

易米远景量化选股股票型证券投资基金
2026年第三季度报告
2026年09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

报告送出日期:2026年10月27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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年10月26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
报告期末基金份额总额	156,673,025.08份
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%+活期存款基准利率*5%
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

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	149,993,091.54份	6,679,933.54份

注：本基金的业绩比较基准自2026年9月21日起由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%调整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%+活期存款基准利率*5%。

§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07月01日 - 2026年09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
1.本期已实现收益	-15,467,547.95	-752,812.62
2.本期利润	-14,897,422.50	-704,888.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0968	-0.1002
4.期末基金资产净值	133,478,941.43	5,931,523.31
5.期末基金份额净值	0.8899	0.8880

注：1.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；
2.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。

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净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.65%	2.04%	-12.22%	1.44%	2.57%	0.60%
过去六个月	-11.66%	1.63%	-3.09%	1.37%	-8.57%	0.26%
自基金合同生效起至今	-11.01%	1.57%	-7.27%	1.40%	-3.74%	0.17%

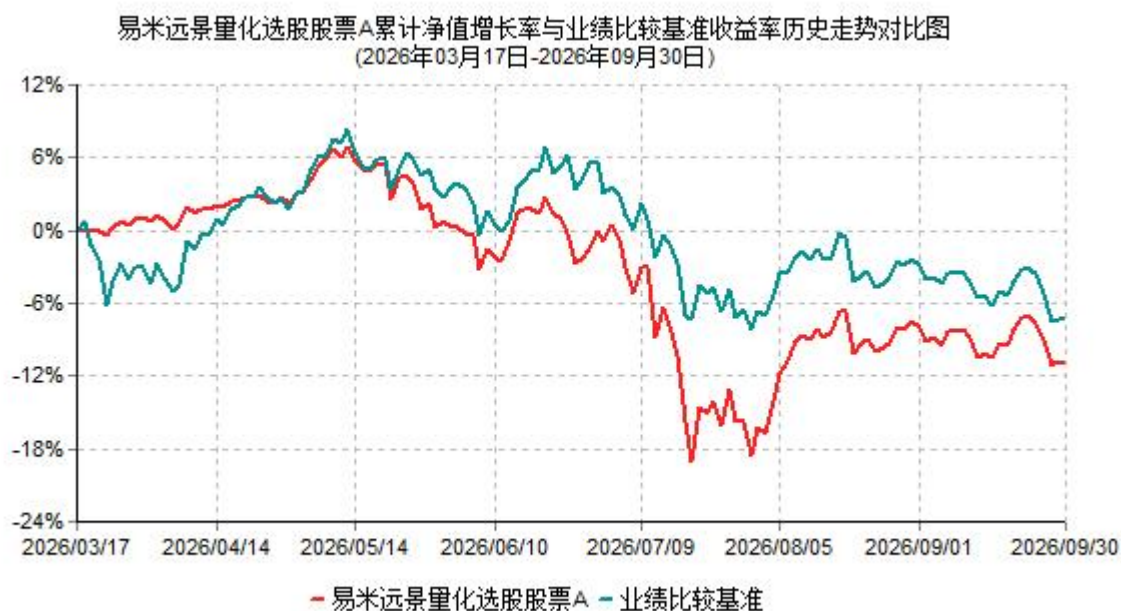
注：本基金的业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起由中证全指指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*5%调整为中证全指指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+活期存款基准利率*5%。

易米远景量化选股股票C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.73%	2.04%	-12.22%	1.44%	2.49%	0.60%
过去六个月	-11.83%	1.63%	-3.09%	1.37%	-8.74%	0.26%
自基金合同生效起至今	-11.20%	1.57%	-7.27%	1.40%	-3.93%	0.17%

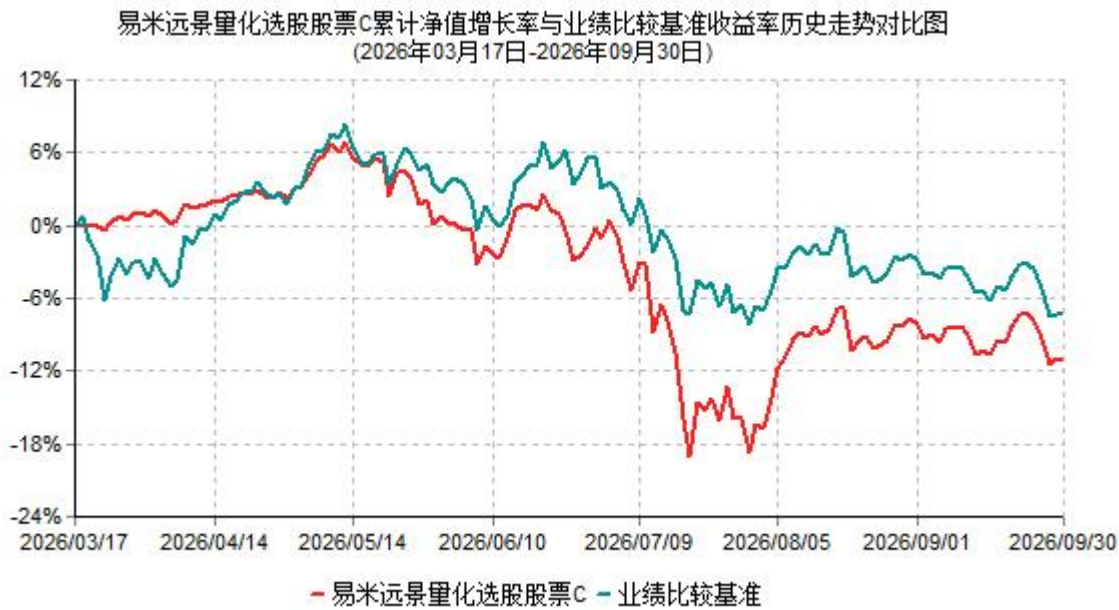
注：本基金的业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起由中证全指指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+银行活期存款利率（税后）*5%调整为中证全指指数收益率*90%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+活期存款基准利率*5%。

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



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。

3. 本基金的业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起由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%调整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%+活期存款基准利率*5%。



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。
3. 本基金的业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起由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%调整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%+活期存款基准利率*5%。

§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		
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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，A股市场呈现出显著的均值回归特征，与二季度形成鲜明反差：二季度表现强势的板块普遍回调，而前期相对冷落的板块则展现出较强的防御韧性。市场风格亦发生剧烈切换，全面向价值风格倾斜，期间沪深300价值指数上涨5.92%，而沪深300成长指数大幅下跌20.28%。

受成长风格深度回调的拖累，由于当前A股市场结构仍以成长类资产为主导，整体市场表现承压。期间，中证全指、沪深300、中证1000、科创50及创业板指分别录得-13.79%、-12.49%、-17.15%、-30.70%及-27.80%的跌幅，其中科创类宽基指数的回撤幅度显著高于全市场宽基。行业方面，结构性分化极为剧烈：煤炭（+19.29%）、石油石化（+15.32%）、农林牧渔（+15.10%）、银行（+14.56%）及医药生物（+10.12%）等低估值或防御性板块涨幅居前，而电子（-32.65%）、通信（-28.72%）、建筑材料（-26.10%）、电力设备（-23.73%）及机械设备（-21.11%）等板块则跌幅较深。

投资运作方面，三季度市场的均值回归行情符合我们此前的预期。随着7月市场极端波动的平息，本基金的超额收益迎来了显著的修复。在量化策略的执行上，我们始终秉持大数定律的底层逻辑，严格规避针对短期市场情绪波动进行应激式、主观化的仓位或模型干预。未来，我们将继续维持量化模型核心框架的稳定性，并基于投研认知的深化与策略储备的扩充，对模型进行循序渐进的迭代升级，做好产品的投资运作，力争为持有人创造长期稳健的回报。

4.5 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0.8899元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.65%，同期业绩比较基准收益率为-12.22%；截至报告期末易米远景量化选股股票C基金份额净值为0.8880元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.73%，同期业绩比较基准收益率为-12.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无应说明的预警信息。

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	131,567,412.27	93.97
	其中：股票	131,567,412.27	93.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,000.01	0.00
	其中：债券	1,000.01	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	8,348,292.52	5.96
8	其他资产	99,551.88	0.07
9	合计	140,016,256.68	100.00

5.2 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	2,081,111.00	1.49
B	采矿业	7,417,969.00	5.32
C	制造业	84,436,316.22	60.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,546,726.00	3.26
E	建筑业	1,402,666.00	1.01
F	批发和零售业	2,583,222.00	1.85
G	交通运输、仓储和邮政业	2,892,963.00	2.08
H	住宿和餐饮业	11,010.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,069,270.62	5.07
J	金融业	13,713,589.00	9.84
K	房地产业	1,085,011.00	0.78
L	租赁和商务服务业	942,118.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	1,996,473.93	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	877,849.50	0.63
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	10,975.00	0.01
Q	卫生和社会工作	53,488.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	446,654.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	131,567,412.27	94.37

5.3 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	300750	宁德时代	4,400	1,280,884.00	0.92
2	600519	贵州茅台	1,000	1,258,620.00	0.90
3	002142	宁波银行	33,700	1,193,991.00	0.86
4	600036	招商银行	27,500	1,134,650.00	0.81
5	300308	中际旭创	1,400	1,131,816.00	0.81
6	601899	紫金矿业	36,200	1,078,398.00	0.77
7	601318	中国平安	19,800	1,055,142.00	0.76
8	300502	新易盛	2,700	1,050,300.00	0.75
9	000651	格力电器	27,200	1,041,216.00	0.75
10	600900	长江电力	34,000	970,360.00	0.70

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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）	1,000.01	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000.01	0.00

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113711	常青转债	10	1,000.01	0.00

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 宁波银行（代码：002142）为本基金前十大持仓股票之一。2026年7月21日，国家金融监督管理总局上海监管局对宁波银行上海分行贷款贷后管理严重违反审慎经营规则等违规行为，罚款180万元。2026年6月18日，国家金融监督管理总局北京监管局对宁波银行北京分行营业部员工行为管理不到位的违规行为，罚款30万元。2025年11月14日，中国人民银行宁波市分行对宁波银行违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违规行为，罚款98.8万元。

招商银行（代码：600036）为本基金前十大持仓股票之一。2026年9月30日，国家金融监督管理总局吕梁监管分局对招商银行吕梁分行贷后管理不尽责等违规行为，罚款60万元。2026年9月29日，中国人民银行淮北市分行对招商银行违反金融统计相关规定的违规行为，罚款20.62万元。2026年8月7日，国家金融监督管理总局江苏金融监管局对招商银行南京分行及下辖分支行违规设立绩效考评指标等违规行为，合计罚款115万元。2026年7月21日，国家金融监督管理总局上海监管局对招商银行上海分行员工行为管理严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款30万元。2026年7月17日，国家金融监督管理总局对招商银行部分机构未纳入并表管理范围等违规行为，罚款650万元。2026年7月16日，国家金融监督管理总局临沂监管分局对招商银行临沂解放路支行贷前调查不到位的违规行为，罚款30万元。2026年6月18日，中国人民银行上海市分行对招商银行上海分行违反金融统计管理规定等违规行为，罚款73.1万元。2026年4月30日，中国人民银行青

岛市分行对招商银行青岛分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款38.36万元。2026年4月10日，国家金融监督管理总局常州监管分局对招商银行常州分行流动资金贷款贷后管理不到位的违规行为，罚款35万元；对招商银行常州武进支行贴现业务贸易背景审核不严的违规行为，罚款35万元。2026年4月7日，中国人民银行安徽省分行对招商银行合肥分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款147.69万元。2026年4月3日，中国人民银行甘肃省分行对招商银行兰州分行违反金融统计管理规定等违规行为，罚款38万元。2026年3月2日，国家金融监督管理总局佛山监管分局对招商银行佛山分行个人经营性贷款“三查”环节存在履职不到位等违规行为，罚款60万元；中国人民银行贵州省分行对招商银行贵阳分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款87.5万元。2026年1月23日，国家金融监督管理总局河南监管局对招商银行郑州分行监管统计报表数据错报、漏报的违规行为，罚款30万元。2025年12月31日，国家金融监督管理总局洛阳监管分局对招商银行洛阳分行贷后管理不尽职的违规行为，罚款30万元。2025年12月26日，国家金融监督管理总局宁波监管局对招商银行宁波分行不良资产处置管理不到位等违规行为，罚款90万元；国家金融监督管理总局大庆监管分局对招商银行大庆分行贷前调查不尽职等违规行为，罚款20万元。

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十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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99,551.88
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	99,551.88

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

本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

5.11.6 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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	159,064,639.14	7,890,335.65
报告期期间基金总申购份额	4,998,634.84	372,241.99
减：报告期期间基金总赎回份额	14,070,182.44	1,582,644.10
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	149,993,091.54	6,679,933.54

§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，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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投资本基金。

§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。

8.2 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。

§9 备查文件目录**9.1 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。

9.2 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。

9.3 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

2026年10月27日