	605,006.00	0.37
34	002602	世纪华通	42,400	597,840.00	0.36
35	601168	西部矿业	22,000	597,080.00	0.36
36	601728	中国电信	114,000	591,660.00	0.36
37	300450	先导智能	14,500	590,440.00	0.36
38	603993	洛阳钼业	33,600	589,680.00	0.36
39	301365	矩阵股份	15,500	587,605.00	0.36
40	600438	通威股份	48,500	587,335.00	0.36
41	300164	通源石油	72,900	583,200.00	0.35
42	002870	香山股份	14,900	574,246.00	0.35
43	601231	环旭电子	17,700	573,480.00	0.35
44	002034	旺能环境	37,700	571,155.00	0.35
45	000720	新能泰山	154,000	568,260.00	0.35
46	603112	华翔股份	33,500	560,455.00	0.34
47	601111	中国国航	91,800	555,390.00	0.34
48	000776	广发证券	23,700	554,580.00	0.34
49	603381	永臻股份	35,900	553,219.00	0.34
50	002706	良信股份	50,400	549,864.00	0.33
51	601899	紫金矿业	21,800	548,052.00	0.33
52	000977	浪潮信息	7,800	546,000.00	0.33
53	603777	来伊份	34,900	541,997.00	0.33
54	301007	德迈仕	17,700	541,620.00	0.33
55	001233	海安集团	12,100	540,870.00	0.33
56	002155	湖南黄金	22,500	537,075.00	0.33
57	600683	京投发展	46,600	535,900.00	0.33
58	000878	云南铜业	33,300	528,804.00	0.32

59	300956	英力股份	46,000	517,040.00	0.31
60	002012	凯恩股份	80,300	514,723.00	0.31
61	600029	南方航空	98,500	510,230.00	0.31
62	605077	华康股份	46,100	498,341.00	0.30
63	603790	雅运股份	23,200	495,088.00	0.30
64	600188	兖矿能源	27,800	494,006.00	0.30
65	600875	东方电气	17,000	489,090.00	0.30
66	301636	泽润新能	11,600	488,476.00	0.30
67	002723	小崧股份	55,000	486,200.00	0.30
68	001306	夏厦精密	8,900	485,673.00	0.30
69	000858	五 粮 液	6,500	481,000.00	0.29
70	301291	明阳电气	13,300	478,667.00	0.29
71	002532	天山铝业	44,300	475,339.00	0.29
72	003002	壶化股份	27,300	474,747.00	0.29
73	002757	南兴股份	26,100	471,105.00	0.29
74	605499	东鹏饮料	3,800	469,034.00	0.29
75	300828	锐新科技	23,100	466,389.00	0.28
76	000509	华塑控股	124,000	462,520.00	0.28
77	002899	英派斯	21,100	459,980.00	0.28
78	002478	常宝股份	73,800	456,084.00	0.28
79	300059	东方财富	22,337	455,228.06	0.28
80	600219	南山铝业	113,900	454,461.00	0.28
81	300118	东方日升	36,300	451,935.00	0.27
82	002465	海格通信	35,300	450,781.00	0.27
83	001300	三柏硕	39,800	449,740.00	0.27
84	601211	国泰海通	24,700	449,540.00	0.27
85	600115	中国东航	117,900	449,199.00	0.27
86	002798	帝欧水华	90,000	449,100.00	0.27
87	603816	顾家家居	20,000	447,200.00	0.27
88	603222	济民健康	52,200	441,090.00	0.27
89	002714	牧原股份	12,600	440,874.00	0.27
90	000593	德龙汇能	20,500	438,290.00	0.27
91	600418	江淮汽车	16,800	433,944.00	0.26

92	600803	新奥股份	27,200	429,760.00	0.26
93	603985	恒润股份	17,700	425,154.00	0.26
94	601398	工商银行	59,800	422,786.00	0.26
95	001225	和泰机电	10,700	422,757.00	0.26
96	301027	华蓝集团	20,400	422,076.00	0.26
97	601778	晶科科技	97,900	420,970.00	0.26
98	001367	海森药业	22,600	416,518.00	0.25
99	002623	亚玛顿	26,300	410,806.00	0.25
100	600711	盛屯矿业	37,400	410,278.00	0.25
101	001230	劲旅环境	26,600	408,576.00	0.25
102	601088	中国神华	10,400	406,016.00	0.25
103	600150	中国船舶	11,900	402,101.00	0.24
104	002131	利欧股份	84,600	401,850.00	0.24
105	301212	联盛化学	17,200	401,620.00	0.24
106	002142	宁波银行	13,500	400,815.00	0.24
107	002270	华明装备	21,200	399,620.00	0.24
108	300203	聚光科技	28,700	396,921.00	0.24
109	603353	和顺石油	10,300	395,726.00	0.24
110	605166	聚合顺	41,100	394,149.00	0.24
111	000425	徐工机械	48,400	391,556.00	0.24
112	000975	山金国际	22,900	389,300.00	0.24
113	603391	力聚热能	7,100	386,098.00	0.23
114	000635	英力特	63,700	384,748.00	0.23
115	002049	紫光国微	4,300	381,625.00	0.23
116	603185	弘元绿能	22,600	377,194.00	0.23
117	603158	腾龙股份	30,700	375,461.00	0.23
118	002001	新和成	13,200	375,144.00	0.23
119	601919	中远海控	28,100	372,606.00	0.23
120	301151	冠龙节能	22,500	371,250.00	0.23
121	601702	华峰铝业	26,300	370,830.00	0.23
122	600714	金瑞矿业	18,000	369,540.00	0.22
123	000630	铜陵有色	57,700	366,972.00	0.22
124	601888	中国中免	6,800	365,228.00	0.22

125	002840	华统股份	49,900	363,771.00	0.22
126	301257	普蕊斯	8,000	363,040.00	0.22
127	301606	绿联科技	5,900	360,018.00	0.22
128	002682	龙洲股份	84,900	359,976.00	0.22
129	003030	祖名股份	17,500	359,625.00	0.22
130	000782	恒申新材	44,400	358,752.00	0.22
131	301158	德石股份	27,100	357,449.00	0.22
132	301148	嘉戎技术	6,700	356,842.00	0.22
133	000060	中金岭南	46,900	355,033.00	0.22
134	002455	百川股份	49,200	354,240.00	0.22
135	600660	福耀玻璃	7,000	353,080.00	0.21
136	600489	中金黄金	19,500	351,975.00	0.21
137	002092	中泰化学	91,800	351,594.00	0.21
138	300901	中胤时尚	23,800	351,526.00	0.21
139	000568	泸州老窖	4,500	348,840.00	0.21
140	603926	铁流股份	19,600	346,724.00	0.21
141	300911	亿田智能	16,300	346,375.00	0.21
142	603278	大业股份	31,800	345,666.00	0.21
143	603058	永吉股份	39,600	344,916.00	0.21
144	001268	联合精密	9,700	343,574.00	0.21
145	603798	康普顿	24,900	340,632.00	0.21
146	605055	迎丰股份	33,200	338,640.00	0.21
147	002078	太阳纸业	27,000	337,230.00	0.21
148	001317	三羊马	8,500	336,430.00	0.20
149	603320	迪贝电气	19,200	335,040.00	0.20
150	603200	上海洗霸	7,700	333,872.00	0.20
151	688549	中巨芯	9,025	332,210.25	0.20
152	600986	浙文互联	47,300	330,154.00	0.20
153	000338	潍柴动力	12,100	329,725.00	0.20
154	301203	国泰环保	7,800	329,550.00	0.20
155	002400	省广集团	52,200	329,382.00	0.20
156	002454	松芝股份	68,800	328,864.00	0.20
157	301220	亚香股份	10,200	328,644.00	0.20

158	600309	万华化学	4,800	328,368.00	0.20
159	603070	万控智造	26,100	328,338.00	0.20
160	002918	蒙娜丽莎	32,400	325,620.00	0.20
161	002997	瑞鹄模具	11,800	325,208.00	0.20
162	002380	科远智慧	9,500	324,710.00	0.20
163	601985	中国核电	35,800	323,274.00	0.20
164	002981	朝阳科技	17,500	322,700.00	0.20
165	600926	杭州银行	22,200	320,790.00	0.20
166	605319	无锡振华	14,000	317,660.00	0.19
167	002462	嘉事堂	29,600	317,608.00	0.19
168	300084	海默科技	26,200	315,186.00	0.19
169	300991	创益通	8,900	313,369.00	0.19
170	600620	天宸股份	78,900	311,655.00	0.19
171	002703	浙江世宝	21,900	311,637.00	0.19
172	002625	光启技术	10,200	309,264.00	0.19
173	001333	光华股份	16,900	308,763.00	0.19
174	600963	岳阳林纸	101,500	308,560.00	0.19
175	002753	永东股份	54,600	308,490.00	0.19
176	603655	朗博科技	10,700	304,843.00	0.19
177	002519	银河电子	52,100	304,785.00	0.19
178	688082	盛美上海	700	302,400.00	0.18
179	000586	汇源通信	22,400	295,904.00	0.18
180	002767	先锋电子	17,700	293,289.00	0.18
181	603048	浙江黎明	16,500	292,710.00	0.18
182	301026	浩通科技	14,420	291,572.40	0.18
183	600449	宁夏建材	25,900	289,562.00	0.18
184	300696	爱乐达	11,100	288,933.00	0.18
185	601615	明阳智能	24,900	288,093.00	0.18
186	301028	鼎熔岩	17,900	285,684.00	0.17
187	000968	蓝焰控股	47,300	283,327.00	0.17
188	000733	振华科技	5,000	283,200.00	0.17
189	002779	中坚科技	3,600	282,816.00	0.17
190	300959	线上线下	1,900	280,839.00	0.17

191	600158	中体产业	41,600	280,384.00	0.17
192	601939	建设银行	28,900	278,307.00	0.17
193	603159	上海亚虹	16,100	278,047.00	0.17
194	002128	电投能源	12,000	277,440.00	0.17
195	600299	安迪苏	35,000	274,750.00	0.17
196	300955	嘉亨家化	7,600	274,284.00	0.17
197	600855	航天长峰	19,700	274,027.00	0.17
198	300984	金沃股份	5,100	274,023.00	0.17
199	002444	巨星科技	8,800	273,680.00	0.17
200	603062	麦加芯彩	6,800	273,020.00	0.17
201	300058	蓝色光标	19,800	272,448.00	0.17
202	603997	继峰股份	22,900	270,907.00	0.16
203	600785	新华百货	27,640	270,872.00	0.16
204	301265	华新科技	9,800	269,990.00	0.16
205	000893	亚钾国际	6,600	269,874.00	0.16
206	002931	锋龙股份	3,900	269,022.00	0.16
207	600027	华电国际	60,400	268,780.00	0.16
208	601058	赛轮轮胎	23,300	268,649.00	0.16
209	600595	中孚实业	47,800	268,636.00	0.16
210	603556	海兴电力	12,200	268,400.00	0.16
211	301280	珠城科技	5,300	268,021.00	0.16
212	601212	白银有色	52,600	267,208.00	0.16
213	603698	航天工程	6,900	266,064.00	0.16
214	002886	沃特股份	9,400	264,046.00	0.16
215	603599	广信股份	27,300	261,534.00	0.16
216	003019	宸展光电	8,000	260,400.00	0.16
217	000601	韶能股份	44,400	259,740.00	0.16
218	301081	严牌股份	18,900	258,552.00	0.16
219	300568	星源材质	13,800	258,336.00	0.16
220	601628	中国人寿	7,300	258,055.00	0.16
221	002515	金字火腿	25,600	256,256.00	0.16
222	002938	鹏鼎控股	2,400	252,912.00	0.15
223	603093	南华期货	13,900	252,285.00	0.15

224	000007	全新好	20,300	251,720.00	0.15
225	603311	金海高科	6,800	249,220.00	0.15
226	600032	浙江新能	35,200	248,160.00	0.15
227	601858	中国科传	14,300	247,533.00	0.15
228	300779	惠城环保	4,920	246,984.00	0.15
229	002782	可立克	11,700	246,285.00	0.15
230	002027	分众传媒	50,600	244,904.00	0.15
231	300022	吉峰科技	31,400	243,978.00	0.15
232	002242	九阳股份	31,000	243,660.00	0.15
233	603095	越剑智能	17,000	243,440.00	0.15
234	002683	广东宏大	8,300	243,107.00	0.15
235	600389	江山股份	12,400	242,048.00	0.15
236	300393	中来股份	33,200	242,028.00	0.15
237	301221	光庭信息	8,100	239,031.00	0.15
238	300629	新劲刚	11,118	238,592.28	0.15
239	600292	电投水电	19,600	235,984.00	0.14
240	603867	新化股份	7,000	234,430.00	0.14
241	301012	扬电科技	9,900	232,551.00	0.14
242	688120	华海清科	720	231,969.60	0.14
243	002396	星网锐捷	12,100	231,957.00	0.14
244	000039	中集集团	28,600	231,946.00	0.14
245	002600	领益智造	13,300	230,622.00	0.14
246	301518	长华化学	8,800	230,560.00	0.14
247	603296	华勤技术	3,100	230,237.00	0.14
248	603786	科博达	5,600	229,096.00	0.14
249	300766	每日互动	10,700	228,980.00	0.14
250	600391	航发科技	6,800	227,460.00	0.14
251	002432	九安医疗	3,200	226,176.00	0.14
252	000617	中油资本	34,100	224,719.00	0.14
253	002887	绿茵生态	21,400	224,058.00	0.14
254	002531	天顺风能	26,500	223,395.00	0.14
255	300677	英科医疗	5,700	223,269.00	0.14
256	301193	家联科技	12,000	222,480.00	0.14

257	002036	联创电子	29,300	221,801.00	0.13
258	000767	晋控电力	57,700	220,991.00	0.13
259	002442	龙星科技	44,700	220,371.00	0.13
260	688630	芯碁微装	400	219,756.00	0.13
261	000534	万泽股份	8,000	218,880.00	0.13
262	688008	澜起科技	700	216,930.00	0.13
263	300437	清水源	19,200	216,192.00	0.13
264	300781	因赛集团	8,200	216,152.00	0.13
265	001332	锡装股份	5,500	215,985.00	0.13
266	688432	有研硅	5,393	215,558.21	0.13
267	688361	中科飞测	500	215,000.00	0.13
268	688396	华润微	2,200	214,610.00	0.13
269	002218	拓日新能	55,200	211,968.00	0.13
270	002638	勤上股份	47,600	210,392.00	0.13
271	300695	兆丰股份	4,200	209,118.00	0.13
272	605162	新中港	27,100	208,941.00	0.13
273	300608	思特奇	20,300	208,887.00	0.13
274	002677	浙江美大	37,700	208,481.00	0.13
275	300351	永贵电器	12,600	207,900.00	0.13
276	600900	长江电力	7,800	206,466.00	0.13
277	002571	德力股份	20,000	206,200.00	0.13
278	301085	亚康股份	3,400	206,074.00	0.13
279	002895	川恒股份	6,900	201,480.00	0.12
280	000786	北新建材	11,100	200,799.00	0.12
281	300834	星辉环材	4,800	200,640.00	0.12
282	002506	协鑫集成	62,900	200,022.00	0.12
283	300777	中简科技	7,600	199,728.00	0.12
284	301035	润丰股份	4,300	199,520.00	0.12
285	000792	盐湖股份	6,600	199,254.00	0.12
286	600103	青山纸业	64,900	199,243.00	0.12
287	000688	国城矿业	5,800	198,534.00	0.12
288	300767	震安科技	8,900	198,381.00	0.12
289	688531	日联科技	1,100	195,624.00	0.12

290	600800	渤海化学	60,100	194,123.00	0.12
291	601166	兴业银行	11,700	193,752.00	0.12
292	600486	扬农化工	3,800	192,660.00	0.12
293	002340	格林美	29,100	192,351.00	0.12
294	688729	屹唐股份	4,453	191,479.00	0.12
295	000100	TCL科技	32,900	191,478.00	0.12
296	688003	天准科技	1,500	190,950.00	0.12
297	600089	特变电工	8,400	189,000.00	0.11
298	601699	潞安环能	13,200	188,496.00	0.11
299	688025	杰普特	400	188,000.00	0.11
300	688012	中微公司	396	185,526.00	0.11
301	000935	四川双马	7,100	185,239.00	0.11
302	300296	利亚德	32,900	184,240.00	0.11
303	603486	科沃斯	3,600	182,700.00	0.11
304	600319	亚星化学	29,300	182,539.00	0.11
305	002241	歌尔股份	8,100	182,493.00	0.11
306	300748	金力永磁	5,900	182,015.00	0.11
307	002429	兆驰股份	17,500	181,825.00	0.11
308	000955	欣龙控股	41,400	181,746.00	0.11
309	300170	汉得信息	11,900	181,356.00	0.11
310	301157	华塑科技	2,900	181,192.00	0.11
311	301325	曼恩斯特	5,200	179,140.00	0.11
312	002769	普路通	27,300	178,269.00	0.11
313	688235	百济神州	700	178,227.00	0.11
314	601155	新城控股	17,200	176,472.00	0.11
315	603076	乐惠国际	8,500	176,120.00	0.11
316	688037	芯源微	400	175,620.00	0.11
317	603833	欧派家居	5,800	174,638.00	0.11
318	002940	昂利康	6,600	174,306.00	0.11
319	300456	赛微电子	4,100	174,127.00	0.11
320	301125	腾亚精工	12,080	173,468.80	0.11
321	603683	晶华新材	5,600	172,592.00	0.10
322	300199	翰宇药业	7,800	172,224.00	0.10

323	688001	华兴源创	2,000	171,400.00	0.10
324	600999	招商证券	8,100	170,910.00	0.10
325	688017	绿的谐波	400	167,144.00	0.10
326	002328	新朋股份	22,700	166,618.00	0.10
327	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.10
328	300982	苏文电能	11,000	166,210.00	0.10
329	301152	天力锂能	7,000	165,690.00	0.10
330	603999	读者传媒	33,100	165,500.00	0.10
331	002054	德美化工	24,400	162,260.00	0.10
332	001288	运机集团	6,800	161,772.00	0.10
333	300775	三角防务	7,339	161,751.56	0.10
334	002355	兴民智通	37,400	160,820.00	0.10
335	300369	绿盟科技	29,500	160,480.00	0.10
336	688663	新风光	1,800	159,228.00	0.10
337	300124	汇川技术	2,400	159,192.00	0.10
338	688981	中芯国际	1,000	158,820.00	0.10
339	301595	太力科技	4,000	158,400.00	0.10
340	300451	创业慧康	49,300	157,760.00	0.10
341	301590	优优绿能	1,200	157,740.00	0.10
342	300902	国安达	9,600	157,344.00	0.10
343	300972	万辰集团	900	156,069.00	0.09
344	301118	恒光股份	5,700	155,211.00	0.09
345	603799	华友钴业	3,200	154,432.00	0.09
346	600482	中国动力	4,700	154,160.00	0.09
347	300988	津荣天宇	9,820	153,486.60	0.09
348	688409	富创精密	500	153,125.00	0.09
349	300769	德方纳米	2,300	152,950.00	0.09
350	001203	大中矿业	5,100	152,745.00	0.09
351	605068	明新旭腾	9,100	152,698.00	0.09
352	002169	智光电气	10,300	150,792.00	0.09
353	600880	博瑞传播	40,700	150,590.00	0.09
354	688629	华丰科技	800	150,008.00	0.09
355	688111	金山办公	700	149,135.00	0.09

356	002413	雷科防务	15,200	148,352.00	0.09
357	688041	海光信息	400	148,120.00	0.09
358	000938	紫光股份	5,100	147,186.00	0.09
359	688300	联瑞新材	600	146,640.00	0.09
360	688545	兴福电子	1,100	146,366.00	0.09
361	000572	海马汽车	39,500	146,150.00	0.09
362	002375	亚厦股份	43,200	146,016.00	0.09
363	000408	藏格矿业	2,100	145,572.00	0.09
364	002237	恒邦股份	9,900	145,431.00	0.09
365	000506	招金黄金	12,300	144,156.00	0.09
366	601965	中国汽研	12,000	143,520.00	0.09
367	688627	精智达	200	143,000.00	0.09
368	301509	金凯生科	4,700	142,927.00	0.09
369	601668	中国建筑	32,800	142,352.00	0.09
370	688777	中控技术	1,200	141,000.00	0.09
371	600585	海螺水泥	8,300	140,685.00	0.09
372	002416	爱施德	15,700	140,672.00	0.09
373	300830	金现代	17,700	140,538.00	0.09
374	600011	华能国际	18,500	140,415.00	0.09
375	301180	万祥科技	11,200	140,336.00	0.09
376	688059	华锐精密	700	139,797.00	0.09
377	601677	明泰铝业	8,400	139,440.00	0.08
378	301598	博科测试	2,800	138,656.00	0.08
379	688368	晶丰明源	640	138,572.80	0.08
380	300609	汇纳科技	4,400	138,248.00	0.08
381	301121	紫建电子	4,300	137,686.00	0.08
382	002153	石基信息	18,900	136,647.00	0.08
383	002879	长缆科技	10,400	136,552.00	0.08
384	605028	世茂能源	6,400	136,320.00	0.08
385	300737	科顺股份	20,500	134,685.00	0.08
386	688167	炬光科技	380	134,599.80	0.08
387	688347	华虹宏力	400	134,520.00	0.08
388	603279	景津装备	11,200	134,400.00	0.08

389	301016	雷尔伟	9,600	134,112.00	0.08
390	000830	鲁西化工	11,100	133,200.00	0.08
391	002331	皖通科技	17,900	132,281.00	0.08
392	000020	深华发 A	12,100	131,890.00	0.08
393	603336	宏辉果蔬	16,600	131,472.00	0.08
394	603626	科森科技	7,100	131,350.00	0.08
395	000565	渝三峡 A	23,100	131,208.00	0.08
396	688322	奥比中光	1,000	130,550.00	0.08
397	605196	华通线缆	5,000	130,500.00	0.08
398	688372	伟测科技	700	130,200.00	0.08
399	600873	梅花生物	17,700	130,095.00	0.08
400	688079	美迪凯	4,228	130,011.00	0.08
401	301172	君逸数码	5,000	129,750.00	0.08
402	001311	多利科技	8,040	129,685.20	0.08
403	301181	标榜股份	5,600	129,584.00	0.08
404	688147	微导纳米	800	129,504.00	0.08
405	688662	富信科技	770	129,360.00	0.08
406	603722	阿科力	3,200	126,720.00	0.08
407	002150	正泰电源	5,000	126,450.00	0.08
408	688728	格科微	5,962	125,440.48	0.08
409	603878	武进不锈	24,400	125,416.00	0.08
410	603360	百傲化学	7,700	125,356.00	0.08
411	603596	伯特利	5,000	124,200.00	0.08
412	688002	睿创微纳	800	123,752.00	0.08
413	600601	方正科技	8,900	123,176.00	0.07
414	688403	汇成股份	3,100	123,070.00	0.07
415	688138	清溢光电	2,600	122,200.00	0.07
416	301093	华兰股份	900	122,067.00	0.07
417	300752	隆利科技	9,000	121,230.00	0.07
418	688757	胜科纳米	1,801	120,126.70	0.07
419	000159	国际实业	22,200	119,436.00	0.07
420	301589	诺瓦星云	800	119,184.00	0.07
421	300798	锦鸡股份	18,100	118,193.00	0.07

422	300750	宁德时代	300	117,903.00	0.07
423	300552	万集科技	5,100	116,535.00	0.07
424	688530	欧莱新材	1,200	116,280.00	0.07
425	688052	纳芯微	400	115,324.00	0.07
426	688478	晶升股份	1,299	115,026.45	0.07
427	603829	洛凯股份	7,000	114,590.00	0.07
428	300559	佳发教育	11,100	113,553.00	0.07
429	603092	德力佳	2,100	113,337.00	0.07
430	300440	运达科技	5,300	113,049.00	0.07
431	603619	中曼石油	6,000	112,260.00	0.07
432	002759	ST天际	4,600	112,194.00	0.07
433	001208	华菱线缆	7,900	112,101.00	0.07
434	000426	兴业银锡	3,400	112,064.00	0.07
435	688456	有研粉材	800	111,680.00	0.07
436	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.07
437	300784	利安科技	2,600	110,162.00	0.07
438	601616	广电电气	32,200	109,802.00	0.07
439	688028	沃尔德	700	109,109.00	0.07
440	605218	伟时电子	6,600	109,098.00	0.07
441	000690	宝新能源	23,200	109,040.00	0.07
442	600409	三友化工	17,800	108,758.00	0.07
443	688019	安集科技	320	108,627.20	0.07
444	002595	豪迈科技	2,300	107,180.00	0.07
445	688213	思特威	1,000	107,070.00	0.07
446	002912	中新赛克	5,800	106,952.00	0.07
447	600985	淮北矿业	7,600	106,780.00	0.06
448	001280	中国铀业	1,600	106,720.00	0.06
449	688123	聚辰股份	500	106,300.00	0.06
450	688610	埃科光电	400	105,360.00	0.06
451	301500	飞南资源	4,000	104,200.00	0.06
452	300970	华绿生物	5,700	104,196.00	0.06
453	301190	善水科技	6,400	102,592.00	0.06
454	002130	沃尔核材	5,400	102,384.00	0.06

455	001360	南矿集团	5,700	100,833.00	0.06
456	601318	中国平安	2,100	100,254.00	0.06
457	301189	奥尼电子	1,700	100,181.00	0.06
458	688220	翱捷科技	800	99,456.00	0.06
459	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.06
460	603882	金域医学	4,400	98,912.00	0.06
461	301222	浙江恒威	3,300	98,868.00	0.06
462	688337	普源精电	1,300	97,409.00	0.06
463	688596	正帆科技	1,219	96,374.14	0.06
464	300848	美瑞新材	6,900	96,255.00	0.06
465	688187	时代电气	1,400	96,124.00	0.06
466	600328	中盐化工	16,000	96,000.00	0.06
467	002297	博云新材	3,300	95,667.00	0.06
468	301283	聚胶股份	3,900	95,472.00	0.06
469	002850	科达利	500	94,650.00	0.06
470	301067	显盈科技	2,500	94,550.00	0.06
471	300418	昆仑万维	2,300	92,828.00	0.06
472	603612	索通发展	5,100	92,463.00	0.06
473	000547	航天发展	4,800	91,920.00	0.06
474	002947	恒铭达	1,200	91,260.00	0.06
475	300986	志特新材	5,300	90,895.00	0.06
476	002104	恒宝股份	8,800	90,728.00	0.06
477	301088	戎美股份	7,900	90,534.00	0.06
478	002402	和而泰	3,500	90,405.00	0.05
479	300092	科新机电	7,700	88,858.00	0.05
480	000710	贝瑞基因	11,800	88,028.00	0.05
481	688257	新锐股份	860	87,634.00	0.05
482	000936	华西股份	16,500	87,450.00	0.05
483	600513	联环药业	6,000	87,240.00	0.05
484	688234	天岳先进	500	86,755.00	0.05
485	603585	苏利股份	6,300	86,121.00	0.05
486	301119	正强股份	3,500	85,890.00	0.05
487	600410	华胜天成	5,400	85,482.00	0.05

488	000546	金圆股份	17,400	84,564.00	0.05
489	300063	天龙集团	9,700	84,196.00	0.05
490	603701	德宏股份	3,800	83,524.00	0.05
491	603110	东方材料	3,600	83,412.00	0.05
492	603165	荣晟环保	6,400	83,392.00	0.05
493	688205	德科立	400	83,276.00	0.05
494	688035	德邦科技	900	82,620.00	0.05
495	688352	硕中科技	3,391	81,994.38	0.05
496	688563	航材股份	1,600	81,968.00	0.05
497	002903	宇环数控	1,800	81,756.00	0.05
498	300578	会畅科技	4,700	81,733.00	0.05
499	002497	雅化集团	4,000	81,480.00	0.05
500	300903	科翔股份	800	81,048.00	0.05
501	688271	联影医疗	800	80,984.00	0.05
502	688677	海泰新光	800	80,904.00	0.05
503	300246	宝莱特	5,700	80,199.00	0.05
504	688652	京仪装备	400	80,068.00	0.05
505	300274	阳光电源	500	79,510.00	0.05
506	688199	久日新材	2,300	79,419.00	0.05
507	688301	奕瑞科技	640	79,360.00	0.05
508	688009	中国通号	16,646	79,234.96	0.05
509	002246	北化股份	4,200	78,960.00	0.05
510	600258	首旅酒店	7,200	78,624.00	0.05
511	300724	捷佳伟创	1,100	77,660.00	0.05
512	688107	安路科技	1,700	77,520.00	0.05
513	688036	传音控股	1,300	76,635.00	0.05
514	605303	园林股份	3,300	75,405.00	0.05
515	688383	新益昌	400	75,216.00	0.05
516	603578	三星新材	6,400	75,200.00	0.05
517	300683	海特生物	3,000	75,030.00	0.05
518	300994	久祺股份	7,000	74,690.00	0.05
519	002244	滨江集团	9,800	74,480.00	0.05
520	603160	汇顶科技	1,200	74,052.00	0.05

521	688388	嘉元科技	1,675	73,700.00	0.04
522	300669	沪宁股份	2,800	73,640.00	0.04
523	688112	鼎阳科技	1,000	73,460.00	0.04
524	688100	威胜信息	2,400	73,416.00	0.04
525	688536	思瑞浦	200	72,818.00	0.04
526	601816	京沪高铁	16,000	72,480.00	0.04
527	301667	纳百川	1,000	72,320.00	0.04
528	688583	思看科技	840	72,046.80	0.04
529	300055	万邦达	11,200	72,016.00	0.04
530	002636	金安国纪	600	71,982.00	0.04
531	301631	壹连科技	1,000	71,860.00	0.04
532	601229	上海银行	8,200	71,176.00	0.04
533	603248	锡华科技	3,360	70,862.40	0.04
534	300575	中旗股份	14,400	70,848.00	0.04
535	601918	新集能源	8,100	69,579.00	0.04
536	688726	拉普拉斯	1,300	68,705.00	0.04
537	000983	山西焦煤	11,800	68,440.00	0.04
538	688179	阿拉丁	2,447	67,806.37	0.04
539	688686	奥普特	400	67,356.00	0.04
540	605305	中际联合	1,600	67,072.00	0.04
541	688608	恒玄科技	400	66,876.00	0.04
542	002986	宇新股份	5,600	66,248.00	0.04
543	002350	北京科锐	4,900	66,199.00	0.04
544	000607	华媒控股	21,500	66,005.00	0.04
545	301227	森鹰窗业	2,600	65,546.00	0.04
546	688508	芯朋微	700	65,072.00	0.04
547	301066	万事利	5,600	65,016.00	0.04
548	688222	成都先导	2,010	64,541.10	0.04
549	688385	复旦微电	900	64,161.00	0.04
550	000737	北方铜业	4,800	63,456.00	0.04
551	688615	合合信息	560	63,336.00	0.04
552	002074	国轩高科	2,300	63,273.00	0.04
553	688551	科威尔	900	63,243.00	0.04

554	688321	微芯生物	2,400	63,192.00	0.04
555	688261	东微半导	600	62,958.00	0.04
556	300755	华致酒行	5,493	62,565.27	0.04
557	002426	胜利精密	15,700	62,486.00	0.04
558	300501	海顺新材	4,900	62,230.00	0.04
559	688484	南芯科技	1,100	62,139.00	0.04
560	300922	天秦装备	4,100	62,115.00	0.04
561	000533	顺钠股份	6,500	61,815.00	0.04
562	000987	越秀资本	7,900	61,778.00	0.04
563	301056	森赫股份	5,500	61,600.00	0.04
564	688333	铂力特	600	61,440.00	0.04
565	688584	上海合晶	1,700	61,115.00	0.04
566	688087	英科再生	1,800	60,156.00	0.04
567	688433	华曙高科	700	59,920.00	0.04
568	688188	柏楚电子	560	59,752.00	0.04
569	301383	天键股份	2,500	59,750.00	0.04
570	600354	敦煌种业	12,500	59,500.00	0.04
571	603341	龙旗科技	1,400	59,486.00	0.04
572	001358	兴欣新材	2,300	59,432.00	0.04
573	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.04
574	688312	燕麦科技	700	58,793.00	0.04
575	000798	中水渔业	8,300	58,598.00	0.04
576	600590	泰豪科技	5,800	58,580.00	0.04
577	688411	海博思创	200	58,240.00	0.04
578	002339	积成电子	8,400	58,212.00	0.04
579	601872	招商轮船	3,300	57,981.00	0.04
580	301186	超达装备	1,400	57,400.00	0.03
581	688169	石头科技	600	56,982.00	0.03
582	300983	尤安设计	1,600	56,960.00	0.03
583	001212	中旗新材	1,200	56,856.00	0.03
584	688768	容知日新	1,100	56,694.00	0.03
585	300129	泰胜风能	6,600	56,430.00	0.03
586	001316	润贝航科	1,700	56,066.00	0.03

587	688182	灿勤科技	1,300	55,991.00	0.03
588	688046	药康生物	2,302	55,708.40	0.03
589	688535	华海诚科	296	55,352.00	0.03
590	002363	隆基机械	9,100	54,782.00	0.03
591	688259	创耀科技	1,400	54,768.00	0.03
592	300017	网宿科技	4,200	54,642.00	0.03
593	301479	弘景光电	900	54,180.00	0.03
594	688507	索辰科技	200	53,936.00	0.03
595	002917	金奥博	5,100	53,754.00	0.03
596	605088	冠盛股份	1,900	53,542.00	0.03
597	688503	聚和材料	400	53,080.00	0.03
598	688183	生益电子	400	52,960.00	0.03
599	301498	乖宝宠物	1,300	52,767.00	0.03
600	003028	振邦智能	2,400	52,728.00	0.03
601	002015	协鑫能科	3,200	52,224.00	0.03
602	688331	荣昌生物	400	52,104.00	0.03
603	688548	广钢气体	1,000	52,100.00	0.03
604	300550	和仁科技	3,900	51,987.00	0.03
605	300648	星云股份	1,200	51,864.00	0.03
606	688226	威腾电气	1,200	51,396.00	0.03
607	688798	艾为电子	700	51,324.00	0.03
608	688428	诺诚健华	1,800	51,246.00	0.03
609	688708	佳驰科技	1,000	50,800.00	0.03
610	688786	悦安新材	1,100	50,688.00	0.03
611	688122	西部超导	800	50,248.00	0.03
612	301395	仁信新材	3,800	49,970.00	0.03
613	600893	航发动力	1,300	49,842.00	0.03
614	000600	建投能源	5,500	48,125.00	0.03
615	603126	中材节能	7,600	47,880.00	0.03
616	688772	珠海冠宇	2,400	47,112.00	0.03
617	688303	大全能源	2,700	47,061.00	0.03
618	688209	英集芯	1,600	46,528.00	0.03
619	688691	灿芯股份	400	46,372.00	0.03

620	000862	银星能源	9,600	46,272.00	0.03
621	688380	中微半导	700	46,137.00	0.03
622	688018	乐鑫科技	360	46,051.20	0.03
623	300332	天壕能源	10,600	45,580.00	0.03
624	688582	芯动联科	700	45,500.00	0.03
625	601328	交通银行	7,000	45,010.00	0.03
626	688279	峰昭科技	200	44,888.00	0.03
627	600135	乐凯胶片	5,600	44,744.00	0.03
628	688158	优刻得	1,200	44,112.00	0.03
629	688690	纳微科技	1,000	44,100.00	0.03
630	301062	上海艾录	7,700	43,967.00	0.03
631	688578	艾力斯	400	43,680.00	0.03
632	688390	固德威	400	43,404.00	0.03
633	605286	同力天启	1,700	43,333.00	0.03
634	688281	华秦科技	860	43,197.80	0.03
635	300473	德尔股份	1,400	42,560.00	0.03
636	688102	斯瑞新材	900	42,462.00	0.03
637	603221	爱丽家居	4,300	42,441.00	0.03
638	300115	长盈精密	1,500	41,910.00	0.03
639	300207	欣旺达	2,200	41,778.00	0.03
640	688375	国博电子	400	41,720.00	0.03
641	688605	先锋精科	400	41,608.00	0.03
642	688603	天承科技	200	41,590.00	0.03
643	002139	拓邦股份	4,300	40,936.00	0.02
644	688093	世华科技	1,100	40,590.00	0.02
645	300905	宝丽迪	800	40,480.00	0.02
646	605080	浙江自然	2,100	40,446.00	0.02
647	688231	隆达股份	1,100	40,403.00	0.02
648	301446	福事特	1,100	40,370.00	0.02
649	688516	奥特维	700	40,173.00	0.02
650	002906	华阳集团	1,600	39,936.00	0.02
651	688750	金天钛业	2,399	39,895.37	0.02
652	000822	山东海化	9,800	39,396.00	0.02

653	688127	蓝特光学	400	39,040.00	0.02
654	600152	维科技术	3,900	38,961.00	0.02
655	002578	闽发铝业	12,300	38,745.00	0.02
656	001325	元创股份	1,100	38,698.00	0.02
657	688153	唯捷创芯	1,200	38,544.00	0.02
658	688170	德龙激光	400	38,404.00	0.02
659	688401	路维光电	400	38,392.00	0.02
660	688131	皓元医药	400	37,840.00	0.02
661	688655	迅捷兴	700	37,492.00	0.02
662	688789	宏华数科	700	37,219.00	0.02
663	000810	创维数字	2,800	37,100.00	0.02
664	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.02
665	688600	皖仪科技	1,100	36,608.00	0.02
666	601001	晋控煤业	2,100	36,519.00	0.02
667	688779	五矿新能	4,501	36,503.11	0.02
668	002081	金螳螂	8,400	36,372.00	0.02
669	688308	欧科亿	200	36,362.00	0.02
670	688190	云路股份	400	36,284.00	0.02
671	688334	西高院	2,000	36,280.00	0.02
672	688088	虹软科技	1,000	35,550.00	0.02
673	600336	澳柯玛	5,700	35,511.00	0.02
674	688758	赛分科技	1,600	35,216.00	0.02
675	002475	立讯精密	500	35,200.00	0.02
676	688480	赛恩斯	400	35,036.00	0.02
677	688800	瑞可达	360	34,549.20	0.02
678	688350	富淼科技	1,000	34,530.00	0.02
679	300774	倍杰特	3,200	34,400.00	0.02
680	688518	联赢激光	1,100	33,990.00	0.02
681	688556	高测股份	2,497	33,160.16	0.02
682	688585	上纬新材	200	33,160.00	0.02
683	601069	西部黄金	1,500	33,000.00	0.02
684	300177	中海达	5,300	32,860.00	0.02
685	002438	江苏神通	2,200	32,846.00	0.02

686	688631	莱斯信息	700	32,837.00	0.02
686	688049	炬芯科技	700	32,837.00	0.02
687	002881	美格智能	900	32,796.00	0.02
688	688349	三一重能	2,160	32,788.80	0.02
689	688175	高凌信息	1,290	32,443.50	0.02
690	002692	远程股份	8,500	32,045.00	0.02
691	688157	松井股份	1,200	31,668.00	0.02
692	605365	立达信	2,200	31,636.00	0.02
693	300872	天阳科技	2,000	31,600.00	0.02
694	688332	中科蓝讯	200	31,500.00	0.02
695	688523	航天环宇	600	31,440.00	0.02
696	688228	开普云	400	30,936.00	0.02
697	301270	汉仪股份	1,200	30,816.00	0.02
698	688719	爱科赛博	400	30,800.00	0.02
699	688191	智洋创新	860	30,702.00	0.02
700	603121	华培动力	2,600	30,550.00	0.02
701	688709	成都华微	800	30,472.00	0.02
702	002865	钧达股份	500	29,840.00	0.02
703	300977	深圳瑞捷	1,900	29,298.00	0.02
704	301397	溯联股份	900	29,124.00	0.02
705	688297	中无人机	700	29,085.00	0.02
706	601319	中国人保	4,300	29,068.00	0.02
707	600295	鄂尔多斯	2,700	28,944.00	0.02
708	688611	杭州柯林	400	28,580.00	0.02
709	688472	阿特斯	2,624	28,391.68	0.02
710	688590	新致软件	2,280	28,340.40	0.02
711	002853	皮阿诺	1,400	28,112.00	0.02
712	002236	大华股份	1,700	28,033.00	0.02
713	688090	瑞松科技	260	27,677.00	0.02
714	688248	南网科技	400	27,672.00	0.02
715	002136	安纳达	2,100	27,468.00	0.02
716	601988	中国银行	4,800	27,456.00	0.02
717	688579	地纬智能	3,593	27,270.87	0.02

718	688593	新相微	700	27,244.00	0.02
719	600686	金龙汽车	2,400	27,096.00	0.02
720	688326	经纬恒润	379	26,863.52	0.02
721	603416	信捷电气	500	26,435.00	0.02
722	002628	成都路桥	4,900	26,215.00	0.02
723	002259	升达林业	6,800	25,772.00	0.02
724	688485	九州一轨	400	25,624.00	0.02
725	688006	杭可科技	700	25,585.00	0.02
726	688185	康希诺	500	25,495.00	0.02
727	603577	汇金通	2,700	25,434.00	0.02
728	688351	微电生理	1,100	24,926.00	0.02
729	001388	信通电子	900	24,723.00	0.02
730	300788	中信出版	1,100	24,717.00	0.02
731	000902	新洋丰	2,100	24,276.00	0.01
732	000029	深深房A	1,100	24,255.00	0.01
733	688186	广大特材	1,600	24,240.00	0.01
734	688292	浩瀚深度	1,300	24,180.00	0.01
735	300033	同花顺	100	24,100.00	0.01
736	688007	光峰科技	1,800	23,940.00	0.01
737	301068	大地海洋	1,000	23,800.00	0.01
738	688258	卓易信息	200	23,708.00	0.01
739	688625	呈和科技	280	23,634.80	0.01
740	688249	晶合集成	400	23,612.00	0.01
741	603393	新天然气	1,100	23,551.00	0.01
742	688299	长阳科技	1,400	23,394.00	0.01
743	688266	泽璟制药	200	23,332.00	0.01
744	300161	华中数控	800	23,296.00	0.01
745	688550	瑞联新材	400	23,140.00	0.01
746	688439	振华风光	500	23,100.00	0.01
747	688286	敏芯股份	200	23,014.00	0.01
748	301133	金钟股份	600	22,920.00	0.01
749	688486	龙迅股份	360	22,888.80	0.01
750	600019	宝钢股份	4,200	22,806.00	0.01

751	688119	中钢洛耐	4,800	22,800.00	0.01
752	002009	天奇股份	1,100	22,748.00	0.01
753	301337	亚华电子	800	22,240.00	0.01
754	688685	迈信林	400	21,960.00	0.01
755	688778	厦钨新能	400	21,760.00	0.01
756	688160	步科股份	200	21,754.00	0.01
757	688636	智明达	600	21,738.00	0.01
758	688223	晶科能源	4,525	21,493.75	0.01
759	688128	中国电研	900	21,366.00	0.01
760	688135	利扬芯片	500	21,040.00	0.01
761	688698	伟创电气	400	20,980.00	0.01
762	688458	美芯晟	500	20,880.00	0.01
763	688219	会通股份	1,555	20,121.70	0.01
764	300432	富临精工	1,000	20,090.00	0.01
765	688318	财富趋势	280	19,966.80	0.01
766	002414	高德红外	1,500	19,890.00	0.01
767	000553	安道麦A	3,700	19,795.00	0.01
768	002973	侨银股份	1,900	19,703.00	0.01
769	688371	菲沃泰	500	19,495.00	0.01
770	688252	天德钰	800	19,200.00	0.01
771	600562	国睿科技	900	19,098.00	0.01
772	688162	巨一科技	800	18,912.00	0.01
773	301318	维海德	900	18,360.00	0.01
774	688711	宏微科技	400	18,180.00	0.01
775	688386	泛亚微透	200	17,968.00	0.01
776	603610	麒盛科技	1,000	17,960.00	0.01
777	300884	狄耐克	1,800	17,856.00	0.01
778	688633	星球石墨	600	17,838.00	0.01
779	688553	汇宇制药	1,672	17,773.36	0.01
780	688425	铁建重工	4,400	17,688.00	0.01
781	688171	纬德信息	400	17,584.00	0.01
782	688080	映翰通	400	17,300.00	0.01
783	301558	三态股份	2,800	17,276.00	0.01

784	002195	岩山科技	2,600	17,004.00	0.01
785	688676	金盘科技	200	16,928.00	0.01
786	002678	珠江钢琴	4,000	16,920.00	0.01
787	301226	祥明智能	500	16,595.00	0.01
788	688568	中科星图	400	16,588.00	0.01
789	000829	天音控股	2,100	16,380.00	0.01
790	688315	诺禾致源	1,300	16,263.00	0.01
791	688045	必易微	200	16,156.00	0.01
792	002891	中宠股份	600	16,032.00	0.01
793	688435	英方软件	500	16,000.00	0.01
794	688336	三生国健	290	15,399.00	0.01
795	688116	天奈科技	400	15,280.00	0.01
796	601877	正泰电器	600	15,042.00	0.01
797	688612	威迈斯	500	14,795.00	0.01
798	688133	泰坦科技	700	14,791.00	0.01
799	603920	世运电路	300	14,412.00	0.01
800	688208	道通科技	566	14,257.54	0.01
801	601619	嘉泽新能	3,300	14,190.00	0.01
802	688657	浩辰软件	384	13,735.68	0.01
803	688330	宏力达	400	13,532.00	0.01
804	603119	浙江荣泰	200	13,268.00	0.01
805	688558	国盛智科	400	13,144.00	0.01
806	002180	奔图科技	800	13,088.00	0.01
807	688236	春立医疗	900	13,014.00	0.01
808	688620	安凯微	800	12,960.00	0.01
809	688577	浙海德曼	280	12,832.40	0.01
810	000592	平潭发展	1,900	12,711.00	0.01
811	688788	科思科技	280	12,594.40	0.01
812	002404	嘉欣丝绸	2,200	12,584.00	0.01
813	301004	嘉益股份	400	12,400.00	0.01
814	688377	迪威尔	520	12,261.60	0.01
815	300137	先河环保	700	12,208.00	0.01
816	688562	航天软件	800	12,048.00	0.01

817	688239	航宇科技	200	11,966.00	0.01
818	600316	洪都航空	400	11,176.00	0.01
819	000905	厦门港务	1,400	10,864.00	0.01
820	688237	超卓航科	200	10,684.00	0.01
821	688232	新点软件	600	10,668.00	0.01
822	301171	易点天下	300	10,188.00	0.01
823	300354	东华测试	300	10,164.00	0.01
824	688084	晶品特装	200	10,056.00	0.01
825	688101	三达膜	600	9,918.00	0.01
826	688510	航亚科技	400	9,552.00	0.01
827	688543	国科军工	240	9,468.00	0.01
828	002405	四维图新	1,400	9,058.00	0.01
829	688819	天能股份	400	8,880.00	0.01
830	600666	奥瑞德	2,200	8,734.00	0.01
831	300098	高新兴	1,900	8,721.00	0.01
832	001217	华尔泰	1,000	8,430.00	0.01
833	688161	威高骨科	400	8,392.00	0.01
834	600690	海尔智家	400	8,164.00	0.00
835	002548	金新农	2,200	8,118.00	0.00
836	300879	大叶股份	500	7,840.00	0.00
837	301449	天溯计量	200	7,740.00	0.00
838	688166	博瑞医药	200	7,002.00	0.00
839	603995	甬金股份	300	6,963.00	0.00
840	601998	中信银行	1,000	6,930.00	0.00
841	688591	泰凌微	200	6,876.00	0.00
842	002716	湖南白银	800	6,472.00	0.00
843	600966	博汇纸业	1,300	6,214.00	0.00
844	301025	读客文化	800	6,208.00	0.00
845	688618	三旺通信	200	6,154.00	0.00
846	002752	昇兴股份	1,000	5,520.00	0.00
847	600372	中航机载	500	5,425.00	0.00
848	301003	江苏博云	100	5,350.00	0.00
849	300490	华自科技	400	5,292.00	0.00

850	600773	西藏城投	400	5,148.00	0.00
851	001248	华润新能	500	5,055.00	0.00
852	300772	运达股份	400	4,920.00	0.00
853	301043	绿岛风	100	4,911.00	0.00
854	688678	福立旺	200	4,834.00	0.00
855	688459	哈铁科技	500	4,165.00	0.00
856	603533	掌阅科技	200	4,058.00	0.00
857	002642	荣联科技	600	3,696.00	0.00
858	688653	康希通信	200	3,476.00	0.00
859	688015	交控科技	200	3,076.00	0.00
860	688410	山外山	200	2,872.00	0.00
861	688707	振华新材	200	2,570.00	0.00
862	601838	成都银行	100	1,770.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	605287	德才股份	3,263,686.00	1.99
2	000967	盈峰环境	3,132,956.00	1.91
3	601898	中煤能源	3,121,854.80	1.90
4	603993	洛阳钼业	2,961,020.00	1.80
5	301172	君逸数码	2,915,010.00	1.77
6	300164	通源石油	2,862,794.00	1.74
7	000938	紫光股份	2,860,775.00	1.74
8	000977	浪潮信息	2,722,686.00	1.66
9	601225	陕西煤业	2,694,685.00	1.64
10	000338	潍柴动力	2,652,677.00	1.61
11	601872	招商轮船	2,610,070.00	1.59
12	003027	同兴科技	2,596,337.00	1.58
13	002454	松芝股份	2,550,497.80	1.55
14	601600	中国铝业	2,476,917.00	1.51

15	002379	宏桥控股	2,454,478.95	1.49
16	601975	招商南油	2,421,144.00	1.47
17	600938	中国海油	2,406,464.00	1.46
18	000573	粤宏远 A	2,386,138.00	1.45
19	600362	江西铜业	2,325,245.00	1.41
20	003019	宸展光电	2,305,461.00	1.40

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	605287	德才股份	3,218,474.00	1.96
2	301172	君逸数码	2,902,230.00	1.77
3	000938	紫光股份	2,770,164.00	1.68
4	000967	盈峰环境	2,603,279.00	1.58
5	601872	招商轮船	2,599,275.23	1.58
6	003027	同兴科技	2,591,789.00	1.58
7	603993	洛阳钼业	2,574,095.00	1.57
8	601975	招商南油	2,416,661.00	1.47
9	000338	潍柴动力	2,347,829.00	1.43
10	000066	中国长城	2,301,133.00	1.40
11	603637	镇海股份	2,294,786.00	1.40
12	002273	水晶光电	2,285,120.00	1.39
13	000977	浪潮信息	2,235,478.00	1.36
14	300572	安车检测	2,215,640.00	1.35
15	000573	粤宏远 A	2,212,782.00	1.35
16	300756	金马游乐	2,192,232.80	1.33
17	601898	中煤能源	2,169,477.00	1.32
18	603286	日盈电子	2,167,085.00	1.32
19	600703	三安光电	2,097,594.00	1.28
20	603010	万盛股份	2,048,440.00	1.25

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,120,993,073.15
卖出股票收入（成交）总额	967,080,681.71

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	5,000.28	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,000.28	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118070	南芯转债	50	5,000.28	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 中信证券（代码：600030）为本基金前十大持仓股票之一。2026年6月29日，江西证监局对中信证券景德镇珠山大道证券营业部内部控制不到位、业务专用章保管不善等违规行为，采取责令改正的行政监管措施。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外，未发现本基金投资的前五名证券的发行主体本期存在被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	200,552.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	200,552.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
易米远景量化 选股股票A	1,824	87,206.49	1,087,550.41	0.68%	157,977,088.73	99.32%
易米远景量化 选股股票C	373	21,153.71	3,000.00	0.04%	7,887,335.65	99.96%
合计	2,174	76,796.22	1,090,550.41	0.65%	165,864,424.38	99.35%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	易米远景量化选股 股票A	248,353.84	0.16%
	易米远景量化选股 股票C	-	-
	合计	248,353.84	0.15%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的 数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	易米远景量化选股 股票A	0~10

	易米远景量化选股股票C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	易米远景量化选股股票A	0
	易米远景量化选股股票C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	易米远景量化选股股票A	易米远景量化选股股票C
基金合同生效日(2026年03月17日)基金份额总额	242,719,769.67	10,260,626.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	25,083,825.71	2,394,327.29
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	108,738,956.24	4,764,618.08
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	159,064,639.14	7,890,335.65

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2026年1月9日、2026年1月21日，基金管理人发布公告，自2026年1月8日起增聘魏鑫为易米开泰混合型证券投资基金基金经理，贺文奇自2026年1月20日起不再担任易米开泰混合型证券投资基金基金经理。

2026年1月14日、2026年2月7日，基金管理人发布公告，自2026年1月13日起增聘杜雨楠为易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理，李秋实自2026年2月5日起不再担任易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。

2026年1月14日、2026年2月7日，基金管理人发布公告，自2026年1月13日起增聘杜雨楠为易米和丰债券型证券投资基金基金经理，李秋实自2026年2月5日起不再担任易米和丰债券型证券投资基金基金经理。

2026年3月28日，基金管理人发布公告，公司总经理助理兼首席投资官包丽华于2026年3月26日离任，并自2026年3月26日起不再担任易米开鑫价值优选混合型证券投资基金、易米鑫选品质混合型证券投资基金基金经理；黄晓峰自2026年3月27日起担任易米开鑫价值优选混合型证券投资基金、易米鑫选品质混合型证券投资基金基金经理。

2026年4月10日，基金管理人发布公告，自2026年4月9日起增聘黄晓峰为易米研究精选混合型发起式证券投资基金基金经理，熊颖自2026年4月8日起不再担任易米研究精选混合型发起式证券投资基金基金经理。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内无改聘情况。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	3	2,088,007,651.86	100.00%	535,350.75	100.00%	-

注：1.本基金使用券商交易结算模式，可免于执行《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》关于交易佣金分仓的规定。

2.本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准包括：证券公司经营管理状况、证券交易的安全性和效率、清算效率等方面。根据前述标准由基金管理人考察后确定选用证券经纪商，并与其签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方证券	24,597,087.64	100.00%	3,038,585,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易米远景量化选股股票型证券投资基金基金份额发售公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026-03-02
2	关于易米远景量化选股股票型证券投资基金提前结束募	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上	2026-03-13

	集的公告	海证券报》	
3	易米远景量化选股股票型证券投资基金基金合同生效公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026-03-18
4	易米基金管理有限公司关于旗下基金参加东海证券股份有限公司费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026-04-03
5	易米远景量化选股股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026-05-14
6	易米基金管理有限公司关于旗下基金参加销售机构费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026-05-21
7	易米基金管理有限公司关于旗下基金参加京东肯特瑞基金销售有限公司费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026-06-08
8	易米基金管理有限公司关于旗下基金参加民生证券股份有限公司费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026-06-10
9	易米基金管理有限公司关于旗下基金参加中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026-06-15
10	易米基金管理有限公司关于旗下基金参加东吴证券股份有限公司费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《上海证券报》	2026-06-15

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易米远景量化选股股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2.《易米远景量化选股股票型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易米远景量化选股股票型证券投资基金托管协议》；
- 4.法律意见书；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7.中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人及基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

易米基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日