

# 易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 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：二〇二五年三月三十一日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 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	7
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	12
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	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	75
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 .....	76
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 .....	76
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 .....	76
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 .....	76
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	76
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	76
8.12	投资组合报告附注 .....	77
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>78</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78
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 .....	78
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 .....	79
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>79</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>79</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	79
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 .....	79
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4	基金投资策略的改变 .....	80
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	80
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 .....	80
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
11.8	其他重大事件 .....	83
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>84</b>
12.1	备查文件目录 .....	84
12.2	存放地点 .....	84
12.3	查阅方式 .....	84

## § 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	550,921,975.92 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	374,092,497.04 份	176,829,478.88 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；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
邮政编码		510620； 519031	100140
法定代表人		刘晓艳	廖林

## 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	基金管理人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	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；广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层

## § 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	2024 年		2023 年		2022 年	
	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	7,769,329.21	3,616,273.31	-24,167,535.45	-8,211,848.07	-48,163,343.13	-16,125,015.57
本期利润	30,972,732.70	13,138,314.49	-15,599,912.86	-8,855,063.99	-76,018,413.46	-25,093,295.17
加权平均基金份额本期利润	0.0810	0.0799	-0.0377	-0.0535	-0.1597	-0.1633
本期加权平均净值利润率	9.78%	9.72%	-4.29%	-6.09%	-17.51%	-17.99%
本期基金份额	10.18%	9.84%	-4.84%	-5.12%	-15.50%	-15.75%

净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 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	-46,463,159.65	-23,572,385.74	-69,651,045.04	-25,933,453.09	-59,202,654.76	-20,922,505.75
期末可供分配基金份额利润	-0.1242	-0.1333	-0.1767	-0.1829	-0.1348	-0.1388
期末基金资产净值	339,336,735.49	158,707,003.10	324,570,071.88	115,833,856.11	379,927,643.45	129,796,299.79
期末基金份额净值	0.9071	0.8975	0.8233	0.8171	0.8652	0.8612
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 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	-9.29%	-10.25%	-17.67%	-18.29%	-13.48%	-13.88%

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。

### 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	-0.43%	1.84%	-0.23%	1.93%	-0.20%	-0.09%

过去六个月	13.33%	1.86%	15.14%	1.91%	-1.81%	-0.05%
过去一年	10.18%	1.66%	5.40%	1.73%	4.78%	-0.07%
过去三年	-11.41%	1.29%	-20.91%	1.33%	9.50%	-0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-9.29%	1.20%	-13.81%	1.27%	4.52%	-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	-0.50%	1.84%	-0.23%	1.93%	-0.27%	-0.09%
过去六个月	13.16%	1.86%	15.14%	1.91%	-1.98%	-0.05%
过去一年	9.84%	1.66%	5.40%	1.73%	4.44%	-0.07%
过去三年	-12.20%	1.29%	-20.91%	1.33%	8.71%	-0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-10.25%	1.20%	-13.81%	1.27%	3.56%	-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 2024 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



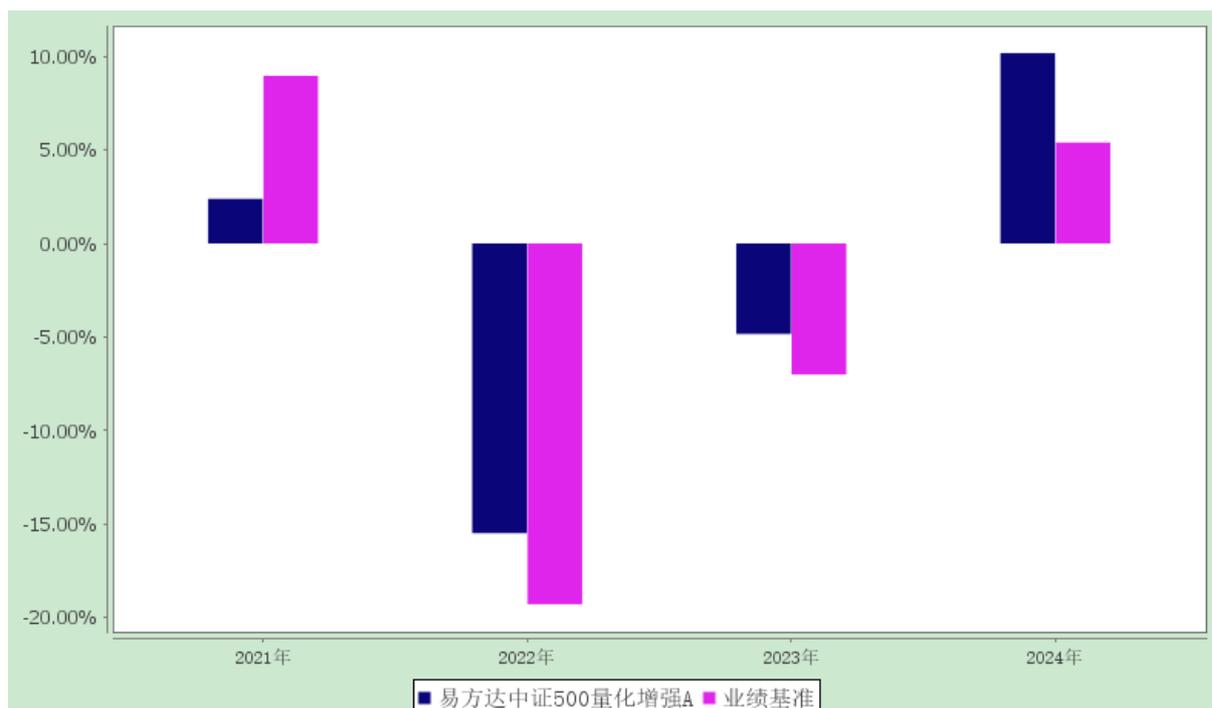
注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为-9.29%，同期业绩比较基准收益率为-13.81%；C 类基金份额净值增长率为-10.25%，同期业绩比较基准收益率为-13.81%。

### 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

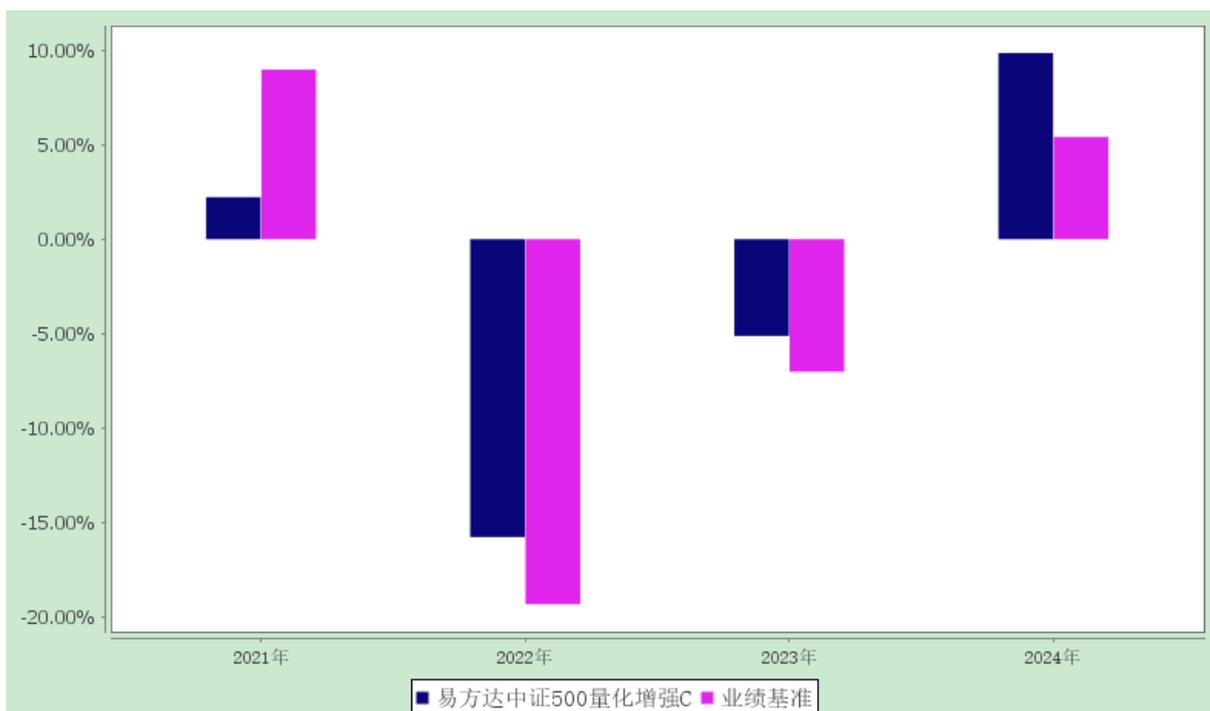
易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金

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

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，本基金管理人成立于2001年4月17日，注册资本13,244.2万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限	证券 从业 年限	说明

		任职日期	离任日期		
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、量化投资决策委员会委员	2021-06-15	-	14 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。
刘文贵	本基金的基金经理,投资经理	2023-11-09	-	12 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责任公司量化投资总监。

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	498,043,738.59	2023-11-09
	私募资产管理计划	1	50,058,979.86	2019-04-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	2	548,102,718.45	-

注:“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

#### 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合规守信情况的说明

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，按监管要求进行相关信息披露，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 82 次，其中 73 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，9 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

2024 年我国宏观经济稳中有进。全年 GDP 总量超 130 万亿元，增长约 5%。产业结构优化，服务业占 GDP 比重升至 56.7%，高端制造业快速发展，高技术制造业、装备制造业增加值占规模以上工业增加值的比重分别达 16.3%、34.6%。需求端，内需主导增长，社零总额 48.8 万亿元，固投 51.4 万亿元；对外开放有序，进出口总额 43.8 万亿元创新高。四季度经济增长动能增强，GDP 增速回升至 5.4%，环比增长 1.6%。生产和需求端增速均加快，消费品以旧换新及相关设备更新发挥积极作用。

2024 年 A 股市场在复杂环境中运行。市场全年震荡上行，上证指数累计涨 12.67%，收盘于 3352 点。走势分四个阶段呈“W 型”，年初至 2 月初，市场因微观交易转弱而走弱；2 月初至 5 月底资金面好转及政策优化推动市场震荡上行；5 月底至 9 月，政策效果观察期，叠加宏观数据表现未及预期，市场震荡向下；9 月 24 日起，因政策积极表态，市场大幅上涨。全年行业分化显著，高股息表现突出，银行领涨，涨幅达 34.39%；消费板块表现不佳，医药生物等跌幅明显。

风格因子方面，小市值风格全年累计收益跑赢大市值，但在个别市场阶段也出现较大回撤；低 PB 因子表现优于往年，累计多空收益显著。选股因子方面，上半年以成长类因子、分析师类因子为代表的基本面因子表现较好，超额收益大幅领先；进入下半年之后，由于市场整体风险偏好显著上升，投资者交易情绪明显回暖，偏中短期的量价类因子表现更为突出。尤其是进入四季度之后，之前表现强势的选股因子纷纷出现不同程度的回撤，其中盈利类因子回撤最为明显。11 月中旬至年底，量价因子率先修复，12 月基本面因子开始修复，ROE 等质量类因子单月多空收益较好。

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 0.9071 元，本报告期份额净值增长率为 10.18%，同期业绩比较基准收益率为 5.40%；C 类基金份额净值为 0.8975 元，本报告期份额净值增长率为 9.84%，同期业绩比较基准收益率为 5.40%。年化跟踪误差 2.56%，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，我国宏观经济形势复杂，国内面临价格收缩、房地产下行等问题，国外地缘政治动荡、出口链存在冲击风险，人口结构也出现转折。中央经济工作会议部署 2025 年要实施更积极有为的宏观政策。随着积极因素累积、新动能壮大及政策效果显现，预计 2025 年宏观经济有望走出价格收缩区间，迎来名义经济增速拐点，新质生产力也将加快发展。

短期可关注高股息及主题成长相关的行业与板块。年初市场将进入政策及经济数据真空期，投资者对经济现实关注度降低。在市场情绪波动下，风格或将在高股息与主题成长间摆动。中长期可以关注两条主线：确定性较高的盈利修复主线，关注内需偏消费方向、政策指向的传媒等行业，以及 CPI 回暖受益的食品饮料等行业，优先选择低出口占比行业；高风险偏好主线可关注高盈利预期叠加高贝塔的主题投资（政策支持类如并购重组，科技类如 AI 产业链）方向。

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，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情况如下：

(1) 持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上，持续贯彻落实廉洁从业、执业操守和道德规范等规定。通过开展员工职业道德教育、合规谈话、合规培训和考试等多种形式引导员工珍惜职业声誉、依法履职、恪守职业道德，努力营造风清气正的公司及行业生态。

(2) 通过实现风控系统全面升级，进一步提升投资合规的控制效能。合规及投研交等业务部门协同完善内部制度和流程，贯彻理性投资、价值投资、长期投资的理念，提升公司投资、研究、交易制度建设和内部管理规范。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，

巩固控制基础，保护投资者利益。

(3)持续督促优化各类法律文件审核流程，提升基金产品材料质效；坚持以实质风险可测可控、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，保障公司各项业务稳妥有序开展，切实保护投资者合法权益。

(4)贯彻落实基金销售相关法规政策要求，提升对基金宣传推介材料的合规审核质效，强化对社交平台、自媒体账号、社群运营、公开言论等重点领域的管理，避免误导。坚持以投资者利益为核心，持续强化投资者适当性管理，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的合理性和科学性。持续结合业务实践，完善客户投诉处理制度及多元纠纷化解机制，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、基金合同中信息披露相关规定，优化完善相关制度流程，明晰各部门和信披岗位的职责分工，强化培训与交流；加强公司级信息披露平台建设，积极探索智能审核系统，不断提高信息披露监测触发、制作、审核、报送的自动化、智能化水平和合规风险控制能力，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6)全面贯彻落实反洗钱“风险为本”的工作方法，持续修订完善反洗钱内控制度，建立健全客户尽职调查工作机制，加强洗钱风险识别管控，深入开展系统建设与数据治理，稳步提升反洗钱履职能力和工作水平。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，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 2024 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

容诚审字[2025]200Z0505 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

我们审计了易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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。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。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达中证 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：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、

故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

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

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

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对易方达中证 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。

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

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

容诚会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

薛竞 周祎

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

2025 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	29,034,507.86	37,324,719.22
结算备付金		2,161,097.77	2,757,219.91

存出保证金		44,958.72	2,096,902.80
交易性金融资产	7.4.7.2	467,919,145.75	397,545,493.90
其中：股票投资		467,912,382.63	397,369,485.80
基金投资		-	-
债券投资		6,763.12	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		132,201.37	934,572.98
应收股利		-	-
应收申购款		1,290,358.19	528,264.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>500,582,269.66</b>	<b>441,187,173.79</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		376,268.05	-
应付赎回款		1,452,262.73	96,855.30
应付管理人报酬		346,634.53	297,289.39
应付托管费		64,994.00	55,741.74
应付销售服务费		41,391.14	29,137.76
应付投资顾问费		-	-

应交税费		1.12	0.23
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	256,979.50	304,221.38
<b>负债合计</b>		<b>2,538,531.07</b>	<b>783,245.80</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	550,921,975.92	535,988,426.12
未分配利润	7.4.7.8	-52,878,237.33	-95,584,498.13
<b>净资产合计</b>		<b>498,043,738.59</b>	<b>440,403,927.99</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>500,582,269.66</b>	<b>441,187,173.79</b>

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 0.9071 元，C 类基金份额净值 0.8975 元；基金份额总额 550,921,975.92 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 374,092,497.04 份，C 类基金份额总额 176,829,478.88 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 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
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>48,982,679.73</b>	<b>-19,007,155.44</b>
1.利息收入		233,240.14	131,722.24
其中：存款利息收入	7.4.7.9	233,240.14	131,722.24
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）		15,790,160.30	-27,186,063.08
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,524,573.48	-34,699,387.76
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.11	85,656.02	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	3,442,282.12	-418.28
股利收益	7.4.7.14	7,737,648.68	7,466,861.78
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	32,725,444.67	7,924,406.67
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	233,834.62	122,778.73
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4,871,632.54</b>	<b>5,447,821.41</b>
1. 管理人报酬		3,612,150.20	4,068,487.65
2. 托管费		677,278.12	762,841.39
3. 销售服务费		404,170.13	432,624.90
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		12,398.47	0.31
8. 其他费用	7.4.7.18	165,635.62	183,867.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>44,111,047.19</b>	<b>-24,454,976.85</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>44,111,047.19</b>	<b>-24,454,976.85</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>44,111,047.19</b>	<b>-24,454,976.85</b>

### 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	535,988,426.12	-95,584,498.13	440,403,927.99
二、本期期初净资产	535,988,426.12	-95,584,498.13	440,403,927.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	14,933,549.80	42,706,260.80	57,639,810.60
（一）、综合收益总额	-	44,111,047.19	44,111,047.19
（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）	14,933,549.80	-1,404,786.39	13,528,763.41
其中：1.基金申购款	241,457,657.14	-33,826,864.62	207,630,792.52
2.基金赎回款	-226,524,107.34	32,422,078.23	-194,102,029.11
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	550,921,975.92	-52,878,237.33	498,043,738.59
项目	上年度可比期间 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	-53,860,677.63	8,995,639.23	-44,865,038.40

资产减少以“-”号填列)			
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

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业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

产列示。

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	29,034,507.86	37,324,719.22
等于：本金	29,031,598.12	37,321,065.10
加：应计利息	2,909.74	3,654.12
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	29,034,507.86	37,324,719.22

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		453,146,079.39	-	467,912,382.63	14,766,303.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,999.98	6.12	6,763.12	1,757.02
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,999.98	6.12	6,763.12	1,757.02
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		453,151,079.37	6.12	467,919,145.75	14,768,060.26
项目		上年度末 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

## 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 2024 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	-	-	-	-
项目	上年度末 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	-	-	-

## 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,330.84	22.84
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	93,648.66	124,198.54
其中：交易所市场	93,648.66	124,198.54
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	162,000.00	180,000.00
合计	256,979.50	304,221.38

#### 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 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	394,221,116.92	394,221,116.92
本期申购	82,489,620.26	82,489,620.26
本期赎回（以“-”号填列）	-102,618,240.14	-102,618,240.14
本期末	374,092,497.04	374,092,497.04

易方达中证 500 量化增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	141,767,309.20	141,767,309.20
本期申购	158,968,036.88	158,968,036.88
本期赎回（以“-”号填列）	-123,905,867.20	-123,905,867.20
本期末	176,829,478.88	176,829,478.88

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	-56,633,365.74	-13,017,679.30	-69,651,045.04
本期期初	-56,633,365.74	-13,017,679.30	-69,651,045.04
本期利润	7,769,329.21	23,203,403.49	30,972,732.70
本期基金份额交易产生的变动数	2,400,876.88	1,521,673.91	3,922,550.79
其中：基金申购款	-14,386,751.83	4,202,463.47	-10,184,288.36
基金赎回款	16,787,628.71	-2,680,789.56	14,106,839.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-46,463,159.65	11,707,398.10	-34,755,761.55

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	-21,270,450.43	-4,663,002.66	-25,933,453.09
本期期初	-21,270,450.43	-4,663,002.66	-25,933,453.09
本期利润	3,616,273.31	9,522,041.18	13,138,314.49
本期基金份额交易产生的变动数	-5,918,208.62	590,871.44	-5,327,337.18
其中：基金申购款	-28,432,160.73	4,789,584.47	-23,642,576.26
基金赎回款	22,513,952.11	-4,198,713.03	18,315,239.08

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,572,385.74	5,449,909.96	-18,122,475.78

## 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	128,062.32	106,699.79
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	102,843.54	23,918.43
其他	2,334.28	1,104.02
合计	233,240.14	131,722.24

## 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,524,573.48	-34,699,387.76
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	4,524,573.48	-34,699,387.76

## 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,373,473,115.44	1,822,147,779.34
减：卖出股票成本总额	1,367,689,795.89	1,854,286,109.35
减：交易费用	1,258,746.07	2,561,057.75
买卖股票差价收入	4,524,573.48	-34,699,387.76

## 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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	151.35	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	85,504.67	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	85,656.02	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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	614,686.62	180,882.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	528,994.24	133,998.41
减：应计利息总额	163.16	98.45
减：交易费用	24.55	7.18
买卖债券差价收入	85,504.67	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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	3,442,282.12	-418.28

## 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
----	----	---------

	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,737,648.68	7,466,861.78
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	7,737,648.68	7,466,861.78

## 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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	32,387,964.67	8,261,886.67
——股票投资	32,386,207.65	8,261,886.67
——债券投资	1,757.02	-
——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	-337,480.00
——权证投资	-	-
——期货投资	337,480.00	-337,480.00
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	32,725,444.67	7,924,406.67

## 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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	233,834.62	122,778.73
合计	233,834.62	122,778.73

## 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	42,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	3,487.13	3,867.16
存托服务费	148.49	-
合计	165,635.62	183,867.16

## 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
易方达私募基金管理有限公司	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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,287,012,756.77	46.37%	3,569,442,147.19	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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	227,444.64	37.00%	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 2024年1月1日至2024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	244,948.40	62.19%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广发证券	713,916.52	100.00%	124,198.54	100.00%

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

2.本报告期内本基金的佣金协议及服务范围发生变更。2024 年 7 月 1 日前，佣金协议的服务范围包括佣金收取方为基金提供的证券交易服务及研究服务。自 2024 年 7 月 1 日起，佣金协议约定的服务仅包括证券交易服务，不包括研究服务。

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,612,150.20	4,068,487.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,309,615.16	1,453,077.56
应支付基金管理人的净管理费	2,302,535.04	2,615,410.09

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
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	677,278.12	762,841.39

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 2024年1月1日至2024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	-	59,471.18	59,471.18
中国工商银行	-	67,212.98	67,212.98
广发证券	-	5,670.52	5,670.52
合计	-	132,354.68	132,354.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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	
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日	2023年1月1日至2023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	29,034,507.86	128,062.32	37,324,719.22	106,699.79

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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

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（2024 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	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

				类型							
301522	上大股份	2024-10-09	6 个月	新股 流通 受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-	
301552	科力装备	2024-07-15	6 个月	新股 流通 受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-	
301571	国科天成	2024-08-14	6 个月	新股 流通 受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-	
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6 个月	新股 流通 受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-	
301586	佳力奇	2024-08-21	6 个月	新股 流通 受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-	
301603	乔锋智能	2024-07-03	6 个月	新股 流通 受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-	
301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	新股 流通 受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-	
301608	博实结	2024-07-25	6 个月	新股 流通 受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-	
301613	新铝时代	2024-10-18	6 个月	新股 流通 受限	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-	
301617	博苑股份	2024-12-03	6 个月	新股 流通 受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-	
301622	英思特	2024-11-26	6 个月	新股 流通 受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-	
301626	苏州天脉	2024-10-17	6 个月	新股 流通 受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-	
301631	壹连科技	2024-11-12	6 个月	新股 流通 受限	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-	
603072	天和磁材	2024-12-24	1 个月以内	新股 流通 受限	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-	

603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6 个月	新股流通受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603194	中力股份	2024-12-17	6 个月	新股流通受限	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
603205	健尔康	2024-10-29	6 个月	新股流通受限	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603207	小方制药	2024-08-19	6 个月	新股流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股流通受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股流通受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603395	红四方	2024-11-19	6 个月	新股流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024-11-20	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024-12-04	6 个月	新股流通受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688710	益诺思	2024-08-27	6 个月	新股流通受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688750	金天钛业	2024-11-12	6 个月	新股流通	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

				受限					
--	--	--	--	----	--	--	--	--	--

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 2024 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 2024 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 2024 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 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.04%)。

##### 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 2024年12月31日	上年度末 2023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企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023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 2024年12月31日	上年度末 2023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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	6,763.12	176,008.10
未评级	0.00	0.00
合计	6,763.12	176,008.10

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023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	上年度末

	2024年12月31日	2023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 2024 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 2024 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	29,034,507.86	-	-	-	29,034,507.86
结算备付金	2,161,097.77	-	-	-	2,161,097.77
存出保证金	44,958.72	-	-	-	44,958.72
交易性金融资产	-	-	6,763.12	467,912,382.63	467,919,145.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	132,201.37	132,201.37
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,290,358.19	1,290,358.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	31,240,564.35	-	6,763.12	469,334,942.19	500,582,269.66
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	-	-	-	376,268.05	376,268.05

应付赎回款	-	-	-	1,452,262.73	1,452,262.73
应付管理人报酬	-	-	-	346,634.53	346,634.53
应付托管费	-	-	-	64,994.00	64,994.00
应付销售服务费	-	-	-	41,391.14	41,391.14
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.12	1.12
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	256,979.50	256,979.50
负债总计	-	-	-	2,538,531.07	2,538,531.07
利率敏感度缺口	31,240,564.35	-	6,763.12	466,796,411.12	498,043,738.59
<b>上年度末</b>					
<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
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

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	467,912,382.63	93.95	397,369,485.80	90.23
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	467,912,382.63	93.95	397,369,485.80	90.23

#### 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	24,088,999.05	20,336,306.74
	2.业绩比较基准下降 5%	-24,088,999.05	-20,336,306.74

#### 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	467,469,460.19	396,451,253.80
第二层次	27,736.50	176,008.10
第三层次	421,949.06	918,232.00
合计	467,919,145.75	397,545,493.90

###### 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 2024年1月1日至2024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	-	918,232.00	918,232.00
当期购买	-	413,021.12	413,021.12
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,200,529.77	1,200,529.77
当期利得或损失总额	-	291,225.71	291,225.71
其中:计入损益的利得或损失	-	291,225.71	291,225.71
计入其他综合收益的利得或损失(若有)	-	-	-
期末余额	-	421,949.06	421,949.06
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	-	231,759.11	231,759.11
项目	上年度可比期间 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

#### 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	421,949.06	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3423—4.9648	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	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

#### 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	467,912,382.63	93.47
	其中：股票	467,912,382.63	93.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,763.12	0.00
	其中：债券	6,763.12	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	31,195,605.63	6.23
8	其他各项资产	1,467,518.28	0.29
9	合计	500,582,269.66	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	647,347.00	0.13
B	采矿业	25,265,930.58	5.07
C	制造业	258,450,465.68	51.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,442,466.00	3.10
E	建筑业	2,504,033.00	0.50
F	批发和零售业	6,903,767.23	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	7,958,010.00	1.60
H	住宿和餐饮业	2,650,869.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,434,414.90	6.11
J	金融业	37,184,186.57	7.47

K	房地产业	3,957,018.00	0.79
L	租赁和商务服务业	530,208.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	3,370,517.95	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	1,707,441.00	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	778,719.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	5,964,338.00	1.20
S	综合	31,612.00	0.01
	合计	403,781,343.91	81.07

## 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	2,616,643.00	0.53
B	采矿业	1,350,107.00	0.27
C	制造业	44,007,484.57	8.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	326,144.00	0.07
E	建筑业	80,019.00	0.02
F	批发和零售业	506,426.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	567,340.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,245,466.31	1.66
J	金融业	3,704,866.00	0.74
K	房地产业	229,352.00	0.05
L	租赁和商务服务业	673,427.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	1,753,224.84	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	37,254.00	0.01
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	33,285.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	64,131,038.72	12.88

### 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	002625	光启技术	128,400	6,137,520.00	1.23
2	002273	水晶光电	189,600	4,212,912.00	0.85
3	600096	云天化	185,400	4,134,420.00	0.83
4	300207	欣旺达	183,800	4,100,578.00	0.82
5	601555	东吴证券	514,540	4,013,412.00	0.81
6	002202	金风科技	378,400	3,908,872.00	0.78
7	601168	西部矿业	237,500	3,816,625.00	0.77
8	300866	安克创新	38,990	3,806,983.60	0.76
9	601108	财通证券	454,300	3,711,631.00	0.75
10	002128	电投能源	182,300	3,569,434.00	0.72
11	002532	天山铝业	448,900	3,532,843.00	0.71
12	000728	国元证券	409,300	3,421,748.00	0.69
13	000729	燕京啤酒	283,800	3,416,952.00	0.69
14	000423	东阿阿胶	54,200	3,399,424.00	0.68
15	603893	瑞芯微	30,100	3,312,806.00	0.67
16	688120	华海清科	19,773	3,222,801.27	0.65
17	002281	光迅科技	61,700	3,218,889.00	0.65
18	688099	晶晨股份	46,867	3,218,825.56	0.65
19	000738	航发控制	144,300	3,209,232.00	0.64
20	300054	鼎龙股份	121,800	3,169,236.00	0.64
21	000783	长江证券	462,600	3,154,932.00	0.63
22	002797	第一创业	374,100	3,123,735.00	0.63
23	002558	巨人网络	245,600	3,116,664.00	0.63
24	600521	华海药业	172,800	3,087,936.00	0.62
25	002444	巨星科技	94,300	3,050,605.00	0.61
26	600141	兴发集团	140,100	3,040,170.00	0.61
27	600563	法拉电子	25,400	3,020,568.00	0.61
28	300001	特锐德	137,300	3,013,735.00	0.61

29	601717	郑煤机	231,900	3,010,062.00	0.60
30	603606	东方电缆	55,800	2,932,290.00	0.59
31	600583	海油工程	534,100	2,921,527.00	0.59
32	002385	大北农	673,700	2,917,121.00	0.59
33	002294	信立泰	92,900	2,873,397.00	0.58
34	600487	亨通光电	164,200	2,827,524.00	0.57
35	688122	西部超导	65,247	2,793,876.54	0.56
36	000050	深天马 A	304,700	2,751,441.00	0.55
37	600988	赤峰黄金	173,400	2,706,774.00	0.54
38	002507	涪陵榨菜	188,700	2,666,331.00	0.54
39	600258	首旅酒店	180,700	2,650,869.00	0.53
40	300699	光威复材	76,400	2,647,260.00	0.53
41	600008	首创环保	803,500	2,635,480.00	0.53
42	300604	长川科技	59,300	2,616,909.00	0.53
43	002850	科达利	26,500	2,588,520.00	0.52
44	002373	千方科技	253,300	2,568,462.00	0.52
45	688188	柏楚电子	12,994	2,524,084.50	0.51
46	603087	甘李药业	57,100	2,518,110.00	0.51
47	000683	远兴能源	450,200	2,516,618.00	0.51
48	601456	国联证券	185,700	2,510,664.00	0.50
49	300724	捷佳伟创	39,600	2,503,116.00	0.50
50	603129	春风动力	15,900	2,497,413.00	0.50
51	603338	浙江鼎力	38,700	2,496,924.00	0.50
52	301236	软通动力	41,400	2,430,594.00	0.49
53	601128	常熟银行	320,801	2,428,463.57	0.49
54	603596	伯特利	54,000	2,407,860.00	0.48
55	300888	稳健医疗	57,200	2,406,976.00	0.48
56	688772	珠海冠宇	146,994	2,363,663.52	0.47
57	000401	冀东水泥	450,100	2,354,023.00	0.47
58	600021	上海电力	256,300	2,350,271.00	0.47
59	601098	中南传媒	156,500	2,349,065.00	0.47
60	300677	英科医疗	92,600	2,340,928.00	0.47
61	300558	贝达药业	43,200	2,329,776.00	0.47
62	002019	亿帆医药	216,700	2,323,024.00	0.47
63	002831	裕同科技	85,200	2,308,920.00	0.46
64	002683	广东宏大	85,900	2,274,632.00	0.46
65	300529	健帆生物	77,500	2,273,850.00	0.46
66	603979	金诚信	61,900	2,246,970.00	0.45
67	002153	石基信息	312,900	2,234,106.00	0.45
68	002120	韵达股份	297,000	2,233,440.00	0.45
69	600295	鄂尔多斯	228,200	2,227,232.00	0.45
70	600546	山煤国际	186,026	2,200,687.58	0.44
71	002557	洽洽食品	75,400	2,190,370.00	0.44
72	300002	神州泰岳	184,000	2,132,560.00	0.43

73	000887	中鼎股份	162,200	2,128,064.00	0.43
74	300144	宋城演艺	222,900	2,070,741.00	0.42
75	600968	海油发展	484,000	2,066,680.00	0.41
76	600764	中国海防	72,900	2,064,528.00	0.41
77	000537	中绿电	223,800	2,041,056.00	0.41
78	300285	国瓷材料	117,400	2,000,496.00	0.40
79	600143	金发科技	228,000	1,969,920.00	0.40
80	600378	昊华科技	68,100	1,968,771.00	0.40
81	002410	广联达	164,900	1,939,224.00	0.39
82	002138	顺络电子	61,600	1,939,168.00	0.39
83	600299	安迪苏	153,400	1,925,170.00	0.39
84	600909	华安证券	316,300	1,916,778.00	0.38
85	600352	浙江龙盛	184,300	1,896,447.00	0.38
86	002508	老板电器	88,100	1,887,983.00	0.38
87	601198	东兴证券	171,000	1,882,710.00	0.38
88	601965	中国汽研	106,300	1,873,006.00	0.38
89	601966	玲珑轮胎	101,300	1,827,452.00	0.37
90	600418	江淮汽车	48,300	1,811,250.00	0.36
91	600499	科达制造	232,000	1,809,600.00	0.36
92	603605	珀莱雅	21,000	1,778,700.00	0.36
93	603379	三美股份	45,900	1,761,642.00	0.35
94	600859	王府井	111,700	1,721,297.00	0.35
95	600995	南网储能	169,200	1,712,304.00	0.34
96	603658	安图生物	39,100	1,706,324.00	0.34
97	000883	湖北能源	338,200	1,684,236.00	0.34
98	601156	东航物流	98,100	1,654,947.00	0.33
99	688065	凯赛生物	42,568	1,651,638.40	0.33
100	603939	益丰药房	68,300	1,648,079.00	0.33
101	601567	三星医疗	53,300	1,639,508.00	0.33
102	600208	衢州发展	553,500	1,638,360.00	0.33
103	601866	中远海发	623,700	1,627,857.00	0.33
104	688578	艾力斯	26,963	1,615,083.70	0.32
105	688005	容百科技	50,532	1,594,284.60	0.32
106	600316	洪都航空	49,500	1,589,940.00	0.32
107	601577	长沙银行	178,100	1,583,309.00	0.32
108	300763	锦浪科技	25,400	1,551,178.00	0.31
109	300476	胜宏科技	36,600	1,540,494.00	0.31
110	000039	中集集团	196,900	1,529,913.00	0.31
111	000723	美锦能源	336,500	1,517,615.00	0.30
112	002262	恩华药业	62,300	1,517,005.00	0.30
113	688180	君实生物	54,021	1,476,393.93	0.30
114	600361	创新新材	380,100	1,467,186.00	0.29
115	603568	伟明环保	67,500	1,460,025.00	0.29
116	000988	华工科技	33,400	1,446,220.00	0.29

117	300567	精测电子	22,300	1,433,890.00	0.29
118	603444	吉比特	6,500	1,422,460.00	0.29
119	600038	中直股份	36,700	1,415,152.00	0.28
120	601179	中国西电	183,200	1,390,488.00	0.28
121	600380	健康元	120,400	1,356,908.00	0.27
122	600004	白云机场	141,000	1,353,600.00	0.27
123	601992	金隅集团	755,400	1,344,612.00	0.27
124	600312	平高电气	68,700	1,319,040.00	0.26
125	603737	三棵树	30,700	1,307,820.00	0.26
126	688248	南网科技	39,655	1,272,528.95	0.26
127	603786	科博达	20,500	1,266,900.00	0.25
128	688017	绿的谐波	11,613	1,254,900.78	0.25
129	002926	华西证券	150,400	1,249,824.00	0.25
130	688032	禾迈股份	10,990	1,237,913.60	0.25
131	688516	奥特维	27,887	1,207,785.97	0.24
132	300573	兴齐眼药	17,200	1,200,216.00	0.24
133	600498	烽火通信	61,100	1,189,006.00	0.24
134	603179	新泉股份	27,800	1,187,060.00	0.24
135	300017	网宿科技	111,600	1,179,612.00	0.24
136	600848	上海临港	116,400	1,175,640.00	0.24
137	002185	华天科技	99,700	1,157,517.00	0.23
138	688331	荣昌生物	36,311	1,093,324.21	0.22
139	689009	九号公司	22,955	1,090,362.50	0.22
140	600177	雅戈尔	120,600	1,073,340.00	0.22
141	002984	森麒麟	41,700	1,028,322.00	0.21
142	688002	睿创微纳	21,767	1,023,266.67	0.21
143	688220	翱捷科技	18,336	991,794.24	0.20
144	600282	南钢股份	210,400	986,776.00	0.20
145	000400	许继电气	35,100	966,303.00	0.19
146	600862	中航高科	38,000	959,880.00	0.19
147	002432	九安医疗	22,300	909,394.00	0.18
148	601997	贵阳银行	150,500	903,000.00	0.18
149	600109	国金证券	103,400	902,682.00	0.18
150	600079	人福医药	38,300	895,454.00	0.18
151	600885	宏发股份	28,100	894,142.00	0.18
152	002409	雅克科技	15,300	886,635.00	0.18
153	002340	格林美	135,400	884,162.00	0.18
154	600820	隧道股份	120,100	863,519.00	0.17
155	600298	安琪酵母	23,800	857,990.00	0.17
156	688052	纳芯微	6,554	853,986.20	0.17
157	002078	太阳纸业	57,400	853,538.00	0.17
158	600959	江苏有线	254,600	852,910.00	0.17
159	300136	信维通信	33,200	844,608.00	0.17
160	000830	鲁西化工	71,800	839,342.00	0.17

161	301165	锐捷网络	11,600	837,520.00	0.17
162	600578	京能电力	236,400	832,128.00	0.17
163	002595	豪迈科技	16,500	828,135.00	0.17
164	600879	航天电子	92,300	827,008.00	0.17
165	600170	上海建工	311,400	825,210.00	0.17
166	600765	中航重机	39,900	816,753.00	0.16
167	688469	芯联集成	155,898	799,756.74	0.16
168	002465	海格通信	72,700	798,246.00	0.16
169	688536	思瑞浦	8,558	791,615.00	0.16
170	002608	江苏国信	100,600	771,602.00	0.15
171	000878	云南铜业	61,600	750,904.00	0.15
172	000997	新大陆	37,400	746,130.00	0.15
173	601918	新集能源	103,300	741,694.00	0.15
174	600060	海信视像	36,800	733,792.00	0.15
175	000598	兴蓉环境	96,400	731,676.00	0.15
176	000932	华菱钢铁	174,200	728,156.00	0.15
177	600901	江苏金租	139,000	725,580.00	0.15
178	601231	环旭电子	43,900	724,350.00	0.15
179	600642	申能股份	76,200	723,138.00	0.15
180	600637	东方明珠	93,100	722,456.00	0.15
181	600707	彩虹股份	87,300	717,606.00	0.14
182	601615	明阳智能	56,800	716,248.00	0.14
183	600517	国网英大	128,100	705,831.00	0.14
184	002739	万达电影	57,900	702,906.00	0.14
185	001203	大中矿业	81,100	702,326.00	0.14
186	603858	步长制药	44,400	701,520.00	0.14
187	002841	视源股份	18,700	690,217.00	0.14
188	002414	高德红外	92,700	688,761.00	0.14
189	600998	九州通	134,300	687,616.00	0.14
190	600873	梅花生物	67,300	675,019.00	0.14
191	002064	华峰化学	81,900	669,942.00	0.13
192	600497	驰宏锌锗	120,000	668,400.00	0.13
193	600737	中粮糖业	65,200	665,692.00	0.13
194	000921	海信家电	22,800	658,920.00	0.13
195	600535	天士力	45,500	657,930.00	0.13
196	300142	沃森生物	54,100	653,528.00	0.13
197	601399	国机重装	209,200	644,336.00	0.13
198	600271	航天信息	70,200	639,522.00	0.13
199	603927	中科软	29,400	637,980.00	0.13
200	300395	菲利华	16,800	631,848.00	0.13
201	600663	陆家嘴	63,900	628,776.00	0.13
202	688278	特宝生物	8,529	625,772.73	0.13
203	600977	中国电影	53,600	622,296.00	0.12
204	600131	国网信通	32,900	622,139.00	0.12

205	002439	启明星辰	39,200	620,144.00	0.12
206	600155	华创云信	82,900	613,460.00	0.12
207	600528	中铁工业	75,900	611,754.00	0.12
208	002368	太极股份	25,600	606,208.00	0.12
209	600655	豫园股份	94,200	605,706.00	0.12
210	601001	晋控煤业	43,800	598,746.00	0.12
211	600704	物产中大	116,200	587,972.00	0.12
212	603707	健友股份	44,200	586,534.00	0.12
213	002203	海亮股份	53,700	577,275.00	0.12
214	002500	山西证券	90,500	568,340.00	0.11
215	002867	周大生	38,400	557,952.00	0.11
216	601696	中银证券	49,500	552,420.00	0.11
217	002653	海思科	16,300	541,975.00	0.11
218	001286	陕西能源	57,900	537,312.00	0.11
219	600153	建发股份	50,400	530,208.00	0.11
220	600435	北方导航	54,300	529,968.00	0.11
221	003022	联泓新科	38,300	527,391.00	0.11
222	002945	华林证券	34,400	527,352.00	0.11
223	600098	广州发展	80,900	519,378.00	0.10
224	300919	中伟股份	14,200	512,904.00	0.10
225	301267	华夏眼科	26,700	508,368.00	0.10
226	601061	中信金属	68,900	500,214.00	0.10
227	601608	中信重工	116,000	487,200.00	0.10
228	002384	东山精密	16,600	484,720.00	0.10
229	601568	北元集团	110,500	464,100.00	0.09
230	002966	苏州银行	57,200	463,892.00	0.09
231	601958	金钼股份	45,300	455,718.00	0.09
232	300140	节能环境	76,000	455,240.00	0.09
233	002299	圣农发展	30,500	441,640.00	0.09
234	301301	川宁生物	35,400	419,844.00	0.08
235	002223	鱼跃医疗	11,400	415,986.00	0.08
236	600339	中油工程	115,900	414,922.00	0.08
237	601666	平煤股份	40,800	408,816.00	0.08
238	603885	吉祥航空	29,600	405,520.00	0.08
239	000034	神州数码	11,400	399,570.00	0.08
240	600062	华润双鹤	20,000	396,000.00	0.08
241	600350	山东高速	38,400	394,752.00	0.08
242	301358	湖南裕能	8,600	389,752.00	0.08
243	600927	永安期货	29,500	389,105.00	0.08
244	600867	通化东宝	47,400	382,044.00	0.08
245	603529	爱玛科技	9,300	381,486.00	0.08
246	688387	信科移动	62,708	373,739.68	0.08
247	000733	振华科技	8,700	366,879.00	0.07
248	300601	康泰生物	20,300	348,145.00	0.07

249	600720	中交设计	38,700	342,882.00	0.07
250	600839	四川长虹	35,500	342,575.00	0.07
251	000960	锡业股份	24,000	336,720.00	0.07
252	002155	湖南黄金	21,300	335,049.00	0.07
253	600699	均胜电子	21,300	333,771.00	0.07
254	300037	新宙邦	8,600	321,984.00	0.06
255	688475	萤石网络	10,322	311,621.18	0.06
256	600582	天地科技	44,700	276,246.00	0.06
257	002044	美年健康	58,900	270,351.00	0.05
258	000513	丽珠集团	7,100	269,800.00	0.05
259	002372	伟星新材	21,100	266,493.00	0.05
260	601665	齐鲁银行	46,700	261,053.00	0.05
261	600369	西南证券	54,400	254,048.00	0.05
262	000709	河钢股份	113,000	249,730.00	0.05
263	002266	浙富控股	79,300	247,416.00	0.05
264	600032	浙江新能	32,800	242,720.00	0.05
265	000987	越秀资本	34,400	241,488.00	0.05
266	601991	大唐发电	84,500	240,825.00	0.05
267	000403	派林生物	11,000	232,430.00	0.05
268	603298	杭叉集团	12,700	227,203.00	0.05
269	300012	华测检测	18,100	224,983.00	0.05
270	600392	盛和资源	21,800	224,104.00	0.04
271	688425	铁建重工	49,699	218,675.60	0.04
272	000559	万向钱潮	35,500	218,325.00	0.04
273	002487	大金重工	10,600	217,194.00	0.04
274	600325	华发股份	37,100	213,696.00	0.04
275	601990	南京证券	24,500	212,170.00	0.04
276	603225	新凤鸣	19,000	211,470.00	0.04
277	002939	长城证券	25,700	210,740.00	0.04
278	688249	晶合集成	9,015	210,410.10	0.04
279	688281	华秦科技	2,238	208,357.80	0.04
280	600166	福田汽车	82,800	207,828.00	0.04
281	000778	新兴铸管	51,300	196,992.00	0.04
282	603345	安井食品	2,400	195,552.00	0.04
283	600566	济川药业	6,700	194,836.00	0.04
284	002065	东华软件	26,600	193,116.00	0.04
285	688361	中科飞测	2,138	187,181.90	0.04
286	600871	石化油服	90,300	184,212.00	0.04
287	600007	中国国贸	7,500	183,450.00	0.04
288	300251	光线传媒	19,200	181,248.00	0.04
289	600872	中炬高新	8,100	178,362.00	0.04
290	002429	兆驰股份	30,600	176,868.00	0.04
291	603228	景旺电子	6,300	175,392.00	0.04
292	600500	中化国际	42,100	169,242.00	0.03

293	601228	广州港	49,100	166,449.00	0.03
294	600928	西安银行	44,200	159,562.00	0.03
295	000563	陕国投 A	44,800	159,488.00	0.03
296	002572	索菲亚	8,900	152,902.00	0.03
297	688538	和辉光电	65,237	151,349.84	0.03
298	601118	海南橡胶	27,700	149,857.00	0.03
299	600906	财达证券	20,700	146,970.00	0.03
300	003031	中瓷电子	2,800	146,692.00	0.03
301	600606	绿地控股	69,700	146,370.00	0.03
302	688567	孚能科技	12,615	146,334.00	0.03
303	600056	中国医药	12,800	142,080.00	0.03
304	688778	厦钨新能	3,059	139,612.76	0.03
305	601611	中国核建	15,200	137,408.00	0.03
306	601233	桐昆股份	11,600	136,880.00	0.03
307	002408	齐翔腾达	27,000	135,810.00	0.03
308	603456	九洲药业	9,900	135,432.00	0.03
309	688561	奇安信	5,042	135,276.86	0.03
310	002531	天顺风能	17,100	135,261.00	0.03
311	600863	内蒙华电	29,400	127,302.00	0.03
312	000898	鞍钢股份	52,700	126,480.00	0.03
313	000959	首钢股份	40,800	124,440.00	0.02
314	601598	中国外运	22,700	121,445.00	0.02
315	002244	滨江集团	13,600	117,096.00	0.02
316	600970	中材国际	12,300	116,604.00	0.02
317	000539	粤电力 A	25,700	116,421.00	0.02
318	002318	久立特材	4,800	112,368.00	0.02
319	002690	美亚光电	7,500	111,150.00	0.02
320	601212	白银有色	38,100	105,918.00	0.02
321	000021	深科技	5,300	101,018.00	0.02
322	600483	福能股份	10,100	100,697.00	0.02
323	600529	山东药玻	3,400	87,618.00	0.02
324	688172	燕东微	4,339	86,996.95	0.02
325	000066	中国长城	5,900	85,963.00	0.02
326	600688	上海石化	24,700	74,594.00	0.01
327	688617	惠泰医疗	200	74,466.00	0.01
328	688777	中控技术	1,434	71,226.78	0.01
329	002156	通富微电	2,400	70,920.00	0.01
330	601162	天风证券	15,000	67,200.00	0.01
331	000998	隆平高科	5,000	55,850.00	0.01
332	300383	光环新网	3,800	55,442.00	0.01
333	601099	太平洋	13,000	55,380.00	0.01
334	601933	永辉超市	8,200	51,988.00	0.01
335	603156	养元饮品	2,000	45,680.00	0.01
336	002261	拓维信息	2,400	43,944.00	0.01

337	000739	普洛药业	2,700	43,902.00	0.01
338	300373	扬杰科技	1,000	43,520.00	0.01
339	600516	方大炭素	8,900	42,987.00	0.01
340	600536	中国软件	900	42,021.00	0.01
341	002423	中粮资本	3,100	41,509.00	0.01
342	002430	杭氧股份	1,900	41,420.00	0.01
343	601158	重庆水务	7,800	38,220.00	0.01
344	601928	凤凰传媒	3,300	38,082.00	0.01
345	600612	老凤祥	700	37,989.00	0.01
346	600956	新天绿能	5,000	37,700.00	0.01
347	300474	景嘉微	400	37,396.00	0.01
348	600925	苏能股份	6,800	36,040.00	0.01
349	601106	中国一重	11,000	32,010.00	0.01
350	002738	中矿资源	900	31,950.00	0.01
351	600673	东阳光	2,800	31,612.00	0.01
352	301498	乖宝宠物	400	31,328.00	0.01
353	002085	万丰奥威	1,400	26,530.00	0.01
354	688563	航材股份	456	25,463.04	0.01
355	300223	北京君正	300	20,460.00	0.00
356	300803	指南针	200	19,190.00	0.00
357	300496	中科创达	300	17,868.00	0.00
358	002195	岩山科技	3,400	13,498.00	0.00
359	300024	机器人	600	10,770.00	0.00
360	603160	汇顶科技	100	8,054.00	0.00
361	688276	百克生物	303	7,608.33	0.00
362	300114	中航电测	100	7,178.00	0.00
363	002673	西部证券	800	6,520.00	0.00
364	002353	杰瑞股份	100	3,699.00	0.00
365	002008	大族激光	100	2,500.00	0.00
366	603185	弘元绿能	150	2,437.50	0.00
367	300212	易华录	100	2,340.00	0.00
368	603883	老百姓	79	1,293.23	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	688018	乐鑫科技	12,293	2,679,874.00	0.54
2	601336	新华保险	36,000	1,789,200.00	0.36
3	300502	新易盛	14,900	1,722,142.00	0.35
4	605305	中际联合	58,860	1,667,503.80	0.33
5	301050	雷电微力	30,000	1,547,400.00	0.31
6	688200	华峰测控	14,790	1,545,555.00	0.31

7	688019	安集科技	11,038	1,538,255.68	0.31
8	301327	华宝新能	19,900	1,526,529.00	0.31
9	600216	浙江医药	96,200	1,525,732.00	0.31
10	603986	兆易创新	13,300	1,420,440.00	0.29
11	000977	浪潮信息	26,800	1,390,384.00	0.28
12	688195	腾景科技	32,693	1,313,604.74	0.26
13	300777	中简科技	44,900	1,270,221.00	0.26
14	688533	上声电子	35,261	1,227,788.02	0.25
15	301031	中熔电气	11,200	1,165,024.00	0.23
16	002906	华阳集团	37,500	1,153,125.00	0.23
17	000975	山金国际	73,800	1,134,306.00	0.23
18	601137	博威合金	54,600	1,108,380.00	0.22
19	603799	华友钴业	37,800	1,106,028.00	0.22
20	605296	神农集团	39,000	1,080,300.00	0.22
21	688596	正帆科技	30,217	1,074,214.35	0.22
22	688185	康希诺	17,579	1,073,197.95	0.22
23	002920	德赛西威	9,700	1,068,067.00	0.21
24	603477	巨星农牧	59,400	1,054,350.00	0.21
25	688095	福昕软件	15,600	1,047,696.00	0.21
26	688348	昱能科技	20,886	1,019,236.80	0.20
27	688076	诺泰生物	17,908	929,783.36	0.19
28	688023	安恒信息	22,113	902,210.40	0.18
29	688131	皓元医药	24,780	884,646.00	0.18
30	000807	云铝股份	64,400	871,332.00	0.17
31	688515	裕太微	8,172	809,028.00	0.16
32	688208	道通科技	20,480	801,996.80	0.16
33	688372	伟测科技	11,789	689,892.28	0.14
34	605499	东鹏饮料	2,690	668,518.80	0.13
35	601628	中国人寿	14,800	620,416.00	0.12
36	002970	锐明技术	13,000	619,190.00	0.12
37	688063	派能科技	14,746	590,577.30	0.12
38	688668	鼎通科技	12,346	578,533.56	0.12
39	002881	美格智能	18,900	566,244.00	0.11
40	002461	珠江啤酒	50,600	500,434.00	0.10
41	601601	中国太保	14,600	497,568.00	0.10
42	688550	瑞联新材	14,102	441,251.58	0.09
43	688307	中润光学	18,040	432,960.00	0.09
44	688326	经纬恒润	5,143	432,526.30	0.09
45	002714	牧原股份	11,200	430,528.00	0.09
46	688030	山石网科	27,589	427,629.50	0.09
47	688685	迈信林	12,831	425,860.89	0.09
48	688523	航天环宇	21,240	424,800.00	0.09
49	688392	骄成超声	10,282	419,505.60	0.08
50	300781	因赛集团	7,100	419,113.00	0.08

51	605376	博迁新材	13,800	399,510.00	0.08
52	001389	广合科技	6,500	326,950.00	0.07
53	301004	嘉益股份	2,700	312,255.00	0.06
54	002139	拓邦股份	21,700	295,337.00	0.06
55	688279	峰昭科技	1,813	285,910.10	0.06
56	605319	无锡振华	12,400	261,020.00	0.05
57	603699	纽威股份	11,500	254,955.00	0.05
58	300181	佐力药业	15,700	241,152.00	0.05
59	601319	中国人保	28,700	218,694.00	0.04
60	688041	海光信息	1,245	186,488.55	0.04
61	688336	三生国健	8,461	181,234.62	0.04
62	688088	虹软科技	4,331	167,003.36	0.03
63	600219	南山铝业	41,700	163,047.00	0.03
64	688232	新点软件	5,391	156,285.09	0.03
65	300657	弘信电子	6,400	145,024.00	0.03
66	688591	泰凌微	4,378	137,469.20	0.03
67	688692	达梦数据	371	135,207.24	0.03
68	600066	宇通客车	4,900	129,262.00	0.03
69	600383	金地集团	29,500	129,210.00	0.03
70	301015	百洋医药	5,300	128,313.00	0.03
71	300790	宇瞳光学	6,700	127,903.00	0.03
72	600236	桂冠电力	18,700	127,160.00	0.03
73	605128	上海沿浦	3,400	125,630.00	0.03
74	600967	内蒙一机	14,100	119,850.00	0.02
75	002479	富春环保	25,000	118,500.00	0.02
76	601318	中国平安	2,200	115,830.00	0.02
77	002550	千红制药	18,400	114,080.00	0.02
78	002971	和远气体	6,000	112,500.00	0.02
79	605507	国邦医药	5,400	112,482.00	0.02
80	002093	国脉科技	14,400	112,320.00	0.02
81	601211	国泰君安	5,900	110,035.00	0.02
82	603209	兴通股份	6,800	108,664.00	0.02
83	300881	盛德鑫泰	3,400	104,516.00	0.02
84	300783	三只松鼠	2,800	103,236.00	0.02
85	601877	正泰电器	4,400	103,004.00	0.02
86	688252	天德钰	4,294	102,841.30	0.02
87	603162	海通发展	10,900	100,280.00	0.02
88	688588	凌志软件	7,245	99,981.00	0.02
89	002891	中宠股份	2,700	96,390.00	0.02
90	300684	中石科技	4,100	91,963.00	0.02
91	301252	同星科技	2,700	90,882.00	0.02
92	001206	依依股份	5,400	89,262.00	0.02
93	603317	天味食品	6,600	88,044.00	0.02
94	300809	华辰装备	2,700	85,536.00	0.02

95	300184	力源信息	9,100	84,903.00	0.02
96	603307	扬州金泉	2,300	82,340.00	0.02
97	300623	捷捷微电	2,400	81,984.00	0.02
98	688698	伟创电气	1,806	79,464.00	0.02
99	603166	福达股份	10,900	79,243.00	0.02
100	002526	山东矿机	22,000	77,660.00	0.02
101	605080	浙江自然	3,300	77,550.00	0.02
102	605177	东亚药业	3,900	76,830.00	0.02
103	601728	中国电信	10,600	76,532.00	0.02
104	601288	农业银行	14,300	76,362.00	0.02
105	300232	洲明科技	10,900	74,883.00	0.02
106	002991	甘源食品	800	74,816.00	0.02
107	600985	淮北矿业	5,300	74,571.00	0.01
108	000933	神火股份	4,400	74,360.00	0.01
109	002901	大博医疗	2,400	74,016.00	0.01
110	301230	泓博医药	2,900	74,008.00	0.01
111	688061	灿瑞科技	2,536	73,239.68	0.01
112	301068	大地海洋	2,400	73,176.00	0.01
113	300986	志特新材	6,000	72,840.00	0.01
114	300088	长信科技	11,000	71,940.00	0.01
115	002980	华盛昌	2,800	71,820.00	0.01
116	688371	菲沃泰	4,623	71,748.96	0.01
117	300610	晨化股份	7,100	71,000.00	0.01
118	600827	百联股份	6,400	69,952.00	0.01
119	002027	分众传媒	9,900	69,597.00	0.01
120	300825	阿尔特	6,100	68,930.00	0.01
121	300806	斯迪克	5,300	68,635.00	0.01
122	603192	汇得科技	4,600	68,264.00	0.01
123	300618	寒锐钴业	2,000	67,540.00	0.01
124	300101	振芯科技	3,100	67,146.00	0.01
125	301429	森泰股份	4,300	66,822.00	0.01
126	603628	清源股份	5,300	66,144.00	0.01
127	001872	招商港口	3,200	65,504.00	0.01
128	603887	城地香江	4,100	65,272.00	0.01
129	002249	大洋电机	11,100	65,157.00	0.01
130	688022	瀚川智能	5,917	64,850.32	0.01
131	002953	日丰股份	6,300	63,378.00	0.01
132	002154	报喜鸟	14,300	63,063.00	0.01
133	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
134	300973	立高食品	1,600	62,448.00	0.01
135	603609	禾丰股份	7,000	60,340.00	0.01
136	603173	福斯达	2,600	59,930.00	0.01
137	603518	锦泓集团	6,100	59,780.00	0.01
138	600419	天润乳业	6,400	59,584.00	0.01

139	002630	华西能源	17,100	59,508.00	0.01
140	603682	锦和商管	7,900	59,092.00	0.01
141	605333	沪光股份	1,800	58,734.00	0.01
142	600935	华塑股份	23,300	58,716.00	0.01
143	601881	中国银河	3,800	57,874.00	0.01
144	002001	新和成	2,600	57,122.00	0.01
145	603012	创力集团	10,700	56,817.00	0.01
146	601619	嘉泽新能	17,100	56,772.00	0.01
147	002352	顺丰控股	1,400	56,420.00	0.01
148	601107	四川成渝	10,700	55,961.00	0.01
149	601899	紫金矿业	3,700	55,944.00	0.01
150	300522	世名科技	4,500	55,755.00	0.01
151	600377	宁沪高速	3,600	55,116.00	0.01
152	001380	华纬科技	2,500	54,750.00	0.01
153	688501	青达环保	3,831	53,748.93	0.01
154	688606	奥泰生物	841	53,235.30	0.01
155	300275	梅安森	3,600	52,920.00	0.01
156	603008	喜临门	3,100	51,956.00	0.01
157	002961	瑞达期货	3,600	51,732.00	0.01
158	300034	钢研高纳	3,300	51,480.00	0.01
159	000713	丰乐种业	7,300	51,465.00	0.01
160	300688	创业黑马	1,600	51,216.00	0.01
161	002476	宝莫股份	12,100	51,062.00	0.01
162	002028	思源电气	700	50,890.00	0.01
163	002459	晶澳科技	3,700	50,875.00	0.01
164	603329	上海雅仕	3,900	50,271.00	0.01
165	300011	鼎汉技术	6,900	50,232.00	0.01
166	600030	中信证券	1,700	49,589.00	0.01
167	300674	宇信科技	2,500	48,800.00	0.01
168	600133	东湖高新	5,100	47,685.00	0.01
169	601857	中国石油	5,300	47,382.00	0.01
170	600941	中国移动	400	47,264.00	0.01
171	688488	艾迪药业	5,848	45,965.28	0.01
172	300682	朗新集团	3,600	43,920.00	0.01
173	002208	合肥城建	6,100	43,371.00	0.01
174	601988	中国银行	7,800	42,978.00	0.01
175	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.01
176	601939	建设银行	4,700	41,313.00	0.01
177	000823	超声电子	4,000	41,280.00	0.01
178	002865	钧达股份	800	40,880.00	0.01
179	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.01
180	000156	华数传媒	5,500	39,600.00	0.01
181	002282	博深股份	5,300	39,273.00	0.01
182	601869	长飞光纤	1,300	38,857.00	0.01

183	301536	星辰科技	481	38,431.90	0.01
184	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.01
185	603165	荣晟环保	3,100	37,944.00	0.01
186	000983	山西焦煤	4,600	37,904.00	0.01
187	000159	国际实业	6,300	37,800.00	0.01
188	600399	抚顺特钢	6,500	37,700.00	0.01
189	002033	丽江股份	4,200	37,254.00	0.01
190	603367	辰欣药业	2,700	37,098.00	0.01
191	002791	坚朗五金	1,600	36,384.00	0.01
192	603886	元祖股份	2,500	36,050.00	0.01
193	600206	有研新材	2,300	36,041.00	0.01
194	605378	野马电池	1,700	35,020.00	0.01
195	002376	新北洋	5,300	34,556.00	0.01
196	603926	铁流股份	3,900	34,515.00	0.01
197	688237	超卓航科	1,501	33,877.57	0.01
198	603109	神驰机电	1,900	33,725.00	0.01
199	001965	招商公路	2,400	33,480.00	0.01
200	600355	精伦电子	9,800	33,418.00	0.01
201	601811	新华文轩	2,100	33,285.00	0.01
202	601077	渝农商行	5,500	33,275.00	0.01
203	300433	蓝思科技	1,500	32,850.00	0.01
204	603038	华立股份	2,000	32,700.00	0.01
205	000002	万科 A	4,500	32,670.00	0.01
206	300121	阳谷华泰	2,700	32,643.00	0.01
207	002835	同为股份	1,700	32,640.00	0.01
208	603380	易德龙	1,300	32,487.00	0.01
209	000429	粤高速 A	2,200	32,340.00	0.01
210	300621	维业股份	3,400	32,334.00	0.01
211	300337	银邦股份	2,900	32,248.00	0.01
212	301040	中环海陆	2,600	32,214.00	0.01
213	688093	世华科技	1,591	32,122.29	0.01
214	600710	苏美达	3,400	31,620.00	0.01
215	300341	麦克奥迪	1,800	31,518.00	0.01
216	300525	博思软件	2,000	31,160.00	0.01
217	000895	双汇发展	1,200	31,152.00	0.01
218	000404	长虹华意	4,200	31,080.00	0.01
219	600648	外高桥	2,600	30,966.00	0.01
220	688553	汇宇制药	2,017	30,658.40	0.01
221	002546	新联电子	7,000	30,310.00	0.01
222	000158	常山北明	1,500	30,210.00	0.01
223	601298	青岛港	3,300	30,063.00	0.01
224	002705	新宝股份	2,000	30,000.00	0.01
225	601083	锦江航运	3,100	29,512.00	0.01
226	600496	精工钢构	9,700	29,294.00	0.01

227	002938	鹏鼎控股	800	29,184.00	0.01
228	002322	理工能科	2,300	28,957.00	0.01
229	300514	友讯达	2,000	28,880.00	0.01
230	603408	建霖家居	2,300	28,819.00	0.01
231	603618	杭电股份	5,300	28,779.00	0.01
232	603301	振德医疗	1,300	28,587.00	0.01
233	300770	新媒股份	700	28,287.00	0.01
234	002837	英维克	700	28,280.00	0.01
235	688582	芯动联科	553	27,821.43	0.01
236	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.01
237	603595	东尼电子	1,600	27,344.00	0.01
238	301413	安培龙	500	26,755.00	0.01
239	300750	宁德时代	100	26,600.00	0.01
240	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.01
241	002912	中新赛克	1,000	25,590.00	0.01
242	002043	兔宝宝	2,100	24,948.00	0.01
243	002967	广电计量	1,500	24,600.00	0.00
244	600415	小商品城	1,800	24,138.00	0.00
245	600665	天地源	7,700	24,101.00	0.00
246	600310	广西能源	5,200	23,712.00	0.00
247	688312	燕麦科技	757	23,315.60	0.00
248	688616	西力科技	2,134	22,172.26	0.00
249	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
250	603612	索通发展	1,300	17,563.00	0.00
251	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
252	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
253	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
254	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
255	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
256	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
257	600865	百大集团	1,000	11,770.00	0.00
258	301580	爱迪特	202	11,736.20	0.00
259	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
260	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
261	688628	优利德	303	11,162.52	0.00
262	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
263	000850	华茂股份	2,500	10,325.00	0.00
264	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
265	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
266	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
267	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
268	000652	泰达股份	1,900	7,866.00	0.00
269	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
270	603193	润本股份	303	7,075.05	0.00

271	688429	时创能源	346	5,899.30	0.00
272	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
273	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
274	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
275	300045	华力创通	200	4,178.00	0.00
276	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
277	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
278	600351	亚宝药业	600	3,654.00	0.00
279	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
280	600261	阳光照明	900	2,943.00	0.00
281	603285	键邦股份	129	2,916.69	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	300502	新易盛	6,651,024.00	1.51
2	600583	海油工程	6,542,703.00	1.49
3	688120	华海清科	6,291,656.90	1.43
4	601108	财通证券	6,255,985.80	1.42
5	002340	格林美	6,231,567.00	1.41
6	002625	光启技术	5,926,997.00	1.35
7	000683	远兴能源	5,829,249.00	1.32
8	601598	中国外运	5,781,322.00	1.31
9	688122	西部超导	5,656,120.61	1.28
10	002294	信立泰	5,537,762.76	1.26
11	600521	华海药业	5,378,991.25	1.22
12	002273	水晶光电	5,378,745.00	1.22
13	600885	宏发股份	5,298,779.46	1.20
14	600909	华安证券	5,172,829.50	1.17
15	300207	欣旺达	5,140,521.00	1.17
16	601666	平煤股份	5,121,222.70	1.16
17	603606	东方电缆	5,092,201.00	1.16
18	000975	山金国际	5,074,109.00	1.15
19	002373	千方科技	5,041,259.00	1.14
20	000400	许继电气	5,032,526.42	1.14

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	002028	思源电气	9,434,537.00	2.14
2	300502	新易盛	7,761,161.00	1.76
3	600066	宇通客车	7,484,394.00	1.70
4	300394	天孚通信	6,865,816.39	1.56
5	601058	赛轮轮胎	6,785,272.00	1.54
6	300682	朗新集团	5,952,993.00	1.35
7	600985	淮北矿业	5,744,379.00	1.30
8	002939	长城证券	5,601,145.00	1.27
9	600970	中材国际	5,591,804.00	1.27
10	002223	鱼跃医疗	5,581,538.80	1.27
11	600642	申能股份	5,576,563.00	1.27
12	600827	百联股份	5,561,975.00	1.26
13	000630	铜陵有色	5,507,597.00	1.25
14	002340	格林美	5,500,403.00	1.25
15	601598	中国外运	5,445,525.00	1.24
16	002463	沪电股份	5,444,305.00	1.24
17	002465	海格通信	5,346,997.25	1.21
18	601108	财通证券	5,197,868.92	1.18
19	688002	睿创微纳	5,111,533.87	1.16
20	000933	神火股份	5,072,755.85	1.15

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	1,405,846,485.07
卖出股票收入（成交）总额	1,373,473,115.44

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）	6,763.12	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,763.12	0.00

#### 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	113683	伟 24 转债	50	6,763.12	0.00

#### 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，财通证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到建德市卫生健康局、玉环市消防救援大队的处罚。东吴证券股份有限公司在本报告期内被中国证监会调查。西部矿业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到海西蒙古族藏族自治州水利局、海西蒙古族藏族自治州应急管理局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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	44,958.72
2	应收清算款	132,201.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,290,358.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,467,518.28

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	113683	伟 24 转债	6,763.12	0.00

### 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	8,954	41,779.37	4,258,213.32	1.14%	369,834,283.72	98.86%
易方达中证 500 量化增强 C	8,454	20,916.66	6,880,018.76	3.89%	169,949,460.12	96.11%
合计	17,408	31,647.63	11,138,232.08	2.02%	539,783,743.84	97.98%

#### 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	1,515,565.07	0.4051%
	易方达中证 500 量化增强 C	7,282.97	0.0041%
	合计	1,522,848.04	0.2764%

#### 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	394,221,116.92	141,767,309.20
本报告期基金总申购份额	82,489,620.26	158,968,036.88
减：本报告期基金总赎回份额	102,618,240.14	123,905,867.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	374,092,497.04	176,829,478.88

### § 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 2024 年 8 月 28 日发布公告，自 2024 年 8 月 26 日起陈丽园女士担任公司副总经理级高级管理人员；本基金管理人于 2024 年 10 月 21 日发布公告，自 2024 年 10 月 20 日起关秀霞女士不再担任公司副总经理级高级管理人员。

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

本报告期内为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。本基金首次聘请容诚会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 42,000.00 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	管理人；高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-07-26
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	责令改正并暂停受理 ETF 公募基金产品注册申请三个月；出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	部分制度机制不完善，规定执行不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成并恢复 ETF 基金产品注册
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	-	-	-	-	-
广发证券	3	1,287,012,756.77	46.37%	244,948.40	62.19%	-
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	251,991,674.90	9.08%	25,200.09	6.40%	-
华安证券	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	-	-	-	-	-
兴业证券	2	365,646,160.41	13.17%	36,578.58	9.29%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	803,913,942.10	28.96%	80,392.01	20.41%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	8,601,173.00	0.31%	860.76	0.22%	-
中信证券	2	58,656,943.20	2.11%	5,868.19	1.49%	-
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方正证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司，无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金交易单元的选择标准有调整，调整后的标准如下：

1) 财务状况良好，经营行为规范，内控制度健全，采取规范化的方式提供专业化的服务，在业内具有良好的声誉；

2) 具有较强的合规风控能力和交易、研究等服务能力；

3) 具有较突出的综合及专项服务能力和服务意愿；

4) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金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。

d) 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，报告的主要内容是报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用境内证券公司交易单元和委托境内证券公司进行证券投资及佣金支付情况，包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
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	-	-	-	-	-	-
广发证券	227,444.64	37.00%	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
兴业证券	387,241.98	63.00%	-	-	-	-

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

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2024-01-13
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-01-19
3	关于易方达中证 500 指数量化增强型证券投资基金 2024 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	2024-02-23
4	关于旗下部分基金 2024 年 3 月 29 日至 2024 年 4 月 1 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	2024-03-26
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证券报	2024-03-29
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-04-20
7	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	2024-04-23
8	关于旗下部分基金 2024 年 5 月 15 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	2024-05-10
9	关于旗下部分基金 2024 年 7 月 1 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	2024-06-26
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-07-18
11	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	2024-08-28
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年中	中国证券报	2024-08-30

	期报告提示性公告		
13	关于旗下部分基金 2024 年 9 月 18 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	2024-09-11
14	关于旗下部分基金 2024 年 10 月 11 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	2024-10-08
15	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	2024-10-21
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2024-10-25
17	易方达基金管理有限公司关于易方达私募基金管理有限公司股东变更的公告	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	2024-11-02
18	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	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	2024-12-04
19	关于旗下部分基金 2024 年 12 月 25 日至 2024 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	2024-12-19

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证 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。

### 12.2 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。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日