

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	19
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	19
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	78
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	79
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	79
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	79
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	79
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	79
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12	投资组合报告附注	79
§ 9	基金份额持有人信息	80
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
9.3	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	81
9.4	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	81
§ 10	开放式基金份额变动	81
§ 11	重大事件揭示	82
11.1	基金份额持有人大会决议	82
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	82
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4	基金投资策略的改变	82
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	82
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	82
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8	其他重大事件	85
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	87
12.1	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	87
§ 13	备查文件目录	87
13.1	备查文件目录	87
13.2	存放地点	87
13.3	查阅方式	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	易方达中证 500 量化增强	
基金主代码	012080	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 15 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	535,988,426.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
下属分级基金的交易代码	012080	012081
报告期末下属分级基金的份额总额	394,221,116.92 份	141,767,309.20 份

2.2 基金产品说明

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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本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 7%；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，谋求基金资产的长期增值。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预测股票超额回报，在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。债券投资方面，本基金

	将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，并通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择等方面进行积极主动的债券投资管理。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券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。</p> <p>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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的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、以及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“风险揭示”部分。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路 30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
----------------	-------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年 6 月 15 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
本期已实现收益	-24,167,535.45	-8,211,848.07	-48,163,343.13	-16,125,015.57	7,144,265.47	1,974,192.59
本期利润	-15,599,912.86	-8,855,063.99	-76,018,413.46	-25,093,295.17	15,488,276.42	4,571,740.49
加权平均基金份额本期利润	-0.0377	-0.0535	-0.1597	-0.1633	0.0233	0.0208
本期加权平均净值利润率	-4.29%	-6.09%	-17.51%	-17.99%	2.32%	2.07%
本期基金份额净值增长率	-4.84%	-5.12%	-15.50%	-15.75%	2.39%	2.22%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
期末可供分配利润	-69,651,045.04	-25,933,453.09	-59,202,654.76	-20,922,505.75	6,142,253.78	1,552,892.64
期末可供分配基金份额利润	-0.1767	-0.1829	-0.1348	-0.1388	0.0119	0.0103
期末基金资产净值	324,570,071.88	115,833,856.11	379,927,643.45	129,796,299.79	527,599,239.14	154,663,525.34
期末基金份额净值	0.8233	0.8171	0.8652	0.8612	1.0239	1.0222
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
基金份额累计净值增长率	-17.67%	-18.29%	-13.48%	-13.88%	2.39%	2.22%

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4.本基金合同于 2021 年 6 月 15 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达中证 500 量化增强 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	-3.40%	0.82%	-4.36%	0.82%	0.96%	0.00%
过去六个月	-7.12%	0.81%	-9.01%	0.81%	1.89%	0.00%

过去一年	-4.84%	0.78%	-7.01%	0.78%	2.17%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-17.67%	0.97%	-18.23%	1.04%	0.56%	-0.07%

易方达中证 500 量化增强 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	-3.47%	0.81%	-4.36%	0.82%	0.89%	-0.01%
过去六个月	-7.25%	0.81%	-9.01%	0.81%	1.76%	0.00%
过去一年	-5.12%	0.77%	-7.01%	0.78%	1.89%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-18.29%	0.97%	-18.23%	1.04%	-0.06%	-0.07%

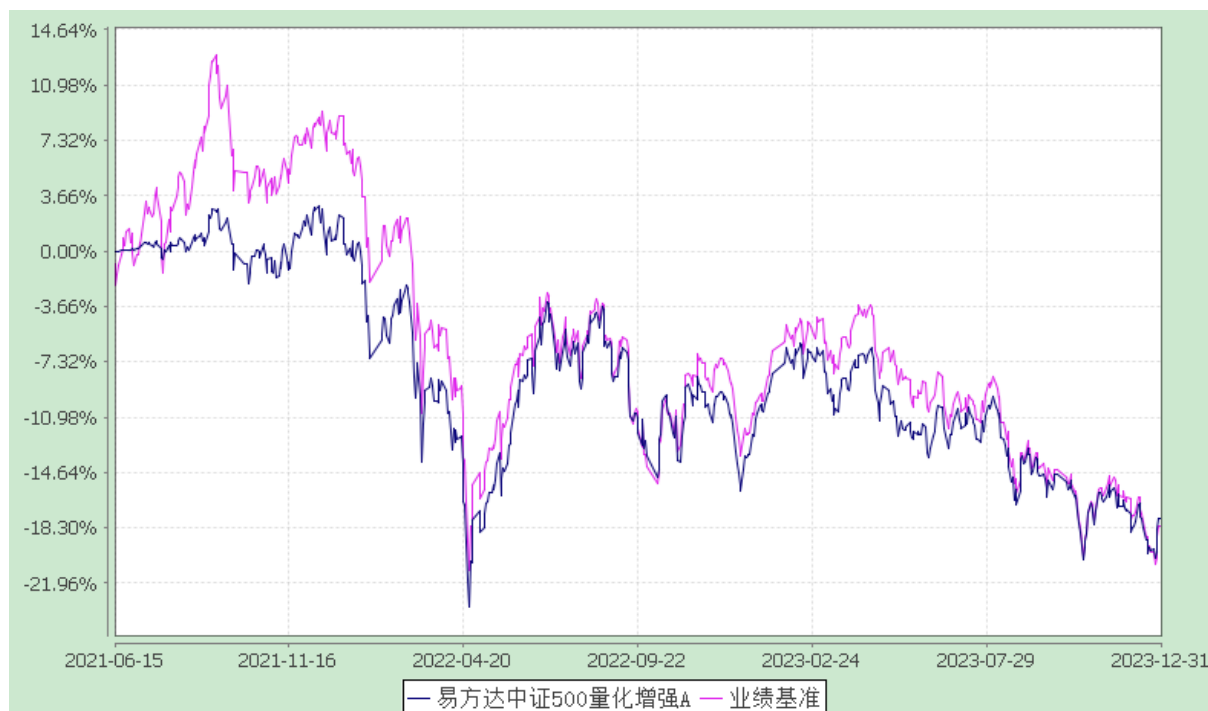
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 6 月 15 日至 2023 年 12 月 31 日)

易方达中证 500 量化增强 A



易方达中证 500 量化增强 C



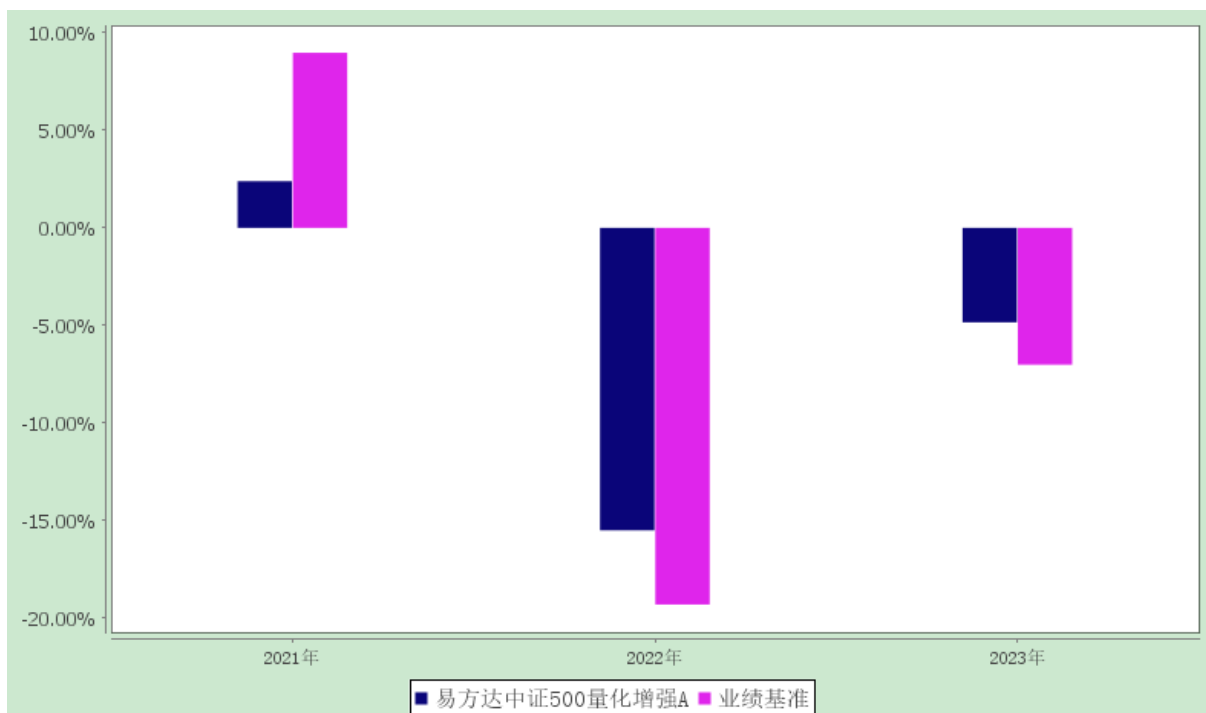
注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为-17.67%，同期业绩比较基准收益率为-18.23%；C 类基金份额净值增长率为-18.29%，同期业绩比较基准收益率为-18.23%。

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

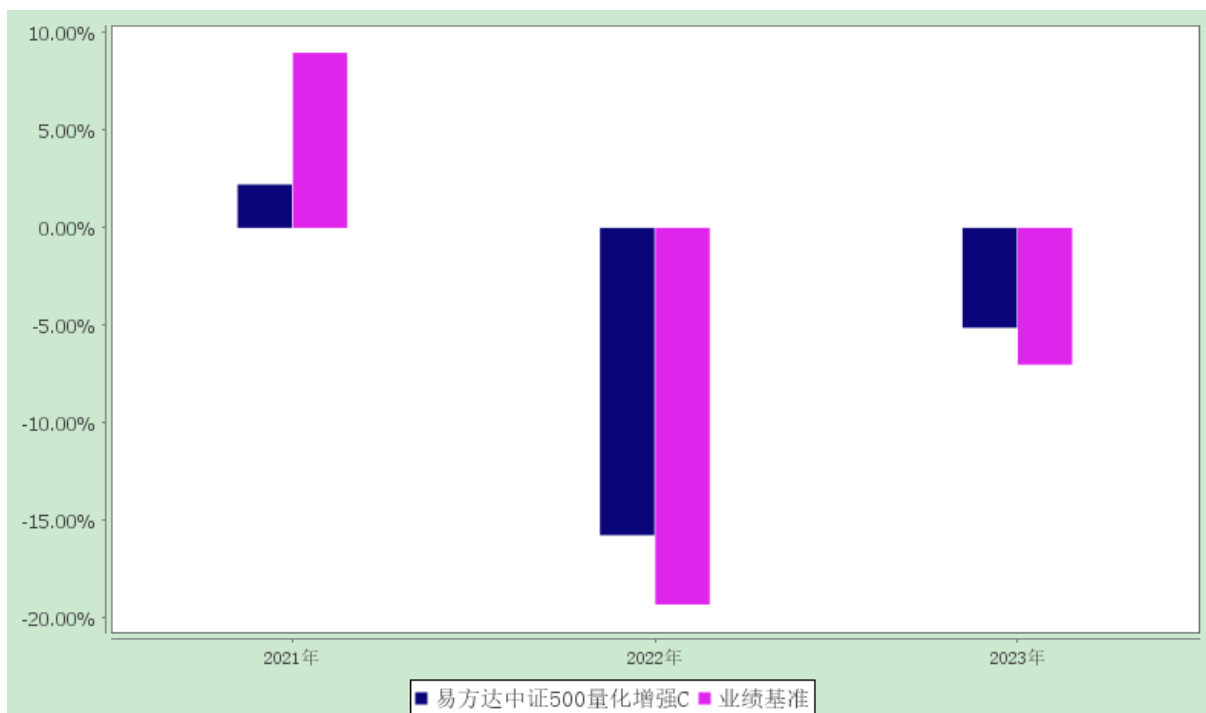
易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

易方达中证 500 量化增强 A



易方达中证 500 量化增强 C



注：本基金合同生效日为 2021 年 6 月 15 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2021 年 6 月 15 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		

官泽帆	本基金的基金经理,易方达中证 500 增强策略 ETF 的基金经理,量化投资部总经理助理	2021-06-15	-	13 年	硕士研究生,具有基金从业资格。曾任招商基金管理有限公司投资开发工程师,摩根士丹利华鑫基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理,易方达基金管理有限公司量化研究员、投资经理、基金经理助理,易方达沪深 300 量化增强、易方达量化策略精选混合、易方达易百智能量化策略混合的基金经理。
H U A N G J I A N S H E N G (黄 健 生)	本基金的基金经理,易方达中证 1000 量化增强的基金经理,量化投资决策委员会委员	2021-09-04	2023-11-09	12 年	加拿大籍,硕士研究生,具有基金从业资格。曾任美国 Sun Microsystems 资深软件工程师,美国 GMN Capital/伦敦 GSA Capital 量化投资研究员,美国巴克莱全球投资者(Barclays Global Investors)量化研究员,加拿大阿尔伯塔投资管理公司副基金经理,华泰柏瑞基金管理有限公司量化投资部门总监、投资经理,易方达基金管理有限公司量化投资部总经理,易方达量化策略精选混合、易方达沪深 300 量化增强的基金经理。
刘文贵	本基金的基金经理,投资经理	2023-11-09	-	11 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/基金经理助理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理,本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.1.3 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	1	440,403,927.99	2023-11-09
	私募资产管理计划	3	1,666,783,637.92	2019-04-25
	其他组合	0	0.00	-

合计	4	2,107,187,565.91	-
----	---	------------------	---

注：1.“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2.报告期内，刘文贵曾兼任3个私募资产管理计划的投资经理，其中2个私募资产管理计划于2023年12月31日终止。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，具体按其对产品业绩和投资团队的贡献等情况综合评定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形，公司进一步加强了对投资指令下达、交易执行和反向交易控制等环节的控制措施，同时强化了对相关同向交易价差、反向交易价差及组合收益率差异的事后监测分析，按监管要求完善了相关信息披露，进一步落实对兼任基金经理投资交易行为的规范和监督。本报告期内，相关制度措施执行情况良好，未发现同一基金经理管理公募基金、私募资产管理计划之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 47 次，其中 40 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾全年，2023 年经济曲折修复，一季度经济“脉冲式”反弹后，二季度超预期下行，三季度再度修复，年底再度回踩，具体看：低基数下，全年 GDP 增速 5.2%，略高于年初 5% 左右的目标增速，两年复合增速 4.1%，高于 2022 年 3%；受物价影响，名义 GDP 增速较实际增速低 0.6 个百分点至 4.6%；四季度 GDP 增速小升 0.3 个百分点至 5.2%，略低于 Wind 一致预期的 5.4%，两年平均增速和季调环比增速均较三季度回落，指向四季度经济实际有所走弱。跟随市场对 2023 年经济预期与现实的变化，可以将 A 股全年表现大致划分为几个阶段：

（1）年初至 2 月份：新冠疫情结束，建立了首套住房利率动态调整机制，多项利好共同刺激市

场，市场对未来经济复苏预期向好，同时也着实看到了一定程度的兑现，A 股市场整体上行，大消费相对占优。

(2) 2 月份至 4 月份：经济复苏速度较为缓慢，但此阶段投资者预期仍较为积极，“中特估”表现相对占优，“AI+（人工智能）”主题同样表现不俗，市场有所波动，行业轮动明显加快，但仍有支撑。

(3) 5 月份至年底：4 月底政治局会议对经济表态较为积极，稳增长政策保持定力，但大部分月份的制造业 PMI（采购经理指数）均低于 50，经济转为弱复苏，市场预期下降。7 月底政治局会议的召开，市场信心进一步增强；三季报数据公布，显示市场盈利在二季度触底后，已出现企稳回升。期间，北上资金持续净流出，外资偏好的核心资产明显下行。10 月之后，情绪、估值、资产比较等指标均表明，A 股资产可能已接近底部。

从事后分析来看，全年市场运行深受宏观预期与现实的共同影响，年初预期与现实共振向上，宏观因子暴露较高的核心资产板块最先受益，随着投资者乐观预期情绪扩散，叠加各类主题类事件的刺激（例如 AI+主题、“中特估”），市场虽然呈现较为明显的行业轮动特征，但整体震荡向上。这期间组合保持较小的风格与行业偏离，但是在个别主题上存在一定暴露，使得超额收益出现了一定的回撤。

进入 5 月份之后，随着各项经济数据的逐渐披露，社融、投资、消费、通胀、PMI 纷纷走弱，市场表现也逐步趋向二元结构化，即以红利低波风格为代表的防守型板块与以 TMT 板块为代表的主题板块，获得较好的相对收益；另一方面，与宏观经济相关性较高的板块表现相对较弱，而与此同时，北上资金的持续流出也进一步加大了回撤幅度。这期间基本面类因子表现相对较弱，但在风格、行业中性的前提下，仍旧获取了一定的超额收益。

在此期间，作为指数增强型基金，管理人严格遵照量化指数增强的投资模式进行操作，以标的指数的构成为基础，主要利用基金管理人自主开发的以基本面选股因子为主的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。

4.4.2 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 0.8233 元，本报告期份额净值增长率为-4.84%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%；C 类基金份额净值为 0.8171 元，本报告期份额净值增长率为-5.12%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%，年化跟踪误差 3.02%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，中国经济或将延续复苏态势：首先，美欧等发达市场仍旧保持较好的经济韧性，全球制造业和商品贸易有望复苏，尽管可能面临全球产业链调整压力，对中国出口产生结构性影响，但得益于全球制造业周期趋于弥合，中国出口总量修复和增长的方向相对确定；其次，内需方面，随着国内企业盈利趋势进一步改善，就业形势或将边际修复，带动居民收入增长，为居民消费的持续修复奠定基础，同时随着经济转型与国内服务业创新发展，服务消费有望复苏，进一步为国内消费修复提供动力；第三，在房地产市场持续调整的过程中，固定资产投资结构或将进一步转变，国有资本继续牵引基建等传统建筑投资领域，制造业与服务业的新兴领域投资将得到更高的增速；最后，宏观政策方面大概率将延续逆周期调控，财政赤字率保持中等偏高水平，货币政策偏宽松，这将有助于宏观经济的持续修复。

从市场中观角度来看，预计 2024 年 A 股企业盈利整体将呈现弱复苏态势，从供需角度来看，需求见底且供给偏紧的行业复苏力度有相对优势。从资金面来看，受制于市场赚钱效应的持续低迷，新增入市资金恐较少，存量资金博弈的趋势较为明显，这使得资金围绕风险偏好极高与极低的资产进行布局，即主题投资与红利低波风格；另一方面，存量资金博弈也使得偏重交易的量价类、估值类因子表现较为突出，并且行业轮动较为频繁，投资者持仓周期缩短，更加注重交易，这可能也将进一步提升该类因子的表现。

综上，下阶段基金运作管理仍将迎来诸多方面的挑战，管理人将继续严格遵照多因子量化增强的投资模式进行操作，同时结合采用长期有效的基本面量化模型进行选股，配置稳健的策略模型以顺应市场风格变换，为投资人创造持续稳健的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，持续督促廉洁从业、执业操守和道德规范等规定贯彻落实，积极开展形式多样的文化宣导，引导员工树立正确的价值观、事业观、职业观，不断推动建设风清气正的公司及行业生态环境。

(2) 持续完善投资合规监控手段，协同投资、研究、交易等业务部门完善相应的内控机制，共同巩固投资合规内控防线。升级风控系统，提升投资合规监控工作效能，有效保障各类资产组合的

合规运作。持续加强关联交易、公平交易、异常交易和内幕交易等监测管控机制，保护投资者利益。

(3) 持续督促优化基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，提升产品合规审查质效；坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求，坚持以投资者视角审核基金宣传推介材料，持续加强对网络直播、自媒体账号、对外言论发布、投资者交流等重点领域的合规管理。深入贯彻落实投资者适当性管理，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，完善信息披露管理工作机制流程，不断提高信息披露监测触发、制作、审核、报送的自动化水平和合规风险控制能力，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 贯彻落实风险为本的工作方法，持续完善洗钱风险管理体系，进一步健全内控制度流程，深入开展反洗钱系统建设与数据治理，探索优化风险评估识别方法，加强客户尽职调查，全面提高反洗钱工作的履职质效。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展 ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，聘请律师事务所完成年度合规有效性评估工作，从不同视角更加全面审视公司合规内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融

估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达中证 500 量化增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 500 量化增强 C:本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 24356 号

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些

风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

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

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

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金不能持续经营。

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵珏 成磊

中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	37,324,719.22	29,926,078.40
结算备付金		2,757,219.91	1,099,258.86
存出保证金		2,096,902.80	49,130.62
交易性金融资产	7.4.7.2	397,545,493.90	478,733,630.96
其中：股票投资		397,369,485.80	478,733,630.96
基金投资		-	-
债券投资		176,008.10	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		934,572.98	-
应收股利		-	-
应收申购款		528,264.98	821,240.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		441,187,173.79	510,629,339.78
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		96,855.30	98,325.31
应付管理人报酬		297,289.39	353,039.75
应付托管费		55,741.74	66,194.95

应付销售服务费		29,137.76	33,452.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.23	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	304,221.38	354,384.05
负债合计		783,245.80	905,396.54
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	535,988,426.12	589,849,103.75
未分配利润	7.4.7.8	-95,584,498.13	-80,125,160.51
净资产合计		440,403,927.99	509,723,943.24
负债和净资产总计		441,187,173.79	510,629,339.78

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 0.8233 元，C 类基金份额净值 0.8171 元；基金份额总额 535,988,426.12 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 394,221,116.92 份，C 类基金份额总额 141,767,309.20 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-19,007,155.44	-95,053,902.06
1.利息收入		131,722.24	261,590.19
其中：存款利息收入	7.4.7.9	131,722.24	261,590.19
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-27,186,063.08	-58,672,056.08

其中：股票投资收益	7.4.7.10	-34,699,387.76	-60,434,718.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	46,881.18	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-418.28	-6,730,472.81
股利收益	7.4.7.14	7,466,861.78	8,493,135.31
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	7,924,406.67	-36,823,349.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	122,778.73	179,913.76
减：二、营业总支出		5,447,821.41	6,057,806.57
1. 管理人报酬		4,068,487.65	4,592,685.61
2. 托管费		762,841.39	861,128.57
3. 销售服务费		432,624.90	419,063.17
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.31	-
8. 其他费用	7.4.7.18	183,867.16	184,929.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,454,976.85	-101,111,708.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,454,976.85	-101,111,708.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-24,454,976.85	-101,111,708.63

7.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	589,849,103.75	-80,125,160.51	509,723,943.24
二、本期期初净资产	589,849,103.75	-80,125,160.51	509,723,943.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-53,860,677.63	-15,459,337.62	-69,320,015.25
（一）、综合收益总额	-	-24,454,976.85	-24,454,976.85
（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）	-53,860,677.63	8,995,639.23	-44,865,038.40
其中：1.基金申购款	234,079,109.79	-21,128,351.86	212,950,757.93
2.基金赎回款	-287,939,787.42	30,123,991.09	-257,815,796.33
（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	535,988,426.12	-95,584,498.13	440,403,927.99
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	666,578,009.30	15,684,755.18	682,262,764.48
二、本期期初净资产	666,578,009.30	15,684,755.18	682,262,764.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-76,728,905.55	-95,809,915.69	-172,538,821.24
（一）、综合收益总额	-	-101,111,708.63	-101,111,708.63
（二）、本期基金	-76,728,905.55	5,301,792.94	-71,427,112.61

份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	154,206,200.72	-14,434,408.20	139,771,792.52
2.基金赎回款	-230,935,106.27	19,736,201.14	-211,198,905.13
(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	589,849,103.75	-80,125,160.51	509,723,943.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 刘晓艳, 主管会计工作负责人: 陈荣, 会计机构负责人: 王永铿

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1043 号《关于准予易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,088,975,598.82 份基金份额,其中认购资金利息折合 547,709.87 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。

本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业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商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年

12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	37,324,719.22	29,926,078.40
等于：本金	37,321,065.10	29,923,215.76
加：应计利息	3,654.12	2,862.64
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-

加：应计利息	-	-
合计	37,324,719.22	29,926,078.40

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		414,989,390.21	-	397,369,485.80	-17,619,904.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	175,996.53	11.57	176,008.10	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	175,996.53	11.57	176,008.10	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		415,165,386.74	11.57	397,545,493.90	-17,619,904.41
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		504,615,422.04	-	478,733,630.96	-25,881,791.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	504,615,422.04	-	478,733,630.96	-25,881,791.08

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	17,573,640.00	-	-	-
IC2401	6,742,720.00	-	-	-
IC2406	10,830,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	17,573,640.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2401	IC2401	6	6,524,160.00	-218,560.00
IC2406	IC2406	10	10,712,000.00	-118,920.00
合计	-	-	-	-337,480.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-337,480.00

净额	-	-	-	-
----	---	---	---	---

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	22.84	112.62
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	124,198.54	173,271.43
其中：交易所市场	124,198.54	173,271.43
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	181,000.00
合计	304,221.38	354,384.05

7.4.7.7 实收基金

易方达中证 500 量化增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	439,130,298.21	439,130,298.21
本期申购	47,361,478.20	47,361,478.20
本期赎回（以“-”号填列）	-92,270,659.49	-92,270,659.49
本期末	394,221,116.92	394,221,116.92

易方达中证 500 量化增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	150,718,805.54	150,718,805.54
本期申购	186,717,631.59	186,717,631.59
本期赎回（以“-”号填列）	-195,669,127.93	-195,669,127.93
本期末	141,767,309.20	141,767,309.20

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

易方达中证 500 量化增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-36,985,111.31	-22,217,543.45	-59,202,654.76
本期期初	-36,985,111.31	-22,217,543.45	-59,202,654.76
本期利润	-24,167,535.45	8,567,622.59	-15,599,912.86
本期基金份额交易产生的变动数	4,519,281.02	632,241.56	5,151,522.58
其中：基金申购款	-4,646,102.02	-555,769.34	-5,201,871.36
基金赎回款	9,165,383.04	1,188,010.90	10,353,393.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-56,633,365.74	-13,017,679.30	-69,651,045.04

易方达中证 500 量化增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-13,321,782.99	-7,600,722.76	-20,922,505.75
本期期初	-13,321,782.99	-7,600,722.76	-20,922,505.75
本期利润	-8,211,848.07	-643,215.92	-8,855,063.99
本期基金份额交易产生的变动数	263,180.63	3,580,936.02	3,844,116.65
其中：基金申购款	-16,706,301.84	779,821.34	-15,926,480.50
基金赎回款	16,969,482.47	2,801,114.68	19,770,597.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,270,450.43	-4,663,002.66	-25,933,453.09

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	106,699.79	171,048.01
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	23,918.43	89,522.50
其他	1,104.02	1,019.68
合计	131,722.24	261,590.19

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-34,699,387.76	-60,434,718.58
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-34,699,387.76	-60,434,718.58

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,822,147,779.34	1,924,997,411.14
减：卖出股票成本总额	1,854,286,109.35	1,982,378,524.62
减：交易费用	2,561,057.75	3,053,605.10
买卖股票差价收入	-34,699,387.76	-60,434,718.58

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	102.25	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	46,778.93	-
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	46,881.18	-

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	180,882.97	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	133,998.41	-
减：应计利息总额	98.45	-
减：交易费用	7.18	-
买卖债券差价收入	46,778.93	-

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益	-418.28	-6,730,472.81

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,466,861.78	8,493,135.31
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	7,466,861.78	8,493,135.31

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	8,261,886.67	-35,111,880.55
——股票投资	8,261,886.67	-35,111,880.55
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-337,480.00	-1,711,469.38
——权证投资	-	-
——期货投资	-337,480.00	-1,711,469.38
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	7,924,406.67	-36,823,349.93

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	122,778.73	179,913.76
合计	122,778.73	179,913.76

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	60,000.00	61,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	3,867.16	3,929.22
合计	183,867.16	184,929.22

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东

珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券	3,569,442,147.19	100.00%	3,821,045,023.51	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
广发证券	180,882.97	100.00%	-	-

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	713,916.52	100.00%	124,198.54	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券	764,227.79	100.00%	173,271.43	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,068,487.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,453,077.56	1,699,581.86
应支付基金管理人的净管理费	2,615,410.09	2,893,103.75

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	762,841.39	861,128.57

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C	合计
易方达基金管理有限公司	-	85,936.03	85,936.03
中国工商银行	-	76,060.26	76,060.26
广发证券	-	8,851.48	8,851.48
合计	-	170,847.77	170,847.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证500量化增强A	易方达中证500量化增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	39,948.72	39,948.72
中国工商银行	-	83,092.80	83,092.80
广发证券	-	9,031.05	9,031.05
合计	-	132,072.57	132,072.57

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 3 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达中证 500 量化增强 A

无。

易方达中证 500 量化增强 C

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	37,324,719.22	106,699.79	29,926,078.40	171,048.01

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301181	标榜股份	新股网下发行	2,564	103,201.00
广发证券股份有限公司	301220	亚香股份	新股网下发行	2,849	102,507.02
广发证券股份有限公司	600459	贵研铂业	配股	59,790	652,308.90
广发证券股份有限公司	603057	紫燕食品	新股网下发行	549	8,317.35
广发证券股份有限公司	603255	鼎际得	新股网下发行	489	10,699.32
广发证券股份有限公司	688496	清越科技	新股网下发行	12,000	109,920.00

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

易方达中证 500 量化增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 500 量化增强 C

本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001326	联域股份	2023-11-01	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023-08-30	6 个月	新股流通受限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301272	英华特	2023-07-06	6 个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	28.36	703	26,805.39	19,937.08	-
301329	信音电子	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6 个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6 个月	新股流通受限	55.68	37.58	278	15,479.04	10,447.24	-

301372	科净源	2023-08-03	6 个月	新股 流通 受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6 个月	新股 流通 受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6 个月	新股 流通 受限	67.68	59.37	223	15,092.64	13,239.51	-
301413	安培龙	2023-12-11	6 个月	新股 流通 受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6 个月	新股 流通 受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新股 流通 受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6 个月	新股 流通 受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股 流通 受限	57.66	47.25	351	20,238.66	16,584.75	-
301487	盟固利	2023-08-01	6 个月	新股 流通 受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股 流通 受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6 个月	新股 流通 受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6 个月	新股 流通 受限	39.99	38.81	432	17,275.68	16,765.92	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6 个月	新股 流通 受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6 个月	新股 流通 受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023-08-24	6 个月	新股 流通	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-

				受限							
301508	中机 认检	2023-11-23	6 个月	新股 流通 受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-	
301510	固高 科技	2023-08-04	6 个月	新股 流通 受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-	
301515	港通 医疗	2023-07-13	6 个月	新股 流通 受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-	
301516	中远 通	2023-12-01	6 个月	新股 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-	
301517	陕西 华达	2023-10-09	6 个月	新股 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	
301518	长华 化学	2023-07-26	6 个月	新股 流通 受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-	
301519	舜禹 股份	2023-07-19	6 个月	新股 流通 受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-	
301520	万邦 医药	2023-09-18	6 个月	新股 流通 受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-	
301525	儒竞 科技	2023-08-23	6 个月	新股 流通 受限	99.57	81.46	140	13,939.80	11,404.40	-	
301526	国际 复材	2023-12-19	6 个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	7,651	20,351.66	34,046.95	-	
301528	多浦 乐	2023-08-17	6 个月	新股 流通 受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-	
301529	福赛 科技	2023-08-31	6 个月	新股 流通 受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301533	威马 农机	2023-08-07	6 个月	新股 流通 受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	
301548	崇德 科技	2023-09-11	6 个月	新股 流通 受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	
301555	惠柏	2023-10-24	6 个月	新股	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	

	新材			流通受限						
301558	三态股份	2023-09-21	6 个月	新股流通受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新股流通受限	24.22	18.24	590	14,289.80	10,761.60	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6 个月	新股流通受限	11.25	11.07	767	8,628.75	8,490.69	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6 个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,856	6,555.20	15,655.36	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6 个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新股流通受限	58.08	57.81	115	6,679.20	6,648.15	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023-10-09	6 个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-

603270	金帝股份	2023-08-25	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	80.80	77.75	226	18,260.80	17,571.50	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新股流通受限	9.87	12.75	2,087	20,598.69	26,609.25	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6 个月	新股流通受限	5.18	8.09	2,920	15,125.60	23,622.80	-
688573	信宇人	2023-08-09	6 个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	38.67	553	14,787.22	21,384.51	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688592	司南导航	2023-08-07	6 个月	新股流通受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新股流通受限	47.29	37.97	297	14,045.13	11,277.09	-
688627	精智达	2023-07-11	6 个月	新股流通	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-

				受限						
688646	逸飞激光	2023-07-21	6 个月	新股流通受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新股流通受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	新股流通受限	31.95	52.25	395	12,620.25	20,638.75	-
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新股流通受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6 个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新股流通受限	42.66	48.18	323	13,779.18	15,562.14	-
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	新股流通受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

7.4.12.1.2 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
113069	博 23 转债	2023-12-25	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.00	1,760	176,000.00	176,008.10	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股

票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为股票基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合基金、债券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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的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、以及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“风险揭示”部分。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险

管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	176,008.10	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	176,008.10	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00

AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2023 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	37,324,719.22	-	-	-	37,324,719.22
结算备付金	2,757,219.91	-	-	-	2,757,219.91
存出保证金	2,096,902.80	-	-	-	2,096,902.80
交易性金融资产	-	176,008.10	-	397,369,485.80	397,545,493.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	934,572.98	934,572.98
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	528,264.98	528,264.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	42,178,841.93	176,008.10	-	398,832,323.76	441,187,173.79
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	-	-	-	96,855.30	96,855.30
应付管理人报酬	-	-	-	297,289.39	297,289.39
应付托管费	-	-	-	55,741.74	55,741.74

应付销售服务费	-	-	-	29,137.76	29,137.76
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.23	0.23
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	304,221.38	304,221.38
负债总计	-	-	-	783,245.80	783,245.80
利率敏感度缺口	42,178,841.93	176,008.10	-	398,049,077.96	440,403,927.99
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	29,926,078.40	-	-	-	29,926,078.40
结算备付金	1,099,258.86	-	-	-	1,099,258.86
存出保证金	49,130.62	-	-	-	49,130.62
交易性金融资产	-	-	-	478,733,630.96	478,733,630.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	821,240.94	821,240.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	31,074,467.88	-	-	479,554,871.90	510,629,339.78
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	-	-	-	98,325.31	98,325.31
应付管理人报酬	-	-	-	353,039.75	353,039.75
应付托管费	-	-	-	66,194.95	66,194.95
应付销售服务费	-	-	-	33,452.48	33,452.48

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	-	-	-	354,384.05	354,384.05
负债总计	-	-	-	905,396.54	905,396.54
利率敏感度缺口	31,074,467.88	-	-	478,649,475.36	509,723,943.24

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	397,369,485.80	90.23	478,733,630.96	93.92
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	397,369,485.80	90.23	478,733,630.96	93.92

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	20,336,306.74	25,467,820.52
	2.业绩比较基准下降 5%	-20,336,306.74	-25,467,820.52

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	396,451,253.80	477,258,807.14
第二层次	176,008.10	941,094.60
第三层次	918,232.00	533,729.22
合计	397,545,493.90	478,733,630.96

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应

属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	533,729.22	533,729.22
当期购买	-	1,621,645.77	1,621,645.77
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,594,322.82	1,594,322.82
当期利得或损失总额	-	357,179.83	357,179.83
其中：计入损益的利得或损失	-	357,179.83	357,179.83
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	918,232.00	918,232.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	176,268.27	176,268.27
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	2,797,053.04	2,797,053.04
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	3,466,844.31	3,466,844.31
当期利得或损失总额	-	1,203,520.49	1,203,520.49
其中：计入损益的利得或损失	-	1,203,520.49	1,203,520.49
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-

期末余额	-	533,729.22	533,729.22
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	66,057.47	66,057.47

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	918,232.00	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962—2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	533,729.22	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2063—2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	397,369,485.80	90.07
	其中：股票	397,369,485.80	90.07
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	176,008.10	0.04
	其中：债券	176,008.10	0.04
	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	40,081,939.13	9.09
8	其他各项资产	3,559,740.76	0.81
9	合计	441,187,173.79	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,718.00	0.00
B	采矿业	20,180,214.00	4.58
C	制造业	206,164,468.72	46.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,477,201.00	3.06
E	建筑业	5,198,527.00	1.18
F	批发和零售业	10,187,387.23	2.31
G	交通运输、仓储和邮政业	4,732,251.00	1.07
H	住宿和餐饮业	2,327,380.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,547,173.78	5.12
J	金融业	30,394,221.44	6.90
K	房地产业	6,444,328.00	1.46
L	租赁和商务服务业	382,259.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	200,026.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	3,668,916.00	0.83

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	332,983.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	5,706,462.00	1.30
S	综合	-	-
	合计	331,945,516.17	75.37

8.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,152.00	0.00
B	采矿业	2,062,169.00	0.47
C	制造业	50,108,937.54	11.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	190,836.00	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	56,342.59	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,462,120.69	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,425,978.84	1.91
J	金融业	691,251.00	0.16
K	房地产业	1,117,039.00	0.25
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,293,507.68	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069.29	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	508.00	0.00
S	综合	-	-

合计	65,423,969.63	14.86
----	---------------	-------

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601058	赛轮轮胎	314,100	3,690,675.00	0.84
2	601168	西部矿业	257,400	3,673,098.00	0.83
3	002028	思源电气	69,700	3,627,188.00	0.82
4	000630	铜陵有色	1,082,600	3,550,928.00	0.81
5	601233	桐昆股份	230,700	3,490,491.00	0.79
6	300394	天孚通信	37,900	3,468,608.00	0.79
7	600161	天坛生物	109,700	3,394,118.00	0.77
8	601555	东吴证券	456,240	3,335,114.40	0.76
9	002138	顺络电子	119,900	3,238,499.00	0.74
10	688169	石头科技	11,239	3,180,075.05	0.72
11	300724	捷佳伟创	42,000	3,108,420.00	0.71
12	601108	财通证券	391,438	3,037,558.88	0.69
13	000932	华菱钢铁	582,825	3,001,548.75	0.68
14	002223	鱼跃医疗	86,400	2,987,712.00	0.68
15	600066	宇通客车	225,300	2,985,225.00	0.68
16	300017	网宿科技	376,364	2,954,457.40	0.67
17	600529	山东药玻	114,900	2,941,440.00	0.67
18	300568	星源材质	189,649	2,924,387.58	0.66
19	000783	长江证券	540,200	2,906,276.00	0.66
20	300285	国瓷材料	123,900	2,864,568.00	0.65
21	300866	安克创新	32,200	2,852,920.00	0.65
22	600862	中航高科	128,000	2,835,200.00	0.64
23	300001	特锐德	139,500	2,803,950.00	0.64
24	603160	汇顶科技	40,500	2,798,550.00	0.64
25	603688	石英股份	31,800	2,762,784.00	0.63
26	688188	柏楚电子	10,897	2,758,139.67	0.63
27	000728	国元证券	403,000	2,752,490.00	0.62
28	000997	新大陆	139,500	2,735,595.00	0.62
29	600535	天士力	159,800	2,719,796.00	0.62
30	603338	浙江鼎力	52,800	2,701,776.00	0.61
31	600637	东方明珠	355,500	2,673,360.00	0.61
32	002128	电投能源	186,900	2,667,063.00	0.61
33	600985	淮北矿业	159,900	2,659,137.00	0.60
34	601128	常熟银行	414,500	2,648,655.00	0.60
35	000591	太阳能	473,600	2,642,688.00	0.60

36	603225	新凤鸣	185,800	2,638,360.00	0.60
37	601966	玲珑轮胎	136,700	2,628,741.00	0.60
38	600820	隧道股份	454,800	2,619,648.00	0.59
39	688002	睿创微纳	59,218	2,618,619.96	0.59
40	600369	西南证券	638,500	2,611,465.00	0.59
41	601958	金铂股份	275,400	2,602,530.00	0.59
42	300251	光线传媒	318,700	2,597,405.00	0.59
43	601717	郑煤机	204,300	2,584,395.00	0.59
44	600153	建发股份	267,700	2,577,951.00	0.59
45	002032	苏泊尔	47,700	2,528,577.00	0.57
46	688516	奥特维	27,679	2,504,949.50	0.57
47	300558	贝达药业	48,200	2,484,710.00	0.56
48	300487	蓝晓科技	46,650	2,475,249.00	0.56
49	002025	航天电器	50,900	2,444,218.00	0.55
50	002939	长城证券	304,600	2,436,800.00	0.55
51	002568	百润股份	98,700	2,429,007.00	0.55
52	600038	中直股份	62,400	2,404,272.00	0.55
53	000598	兴蓉环境	412,700	2,348,263.00	0.53
54	688029	南微医学	24,255	2,347,884.00	0.53
55	603893	瑞芯微	36,800	2,333,120.00	0.53
56	600258	首旅酒店	149,000	2,327,380.00	0.53
57	002595	豪迈科技	77,500	2,307,175.00	0.52
58	002572	索菲亚	144,400	2,303,180.00	0.52
59	600737	中粮糖业	279,500	2,303,080.00	0.52
60	002683	广东宏大	114,100	2,291,128.00	0.52
61	600808	马钢股份	838,700	2,281,264.00	0.52
62	603737	三棵树	47,400	2,256,714.00	0.51
63	600418	江淮汽车	138,100	2,230,315.00	0.51
64	603885	吉祥航空	185,100	2,221,200.00	0.50
65	600801	华新水泥	177,400	2,205,082.00	0.50
66	002653	海思科	94,000	2,176,100.00	0.49
67	002563	森马服饰	375,400	2,166,058.00	0.49
68	000959	首钢股份	625,100	2,162,846.00	0.49
69	002244	滨江集团	297,400	2,162,098.00	0.49
70	688006	杭可科技	91,677	2,152,575.96	0.49
71	603568	伟明环保	132,100	2,113,600.00	0.48
72	603317	天味食品	158,530	2,106,863.70	0.48
73	000537	中绿电	216,500	2,084,895.00	0.47
74	000089	深圳机场	317,000	2,038,310.00	0.46
75	003031	中瓷电子	22,800	2,011,644.00	0.46
76	688208	道通科技	83,801	1,990,273.75	0.45
77	600642	申能股份	309,800	1,988,916.00	0.45
78	688099	晶晨股份	31,717	1,986,435.71	0.45
79	002739	万达电影	152,350	1,983,597.00	0.45

80	603650	彤程新材	59,400	1,978,020.00	0.45
81	002465	海格通信	150,105	1,928,849.25	0.44
82	000539	粤电力 A	393,100	1,922,259.00	0.44
83	601636	旗滨集团	275,000	1,881,000.00	0.43
84	001914	招商积余	156,500	1,871,740.00	0.43
85	002353	杰瑞股份	65,900	1,852,449.00	0.42
86	600109	国金证券	203,000	1,843,240.00	0.42
87	600563	法拉电子	19,900	1,842,740.00	0.42
88	603233	大参林	73,368	1,826,863.20	0.41
89	002203	海亮股份	163,200	1,819,680.00	0.41
90	600859	王府井	113,400	1,810,998.00	0.41
91	300682	朗新科技	109,400	1,793,066.00	0.41
92	002273	水晶光电	130,600	1,768,324.00	0.40
93	601577	长沙银行	256,788	1,751,294.16	0.40
94	000878	云南铜业	159,800	1,740,222.00	0.40
95	300677	英科医疗	73,600	1,719,296.00	0.39
96	603883	老百姓	57,200	1,709,708.00	0.39
97	600528	中铁工业	224,700	1,671,768.00	0.38
98	000739	普洛药业	107,100	1,648,269.00	0.37
99	601778	晶科科技	469,800	1,644,300.00	0.37
100	002557	洽洽食品	47,000	1,636,540.00	0.37
101	600155	华创云信	196,200	1,636,308.00	0.37
102	300850	新强联	51,000	1,623,330.00	0.37
103	600970	中材国际	173,200	1,617,688.00	0.37
104	600655	豫园股份	259,800	1,613,358.00	0.37
105	600959	江苏有线	509,800	1,600,772.00	0.36
106	000709	河钢股份	739,300	1,574,709.00	0.36
107	603927	中科软	52,000	1,558,960.00	0.35
108	001203	大中矿业	151,500	1,540,755.00	0.35
109	300146	汤臣倍健	88,360	1,504,770.80	0.34
110	600968	海油发展	512,400	1,460,340.00	0.33
111	000887	中鼎股份	118,000	1,459,660.00	0.33
112	600566	济川药业	44,500	1,398,635.00	0.32
113	002867	周大生	91,000	1,381,380.00	0.31
114	688180	君实生物	32,413	1,355,835.79	0.31
115	603517	绝味食品	50,000	1,343,000.00	0.30
116	300861	美畅股份	40,200	1,338,258.00	0.30
117	002422	科伦药业	43,600	1,266,580.00	0.29
118	002600	领益智造	168,900	1,141,764.00	0.26
119	300474	景嘉微	15,900	1,124,289.00	0.26
120	300207	欣旺达	75,500	1,114,380.00	0.25
121	002078	太阳纸业	90,300	1,098,951.00	0.25
122	002463	沪电股份	47,900	1,059,548.00	0.24
123	600497	驰宏锌锗	203,200	1,026,160.00	0.23

124	600482	中国动力	56,900	1,024,769.00	0.23
125	603868	飞科电器	19,900	1,004,950.00	0.23
126	603026	胜华新材	21,800	999,748.00	0.23
127	600096	云天化	63,400	989,040.00	0.22
128	002756	永兴材料	18,100	945,001.00	0.21
129	600988	赤峰黄金	65,800	921,858.00	0.21
130	002517	恺英网络	80,400	898,068.00	0.20
131	600582	天地科技	161,400	878,016.00	0.20
132	002439	启明星辰	32,400	874,800.00	0.20
133	000423	东阿阿胶	17,700	872,964.00	0.20
134	000729	燕京啤酒	96,300	831,069.00	0.19
135	600901	江苏金租	171,400	829,576.00	0.19
136	300118	东方日升	46,300	817,195.00	0.19
137	000825	太钢不锈	218,800	816,124.00	0.19
138	300070	碧水源	162,400	810,376.00	0.18
139	600390	五矿资本	170,800	799,344.00	0.18
140	600170	上海建工	338,800	792,792.00	0.18
141	688772	珠海冠宇	35,770	787,297.70	0.18
142	601665	齐鲁银行	201,000	785,910.00	0.18
143	000563	陕国投 A	258,400	785,536.00	0.18
144	002373	千方科技	69,000	773,490.00	0.18
145	000027	深圳能源	119,400	770,130.00	0.17
146	002266	浙富控股	219,100	744,940.00	0.17
147	300776	帝尔激光	12,300	741,198.00	0.17
148	002558	巨人网络	65,800	733,012.00	0.17
149	603866	桃李面包	94,400	723,104.00	0.16
150	002408	齐翔腾达	136,800	722,304.00	0.16
151	600282	南钢股份	191,100	707,070.00	0.16
152	688520	神州细胞	13,027	701,764.49	0.16
153	002690	美亚光电	35,730	701,737.20	0.16
154	600764	中国海防	28,000	698,600.00	0.16
155	002958	青农商行	259,900	680,938.00	0.15
156	603156	养元饮品	31,800	676,068.00	0.15
157	688234	天岳先进	10,179	672,526.53	0.15
158	601991	大唐发电	272,600	659,692.00	0.15
159	601666	平煤股份	56,400	651,984.00	0.15
160	300888	稳健医疗	17,400	648,150.00	0.15
161	688082	盛美上海	6,021	628,652.61	0.14
162	603786	科博达	8,600	613,696.00	0.14
163	002153	石基信息	62,300	606,802.00	0.14
164	688153	唯捷创芯	9,220	603,910.00	0.14
165	300026	红日药业	138,300	586,392.00	0.13
166	688276	百克生物	10,668	584,713.08	0.13
167	601139	深圳燃气	84,300	580,827.00	0.13

168	688281	华秦科技	4,186	567,872.76	0.13
169	600062	华润双鹤	26,800	498,480.00	0.11
170	000738	航发控制	24,900	495,510.00	0.11
171	600339	中油工程	157,400	476,922.00	0.11
172	600977	中国电影	38,700	473,688.00	0.11
173	600167	联美控股	79,600	451,332.00	0.10
174	600079	人福医药	10,100	251,086.00	0.06
175	300502	新易盛	5,000	246,600.00	0.06
176	600885	宏发股份	8,600	237,704.00	0.05
177	600373	中文传媒	17,900	235,922.00	0.05
178	601077	渝农商行	57,700	235,416.00	0.05
179	600141	兴发集团	11,900	217,175.00	0.05
180	600765	中航重机	11,300	215,943.00	0.05
181	002044	美年健康	35,200	211,552.00	0.05
182	600177	雅戈尔	32,000	209,600.00	0.05
183	600160	巨化股份	12,700	209,423.00	0.05
184	002865	钧达股份	2,700	209,196.00	0.05
185	300088	长信科技	30,700	205,383.00	0.05
186	600879	航天电子	25,900	199,689.00	0.05
187	000960	锡业股份	13,700	196,184.00	0.04
188	300383	光环新网	19,600	190,512.00	0.04
189	000039	中集集团	24,900	190,485.00	0.04
190	300296	利亚德	31,700	190,200.00	0.04
191	002064	华峰化学	28,200	189,222.00	0.04
192	600416	湘电股份	11,900	188,972.00	0.04
193	600704	物产中大	42,500	188,275.00	0.04
194	600998	九州通	26,803	187,889.03	0.04
195	002414	高德红外	25,700	187,610.00	0.04
196	002429	兆驰股份	33,300	185,814.00	0.04
197	002056	横店东磁	13,700	185,498.00	0.04
198	300253	卫宁健康	25,700	184,783.00	0.04
199	601216	君正集团	49,300	184,382.00	0.04
200	600498	烽火通信	11,000	183,040.00	0.04
201	600271	航天信息	17,200	183,008.00	0.04
202	300009	安科生物	17,900	182,938.00	0.04
203	600380	健康元	14,700	182,721.00	0.04
204	601231	环旭电子	12,000	181,320.00	0.04
205	600580	卧龙电驱	15,400	180,642.00	0.04
206	000547	航天发展	21,400	179,118.00	0.04
207	600481	双良节能	21,100	178,506.00	0.04
208	601179	中国西电	36,100	177,973.00	0.04
209	688538	和辉光电	71,533	173,825.19	0.04
210	600848	上海临港	16,900	169,845.00	0.04
211	603228	景旺电子	7,500	169,200.00	0.04

212	000987	越秀资本	28,100	169,162.00	0.04
213	601611	中国核建	24,300	168,399.00	0.04
214	600517	国网英大	35,100	167,427.00	0.04
215	600500	中化国际	37,800	167,076.00	0.04
216	002625	光启技术	11,300	167,014.00	0.04
217	002511	中顺洁柔	16,700	167,000.00	0.04
218	688779	长远锂科	22,706	165,753.80	0.04
219	000883	湖北能源	39,100	165,393.00	0.04
220	601106	中国一重	57,300	165,024.00	0.04
221	603218	日月股份	13,300	164,521.00	0.04
222	600755	厦门国贸	23,500	163,795.00	0.04
223	600967	内蒙一机	19,800	163,548.00	0.04
224	000937	冀中能源	22,900	163,506.00	0.04
225	600521	华海药业	11,100	162,837.00	0.04
226	601608	中信重工	42,100	162,506.00	0.04
227	603707	健友股份	10,800	162,000.00	0.04
228	688425	铁建重工	40,761	161,821.17	0.04
229	601187	厦门银行	31,600	160,212.00	0.04
230	601098	中南传媒	15,700	159,669.00	0.04
231	000559	万向钱潮	30,700	159,333.00	0.04
232	002423	中粮资本	23,700	158,316.00	0.04
233	000401	冀东水泥	24,700	157,833.00	0.04
234	000930	中粮科技	23,700	157,368.00	0.04
235	600597	光明乳业	18,000	157,140.00	0.04
236	601568	北元集团	33,100	156,894.00	0.04
237	000958	电投产融	39,700	156,418.00	0.04
238	688387	信科移动	21,622	155,894.62	0.04
239	600663	陆家嘴	17,800	155,750.00	0.04
240	000156	华数传媒	21,100	155,507.00	0.04
241	300003	乐普医疗	9,600	155,136.00	0.04
242	688107	安路科技	4,187	153,997.86	0.03
243	002010	传化智联	32,800	151,536.00	0.03
244	600928	西安银行	45,100	150,183.00	0.03
245	600350	山东高速	21,600	149,904.00	0.03
246	002399	海普瑞	12,700	148,971.00	0.03
247	600352	浙江龙盛	17,700	148,680.00	0.03
248	601228	广州港	47,500	148,675.00	0.03
249	002185	华天科技	17,400	148,248.00	0.03
250	601828	美凯龙	38,100	147,447.00	0.03
251	600299	安迪苏	18,400	147,200.00	0.03
252	002608	江苏国信	21,900	143,883.00	0.03
253	000553	安道麦 A	20,400	141,576.00	0.03
254	002294	信立泰	4,300	140,438.00	0.03
255	601298	青岛港	22,500	139,050.00	0.03

256	600392	盛和资源	13,600	138,448.00	0.03
257	002673	西部证券	20,800	132,496.00	0.03
258	688728	格科微	6,436	131,744.92	0.03
259	002065	东华软件	21,300	131,421.00	0.03
260	002152	广电运通	10,600	129,956.00	0.03
261	600549	厦门钨业	7,400	127,132.00	0.03
262	002506	协鑫集成	45,300	124,122.00	0.03
263	600906	财达证券	16,400	123,000.00	0.03
264	300244	迪安诊断	5,100	121,431.00	0.03
265	002092	中泰化学	19,900	121,390.00	0.03
266	688778	厦钨新能	3,003	119,038.92	0.03
267	002019	亿帆医药	7,900	116,762.00	0.03
268	003035	南网能源	22,100	116,246.00	0.03
269	000970	中科三环	11,100	114,885.00	0.03
270	603858	步长制药	6,600	112,266.00	0.03
271	002430	杭氧股份	3,800	110,998.00	0.03
272	003022	联泓新科	6,000	109,860.00	0.02
273	300144	宋城演艺	10,200	100,674.00	0.02
274	600927	永安期货	6,300	98,973.00	0.02
275	688331	荣昌生物	1,552	96,317.12	0.02
276	601158	重庆水务	16,500	93,555.00	0.02
277	300418	昆仑万维	2,500	93,500.00	0.02
278	300012	华测检测	5,900	83,780.00	0.02
279	000785	居然之家	24,800	81,840.00	0.02
280	603939	益丰药房	2,000	80,080.00	0.02
281	002340	格林美	13,900	75,894.00	0.02
282	000933	神火股份	4,400	73,920.00	0.02
283	600143	金发科技	8,700	69,513.00	0.02
284	600060	海信视像	3,300	68,970.00	0.02
285	600873	梅花生物	7,000	66,850.00	0.02
286	300373	扬杰科技	1,800	66,060.00	0.01
287	300595	欧普康视	2,800	63,224.00	0.01
288	600008	首创环保	23,500	63,215.00	0.01
289	603712	七一二	2,000	63,020.00	0.01
290	000703	恒逸石化	8,900	59,808.00	0.01
291	688690	纳微科技	2,146	58,843.32	0.01
292	688819	天能股份	1,865	52,070.80	0.01
293	603355	莱克电气	2,300	51,290.00	0.01
294	002925	盈趣科技	2,600	50,622.00	0.01
295	600925	苏能股份	8,300	45,733.00	0.01
296	001872	招商港口	2,200	35,112.00	0.01
297	000581	威孚高科	2,200	33,154.00	0.01
298	600699	均胜电子	1,800	32,328.00	0.01
299	600827	百联股份	3,000	28,470.00	0.01

300	688200	华峰测控	200	24,560.00	0.01
301	000988	华工科技	800	23,808.00	0.01
302	002850	科达利	200	16,892.00	0.00
303	603529	爱玛科技	500	12,520.00	0.00
304	600298	安琪酵母	200	7,036.00	0.00
305	002409	雅克科技	100	5,573.00	0.00
306	600378	昊华科技	100	3,048.00	0.00
307	002518	科士达	100	2,760.00	0.00
308	000155	川能动力	200	2,658.00	0.00
309	002299	圣农发展	100	1,718.00	0.00
310	688390	固德威	13	1,697.54	0.00
311	002080	中材科技	100	1,592.00	0.00
312	300058	蓝色光标	200	1,436.00	0.00
313	002531	天顺风能	100	1,160.00	0.00
314	601456	国联证券	100	1,084.00	0.00
315	601696	中银证券	100	1,029.00	0.00
316	000778	新兴铸管	200	764.00	0.00
317	601016	节能风电	30	90.00	0.00

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688127	蓝特光学	99,351	2,313,884.79	0.53
2	688036	传音控股	15,547	2,151,704.80	0.49
3	603063	禾望电气	85,000	2,125,000.00	0.48
4	688608	恒玄科技	12,591	1,942,413.57	0.44
5	688368	晶丰明源	16,215	1,750,247.10	0.40
6	300856	科思股份	27,700	1,723,771.00	0.39
7	002891	中宠股份	59,600	1,570,460.00	0.36
8	688076	诺泰生物	31,333	1,408,418.35	0.32
9	003038	鑫铂股份	39,000	1,339,650.00	0.30
10	300782	卓胜微	9,500	1,339,500.00	0.30
11	601021	春秋航空	26,400	1,325,280.00	0.30
12	300693	盛弘股份	44,200	1,322,022.00	0.30
13	688366	昊海生科	11,894	1,288,001.26	0.29
14	600409	三友化工	234,300	1,286,307.00	0.29
15	601918	新集能源	241,800	1,274,286.00	0.29
16	600372	中航机载	96,178	1,267,626.04	0.29
17	601137	博威合金	80,600	1,251,718.00	0.28
18	600623	华谊集团	192,100	1,237,124.00	0.28
19	600346	恒力石化	93,600	1,232,712.00	0.28
20	688106	金宏气体	50,851	1,225,000.59	0.28

21	002212	天融信	123,900	1,211,742.00	0.28
22	688088	虹软科技	29,183	1,197,670.32	0.27
23	300274	阳光电源	13,400	1,173,706.00	0.27
24	688578	艾力斯	27,918	1,163,063.88	0.26
25	601155	新城控股	97,900	1,117,039.00	0.25
26	600745	闻泰科技	26,000	1,100,060.00	0.25
27	002612	朗姿股份	56,400	1,084,572.00	0.25
28	688083	中望软件	10,888	1,083,791.52	0.25
29	688095	福昕软件	14,957	1,044,746.45	0.24
30	300308	中际旭创	8,500	959,735.00	0.22
31	688617	惠泰医疗	2,429	943,666.50	0.21
32	688018	乐鑫科技	8,636	889,076.20	0.20
33	688278	特宝生物	16,314	854,037.90	0.19
34	688408	中信博	11,185	802,523.75	0.18
35	688131	皓元医药	14,637	762,002.22	0.17
36	603556	海兴电力	24,500	711,235.00	0.16
37	002860	星帅尔	49,400	639,730.00	0.15
38	605116	奥锐特	24,100	622,262.00	0.14
39	603979	金诚信	16,400	619,264.00	0.14
40	688626	翔宇医疗	11,411	608,092.19	0.14
41	300638	广和通	31,300	595,639.00	0.14
42	688016	心脉医疗	3,047	593,037.61	0.13
43	002158	汉钟精机	26,000	578,760.00	0.13
44	300973	立高食品	11,900	577,745.00	0.13
45	603590	康辰药业	14,700	559,776.00	0.13
46	300882	万胜智能	22,600	550,536.00	0.13
47	300919	中伟股份	11,100	545,343.00	0.12
48	688080	映翰通	13,411	544,218.38	0.12
49	688510	航亚科技	29,342	517,006.04	0.12
50	688398	赛特新材	16,212	512,299.20	0.12
51	002641	公元股份	100,500	505,515.00	0.11
52	300113	顺网科技	34,800	487,200.00	0.11
53	603859	能科科技	11,700	441,441.00	0.10
54	000661	长春高新	2,800	408,240.00	0.09
55	600926	杭州银行	34,900	349,349.00	0.08
56	688582	芯动联科	4,867	188,206.89	0.04
57	300217	东方电热	33,500	180,230.00	0.04
58	688256	寒武纪	1,328	179,226.88	0.04
59	603699	纽威股份	12,800	177,408.00	0.04
60	002540	亚太科技	25,800	170,538.00	0.04
61	603992	松霖科技	9,400	170,516.00	0.04
62	301383	天键股份	2,600	169,000.00	0.04
63	603345	安井食品	1,600	167,376.00	0.04
64	601899	紫金矿业	13,400	166,964.00	0.04

65	002327	富安娜	18,400	164,680.00	0.04
66	603848	好太太	10,500	162,540.00	0.04
67	300842	帝科股份	2,300	162,265.00	0.04
68	688489	三未信安	3,447	162,077.94	0.04
69	002215	诺普信	18,600	153,636.00	0.03
70	300491	通合科技	6,700	149,276.00	0.03
71	301377	鼎泰高科	5,900	139,535.00	0.03
72	600312	平高电气	10,500	133,245.00	0.03
73	000338	潍柴动力	9,700	132,405.00	0.03
74	002357	富临运业	17,000	128,350.00	0.03
75	600845	宝信软件	2,600	126,880.00	0.03
76	301313	凡拓数创	3,500	126,210.00	0.03
77	603238	诺邦股份	8,900	122,375.00	0.03
78	605016	百龙创园	4,300	122,077.00	0.03
79	688676	金盘科技	3,382	121,177.06	0.03
80	688429	时创能源	5,687	120,507.53	0.03
81	002270	华明装备	8,500	120,020.00	0.03
82	600027	华电国际	23,000	118,220.00	0.03
83	002847	盐津铺子	1,700	118,116.00	0.03
84	301050	雷电微力	2,000	116,520.00	0.03
85	600572	康恩贝	23,000	116,150.00	0.03
86	600030	中信证券	5,200	105,924.00	0.02
87	301269	华大九天	1,000	105,850.00	0.02
88	600237	铜峰电子	13,600	105,264.00	0.02
89	300671	富满微	3,200	103,456.00	0.02
90	002236	大华股份	5,500	101,475.00	0.02
91	688343	云天励飞	1,916	94,363.00	0.02
92	002837	英维克	3,400	93,432.00	0.02
93	601628	中国人寿	3,200	90,720.00	0.02
94	600612	老凤祥	1,300	89,700.00	0.02
95	300729	乐歌股份	4,900	87,759.00	0.02
96	601336	新华保险	2,800	87,164.00	0.02
97	300700	岱勒新材	5,100	86,547.00	0.02
98	688687	凯因科技	2,449	85,372.14	0.02
99	300893	松原股份	2,900	84,767.00	0.02
100	688439	振华风光	932	83,050.52	0.02
101	688312	燕麦科技	3,994	82,476.10	0.02
102	301273	瑞晨环保	2,900	80,011.00	0.02
103	603283	赛腾股份	1,100	79,816.00	0.02
104	301200	大族数控	2,100	79,317.00	0.02
105	603919	金徽酒	3,200	78,784.00	0.02
106	603617	君禾股份	8,300	76,360.00	0.02
107	300430	诚益通	5,300	75,737.00	0.02
108	000543	皖能电力	11,600	72,616.00	0.02

109	688147	微导纳米	1,795	69,987.05	0.02
110	688223	晶科能源	7,837	69,435.82	0.02
111	301301	川宁生物	8,000	67,200.00	0.02
112	301257	普蕊斯	1,000	63,500.00	0.01
113	603950	长源东谷	4,000	61,600.00	0.01
114	002870	香山股份	1,700	60,979.00	0.01
115	603758	秦安股份	5,200	59,488.00	0.01
116	600837	海通证券	6,200	58,094.00	0.01
117	301233	盛帮股份	1,300	57,746.00	0.01
118	688667	菱电电控	683	56,033.32	0.01
119	003000	劲仔食品	4,400	53,768.00	0.01
120	300990	同飞股份	1,200	53,412.00	0.01
121	603198	迎驾贡酒	800	53,032.00	0.01
122	300547	川环科技	3,100	52,235.00	0.01
123	600887	伊利股份	1,900	50,825.00	0.01
124	000951	中国重汽	3,800	50,768.00	0.01
125	002991	甘源食品	700	50,022.00	0.01
126	603057	紫燕食品	2,300	49,634.00	0.01
127	002371	北方华创	200	49,142.00	0.01
128	603027	千禾味业	2,900	46,893.00	0.01
129	605228	神通科技	3,500	41,335.00	0.01
130	000625	长安汽车	2,200	37,026.00	0.01
131	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
132	301526	国际复材	7,651	34,046.95	0.01
133	603197	保隆科技	600	33,840.00	0.01
134	601633	长城汽车	1,300	32,786.00	0.01
135	300896	爱美客	100	29,433.00	0.01
136	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01
137	688548	广钢气体	2,087	26,609.25	0.01
138	688549	中巨芯	2,920	23,622.80	0.01
139	688652	京仪装备	395	20,638.75	0.00
140	301291	明阳电气	703	19,937.08	0.00
141	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
142	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
143	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
144	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
145	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
146	603296	华勤技术	226	17,571.50	0.00
147	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
148	301498	乖宝宠物	432	16,765.92	0.00
149	301486	致尚科技	351	16,584.75	0.00
150	688019	安集科技	102	16,295.52	0.00
151	601096	宏盛华源	3,856	15,655.36	0.00
152	688702	盛科通信	323	15,562.14	0.00

153	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
154	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
155	301393	昊帆生物	223	13,239.51	0.00
156	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
157	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
158	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
159	301525	儒竞科技	140	11,404.40	0.00
160	688612	威迈斯	297	11,277.09	0.00
161	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
162	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
163	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
164	301559	中集环科	590	10,761.60	0.00
165	301371	敷尔佳	278	10,447.24	0.00
166	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
167	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
168	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
169	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
170	603605	珀莱雅	100	9,940.00	0.00
171	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
172	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
173	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
174	300811	铂科新材	180	9,516.60	0.00
175	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
176	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
177	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
178	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
179	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
180	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
181	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
182	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
183	601083	锦江航运	767	8,490.69	0.00
184	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
185	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
186	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
187	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
188	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
189	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
190	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
191	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
192	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
193	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
194	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
195	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
196	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00

197	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
198	002821	凯莱英	60	6,966.00	0.00
199	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
200	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
201	603062	麦加芯彩	115	6,648.15	0.00
202	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
203	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
204	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
205	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
206	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
207	300618	寒锐钴业	200	5,658.00	0.00
208	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
209	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
210	601869	长飞光纤	191	5,244.86	0.00
211	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
212	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
213	002179	中航光电	110	4,290.00	0.00
214	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
215	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
216	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
217	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
218	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
219	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
220	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
221	002458	益生股份	200	2,152.00	0.00
222	002803	吉宏股份	100	2,056.00	0.00
223	600459	贵研铂业	120	1,723.20	0.00
224	603639	海利尔	100	1,570.00	0.00
225	300115	长盈精密	100	1,325.00	0.00
226	600487	亨通光电	100	1,194.00	0.00
227	600489	中金黄金	100	996.00	0.00
228	002745	木林森	100	866.00	0.00
229	002701	奥瑞金	200	828.00	0.00
230	601969	海南矿业	100	659.00	0.00
231	300182	捷成股份	100	508.00	0.00
232	688575	亚辉龙	22	503.14	0.00
233	002249	大洋电机	100	497.00	0.00
234	002110	三钢闽光	100	405.00	0.00
235	688448	磁谷科技	7	271.81	0.00
236	688091	上海谊众	4	256.00	0.00
237	688253	英诺特	10	250.10	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002422	科伦药业	10,690,012.00	2.10
2	600066	宇通客车	9,470,813.00	1.86
3	002966	苏州银行	9,272,543.00	1.82
4	688777	中控技术	9,139,150.00	1.79
5	601233	桐昆股份	8,809,765.84	1.73
6	300146	汤臣倍健	8,708,583.80	1.71
7	603596	伯特利	8,543,030.00	1.68
8	002353	杰瑞股份	8,397,586.90	1.65
9	600153	建发股份	8,198,155.00	1.61
10	002299	圣农发展	8,015,528.00	1.57
11	002056	横店东磁	7,850,892.00	1.54
12	002223	鱼跃医疗	7,798,987.00	1.53
13	600258	首旅酒店	7,785,508.26	1.53
14	603456	九洲药业	7,766,171.31	1.52
15	600060	海信视像	7,660,258.63	1.50
16	600968	海油发展	7,600,149.00	1.49
17	603568	伟明环保	7,357,898.57	1.44
18	300012	华测检测	7,335,754.00	1.44
19	002384	东山精密	7,334,017.00	1.44
20	300866	安克创新	7,311,009.27	1.43

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002422	科伦药业	14,114,716.00	2.77
2	600060	海信视像	12,561,655.68	2.46
3	603444	吉比特	12,496,753.10	2.45
4	603456	九洲药业	11,685,856.00	2.29
5	002384	东山精密	10,992,910.00	2.16
6	300308	中际旭创	10,905,233.68	2.14
7	600079	人福医药	10,392,754.00	2.04
8	300866	安克创新	10,198,147.00	2.00
9	300144	宋城演艺	9,355,482.16	1.84

10	002966	苏州银行	8,881,922.00	1.74
11	688777	中控技术	8,820,372.75	1.73
12	002340	格林美	8,808,526.00	1.73
13	688256	寒武纪	8,791,594.88	1.72
14	600160	巨化股份	8,780,437.00	1.72
15	688122	西部超导	8,708,879.44	1.71
16	300115	长盈精密	8,381,778.90	1.64
17	600718	东软集团	8,309,679.63	1.63
18	603596	伯特利	8,198,275.00	1.61
19	600521	华海药业	8,175,044.36	1.60
20	601778	晶科科技	7,832,088.31	1.54

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,764,660,077.52
卖出股票收入（成交）总额	1,822,147,779.34

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	176,008.10	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	176,008.10	0.04
----	----	------------	------

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	113069	博 23 转债	1,760	176,008.10	0.04

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国（上海）自由贸易试验区市场监督管理局的处罚。深圳顺络电子股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市公安局龙华分局的处罚。思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中华人民共和国洋山港海事局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,096,902.80
2	应收清算款	934,572.98
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	528,264.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,559,740.76

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

易方达中证 500 量化增强 A	9,504	41,479.49	3,893,690.96	0.99%	390,327,425.96	99.01%
易方达中证 500 量化增强 C	8,012	17,694.37	691,004.59	0.49%	141,076,304.61	99.51%
合计	17,516	30,599.93	4,584,695.55	0.86%	531,403,730.57	99.14%

9.2 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	易方达中证 500 量化增强 A	1,718,590.62	0.4359%
	易方达中证 500 量化增强 C	7,237.99	0.0051%
	合计	1,725,828.61	0.3220%

9.3 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	易方达中证 500 量化增强 A	0
	易方达中证 500 量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证 500 量化增强 A	50~100
	易方达中证 500 量化增强 C	0
	合计	50~100

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
刘文贵	公募基金	0
	私募资产管理计划	0
	合计	0

注：持有本人管理的产品份额总量的数量区间为基金经理本人及其直系亲属持有份额的合计数。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 500 量化增强 A	易方达中证 500 量化增强 C
基金合同生效日（2021 年 6 月 15 日）基金份额总额	777,613,734.55	311,361,864.27
本报告期期初基金份额总额	439,130,298.21	150,718,805.54
本报告期基金总申购份额	47,361,478.20	186,717,631.59
减：本报告期基金总赎回份额	92,270,659.49	195,669,127.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	394,221,116.92	141,767,309.20

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起王骏先生担任公司副总经理级高级管理人员（首席市场官）。本基金管理人于 2023 年 8 月 23 日发布公告，自 2023 年 8 月 21 日起刘晓艳女士担任公司董事长（联席），并仍担任公司总经理，原任公司副董事长职务自行免去；自 2023 年 8 月 21 日起吴欣荣先生担任公司执行总经理（总经理级），原任公司副总经理职务自行免去。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 3 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 60,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司

受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	3,569,442,147.19	100.00%	713,916.52	100.00%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

摩根大通	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券华南	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为国元证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为华福证券有限责任公司。新时代证券股份有限公司更名为诚通证券股份有限公司，安信证券股份有限公司更名为国投证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的 比例		额的比例
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	180,882.97	100.00%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金 2023 年港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-10

2	关于旗下部分基金 2023 年 1 月 19 日至 2023 年 1 月 20 日因港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-16
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-01-20
4	关于旗下部分基金在 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-03
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报	2023-03-30
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
7	关于旗下部分基金 2023 年 4 月 7 日至 2023 年 4 月 10 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-03
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-04-21
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
10	关于旗下部分基金 2023 年 5 月 26 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-23
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-07-20
13	易方达基金管理有限公司董事长（联席）任职公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-23
14	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-23
15	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报	2023-08-30
16	关于旗下部分基金 2023 年 10 月 23 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-10-18
17	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第	中国证券报	2023-10-25

	3 季度报告提示性公告		
18	易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-09
19	关于旗下部分基金 2023 年 12 月 25 日至 2023 年 12 月 26 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-20

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023 年 02 月 07 日~2023 年 03 月 21 日	0.00	159,344,947.39	159,344,947.39	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 500 指数量化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。

13.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

13.3 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

二〇二四年三月二十九日