

# 易方达中证 1000 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。德勤华永会计师事务所（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	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	16
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	16
§ 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	17
6.2 形成审计意见的基础	17
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.5 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	23
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	57

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	83
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	85
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	85
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	86
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	86
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	86
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	86
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	86
8.12	投资组合报告附注	86
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>87</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	87
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	87
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	88
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>88</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>88</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	88
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	88
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	89
11.4	基金投资策略的改变	89
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	89
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	89
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	89
11.8	其他重大事件	91
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>93</b>
12.1	备查文件目录	93
12.2	存放地点	93
12.3	查阅方式	93

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	易方达中证 1000 量化增强	
基金主代码	017094	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 25 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	278,536,473.68 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 1000 量化增强 A	易方达中证 1000 量化增 强 C
下属分级基金的交易代码	017094	017095
报告期末下属分级基金的份额总额	158,076,069.03 份	120,460,404.65 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。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.5%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。股票投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报，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，本基金主要通过类属配置与券种选择

	两个层次进行债券投资管理。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。</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，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。</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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	任航
	联系电话	020-85102688	010-66060069
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95599
传真		020-38798812	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市东城区建国门内大街69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28号 凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		510620；519031	100031
法定代表人		刘晓艳	谷澍

## 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	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 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；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 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日	
	易方达中证 1000 量化增强 A	易方达中证 1000 量化增强 C	易方达中证 1000 量化增强 A	易方达中证 1000 量化增强 C
本期已实现收益	9,718,041.15	6,019,834.93	-11,613,541.43	-10,411,618.18
本期利润	9,410,351.30	7,917,915.03	-12,410,700.93	-11,388,613.05
加权平均基金份额本期利润	0.0687	0.0627	-0.0651	-0.0651
本期加权平均净值利润率	7.85%	7.25%	-6.74%	-6.73%
本期基金份额净值增长率	9.18%	8.75%	-7.50%	-7.76%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
	易方达中证 1000 量	易方达中证 1000 量	易方达中证 1000 量化	易方达中证 1000 量化

	化增强 A	化增强 C	增强 A	增强 C
期末可供分配利润	-231,696.31	-980,098.44	-11,639,975.48	-10,768,254.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0015	-0.0081	-0.0750	-0.0776
期末基金资产净值	159,639,802.04	120,833,810.20	143,489,415.00	128,040,790.02
期末基金份额净值	1.0099	1.0031	0.9250	0.9224
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
	易方达中证 1000 量化增强 A	易方达中证 1000 量化增强 C	易方达中证 1000 量化增强 A	易方达中证 1000 量化增强 C
基金份额累计净值增长率	0.99%	0.31%	-7.50%	-7.76%

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 2023 年 4 月 25 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 1000 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	7.28%	2.37%	4.23%	2.28%	3.05%	0.09%
过去六个月	26.00%	2.21%	20.68%	2.13%	5.32%	0.08%
过去一年	9.18%	2.10%	1.41%	2.01%	7.77%	0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.99%	1.70%	-10.59%	1.65%	11.58%	0.05%

##### 易方达中证 1000 量化增强 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	7.17%	2.37%	4.23%	2.28%	2.94%	0.09%
过去六个月	25.75%	2.21%	20.68%	2.13%	5.07%	0.08%
过去一年	8.75%	2.10%	1.41%	2.01%	7.34%	0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	0.31%	1.70%	-10.59%	1.65%	10.90%	0.05%

### 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 1000 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

(2023 年 4 月 25 日至 2024 年 12 月 31 日)

#### 易方达中证 1000 量化增强 A



#### 易方达中证 1000 量化增强 C



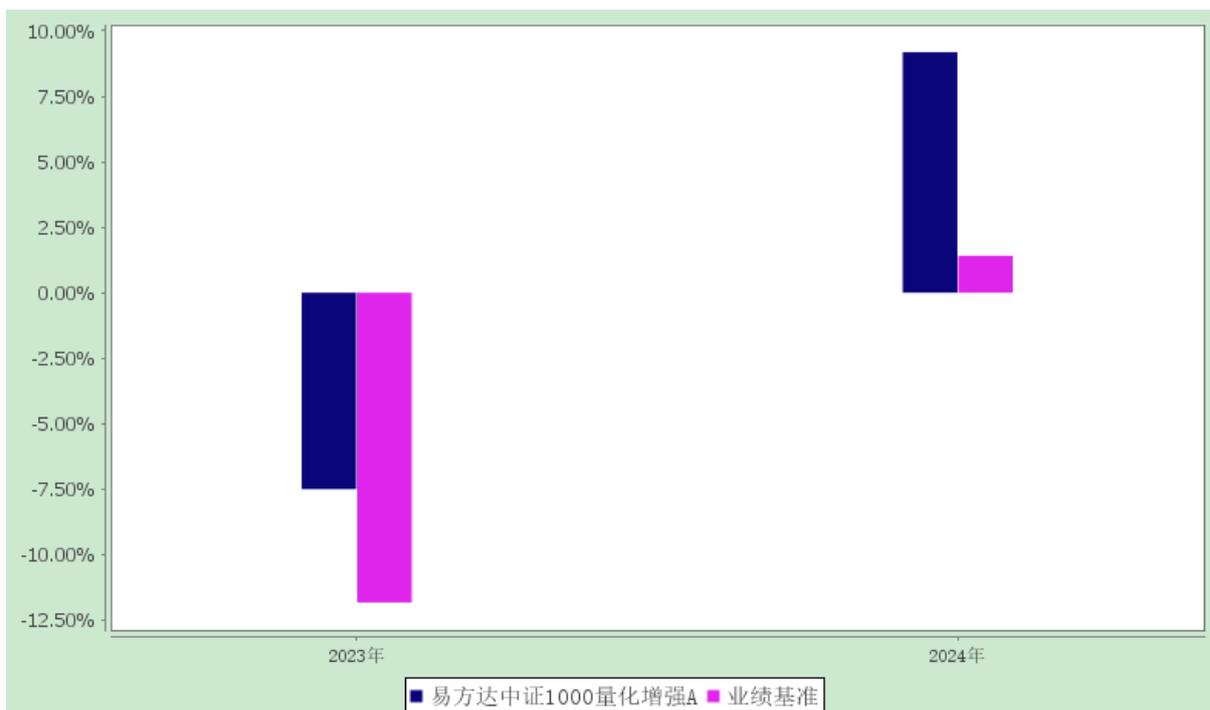
注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 0.99%，同期业绩比较基准收益率为-10.59%；C 类基金份额净值增长率为 0.31%，同期业绩比较基准收益率为-10.59%。

### 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

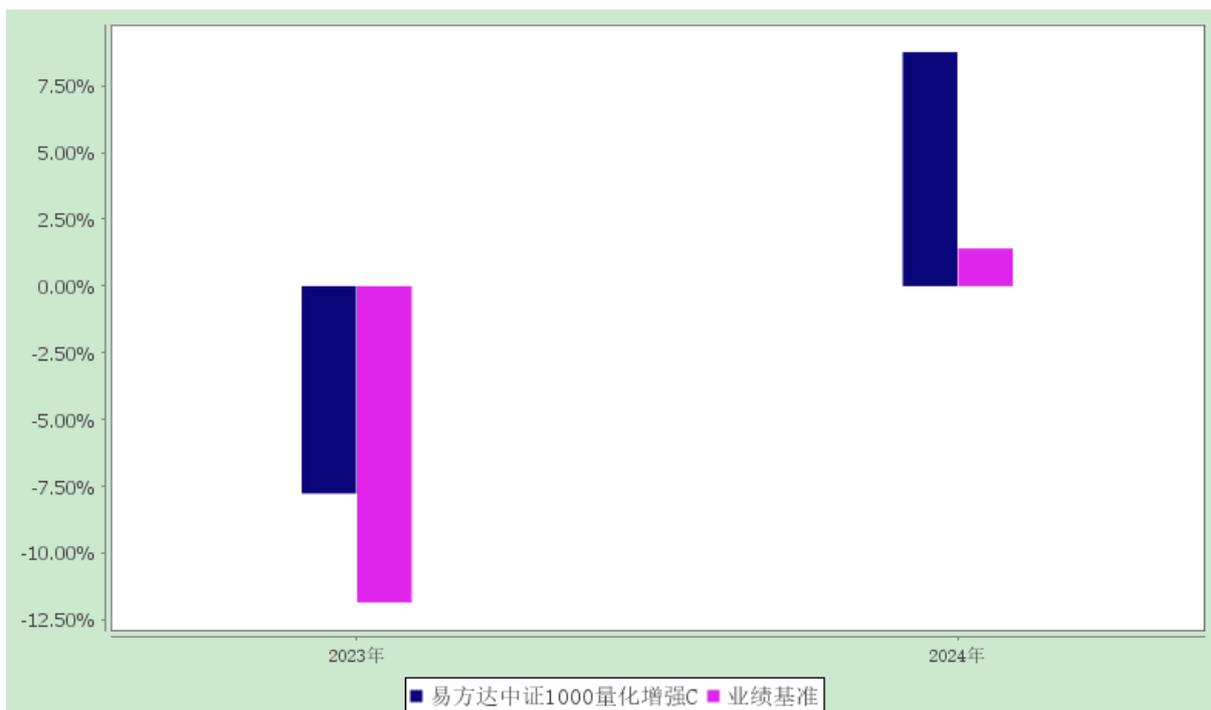
易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金

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 1000 量化增强 A



#### 易方达中证 1000 量化增强 C



注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 25 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（2023 年 4 月 25 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		

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，量化投资决策委员会委员	2023-04-25	-	13 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、易方达中证 500 量化增强的基金经理。
殷 明	本基金的基金经理，易方达易百智能量化策略混合、易方达上证科创板 100 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	2023-04-25	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，国盛证券有限责任公司研究所金融工程分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员。

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。

#### 4.2 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 and 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。

#### 4.3.3 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，经济复苏进程有所减缓，在“需求收缩、供给冲击、预期转弱”三重压力下，市场情绪偏弱。两会后各种稳经济、促创新、惠民生的政策出台及加紧落地，给低迷市场带来曙光，市场情绪得到修复，市场在 2、3 月出现反弹。进入二季度后，PMI 回落至荣枯线下，经济处于磨底过程，就业承压、内需不足、房价下跌，影响了市场信心，市场短期动能不足。同时监管趋严，长期来看有利于 A 股健康发展，短期中小盘股票承压。7 月份以来，经济维持缓慢复苏。9 月 PMI 数据显示企业利润改善较为显著，但需求仍偏软。各地房地产政策落地，提升了地产销售。但是巴以冲突、俄乌冲突持续等带来较大不确定性，地缘政治也给市场带来不小压力，指数震荡下行。中观层面，在半导体、人工智能等领域，我们经历了内外部双重压力。在内部，经济整体虽然企稳，但活力依然不强，企业用于科技研发的资本开支能力受限；在外部，我们依然面临西方国家的技术封锁和制裁，自主可控之路道阻且长。进入四季度，增量政策持续推出，加强超常规逆周期调节，货币政策从“稳健”转为“适度宽松”；人力资源和社会保障部等五部门宣布个人养老金制度推至全国，将国债、指数基金纳入产品范围，给市场带来大规模增量资金。系列政策组合拳有力提升市场情绪，市场活跃度持续保持在高位，市场大幅反弹。全年中证 1000 指数累计收益率为 1.20%。

报告期内，基本面较优的公司具备明显超额收益，而业绩不佳或存在财务问题的公司则表现较差。我们在运作过程中注意对投资组合风险暴露进行管控，规避业绩波动大、基本面弱、公司治理存疑的股票，严格控制组合在行业与风格上的相对偏离，通过对个股的超低配，获取较为稳健的超额收益。

#### 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 1.0099 元，本报告期份额净值增长率为 9.18%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%；C 类基金份额净值为 1.0031 元，本报告期份额净值增长率为 8.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%。年化跟踪误差 3.92%，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

国际方面，巴以冲突和俄乌冲突或接近尾声，特朗普再次当选美国总统，国际贸易摩擦存在升级风险。全球制造业周期出现修复迹象，1 月份美欧英制造业 PMI 均出现回升，美国加征关税可能会拖累美国的 GDP 增速、推高美国通胀、影响全球制造业修复，对我国的出口链存在冲击风险。

国内方面，宏观经济形势复杂，国内面临内需不足、房地产下行、人口老龄化等问题。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。

展望 2025 年，国内整体经济活力有望进一步回暖，从春节各行业中观数据来看，出行、娱乐消

费等领域有所表现，其中电影票房等数据更是创下了历史新高。当然，在部分消费领域也依然存在压力。我们认为，随着后续中央经济政策的进一步出台，市场信心有望逐步回归，2025 年全年应该不乏投资机会。

综上，下阶段本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 1000 量化增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证 1000 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—易方达基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，易方达基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

德师报(审)字(25)第 P00343 号

易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金全体持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金的财务报表，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中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了易方达中证 1000 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 1000 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 其他信息

易方达基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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 1000 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 1000 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 1000 指数量化增强型证券投资基金的财务报告过程。

### 6.5 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，就可能导致对易方达中证 1000 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 1000 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（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。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

汪芳 江丽雅

中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

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 1000 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	15,222,257.58	16,028,890.45
结算备付金		1,001,143.19	-

存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	264,711,959.49	255,369,543.76
其中：股票投资		264,610,513.44	255,205,536.22
基金投资		-	-
债券投资		101,446.05	164,007.54
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		667,238.82	777,694.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>281,602,599.08</b>	<b>272,176,128.65</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		-	-
应付赎回款		705,650.96	322,242.39
应付管理人报酬		188,360.18	185,054.03
应付托管费		35,317.52	34,697.65
应付销售服务费		39,658.18	43,929.33
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	160,000.00	60,000.00
<b>负债合计</b>		<b>1,128,986.84</b>	<b>645,923.63</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	278,536,473.68	293,938,434.57
未分配利润	7.4.7.8	1,937,138.56	-22,408,229.55
<b>净资产合计</b>		<b>280,473,612.24</b>	<b>271,530,205.02</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>281,602,599.08</b>	<b>272,176,128.65</b>

注：1.本基金合同生效日为 2023 年 4 月 25 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 4 月 25 日至 2023 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2024 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0099 元，C 类基金份额净值 1.0031 元；基金份额总额 278,536,473.68 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 158,076,069.03 份，C 类基金份额总额 120,460,404.65 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达中证 1000 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基 金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>20,108,335.62</b>	<b>-20,961,957.10</b>
1.利息收入		52,841.70	1,327,825.55
其中：存款利息收入	7.4.7.9	52,841.70	57,383.95
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		-	1,270,441.60
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		18,254,565.25	-20,542,213.47
其中：股票投资收益	7.4.7.10	15,683,997.57	-22,104,973.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	31,706.73	7.33
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	178,466.93	-
股利收益	7.4.7.14	2,360,394.02	1,562,753.01
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	1,590,390.25	-1,774,154.37
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	210,538.42	26,585.19
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,780,069.29</b>	<b>2,837,356.88</b>
1. 管理人报酬		1,832,209.97	1,942,538.80
2. 托管费		343,539.24	364,226.02
3. 销售服务费		437,785.84	464,883.10
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		643.46	0.02
8. 其他费用	7.4.7.18	165,890.78	65,708.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>17,328,266.33</b>	<b>-23,799,313.98</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>17,328,266.33</b>	<b>-23,799,313.98</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>17,328,266.33</b>	<b>-23,799,313.98</b>

注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 25 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 4 月 25 日至 2023

年 12 月 31 日。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证 1000 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	293,938,434.57	-22,408,229.55	271,530,205.02
二、本期期初净资产	293,938,434.57	-22,408,229.55	271,530,205.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,401,960.89	24,345,368.11	8,943,407.22
（一）、综合收益总额	-	17,328,266.33	17,328,266.33
（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）	-15,401,960.89	7,017,101.78	-8,384,859.11
其中：1.基金申购款	367,376,719.89	-15,960,315.35	351,416,404.54
2.基金赎回款	-382,778,680.78	22,977,417.13	-359,801,263.65
（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	278,536,473.68	1,937,138.56	280,473,612.24
项目	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	514,163,559.42	-	514,163,559.42
三、本期增减变动	-220,225,124.85	-22,408,229.55	-242,633,354.40

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	-23,799,313.98	-23,799,313.98
（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）	-220,225,124.85	1,391,084.43	-218,834,040.42
其中：1.基金申购款	36,608,514.46	-2,128,732.45	34,479,782.01
2.基金赎回款	-256,833,639.31	3,519,816.88	-253,313,822.43
（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	293,938,434.57	-22,408,229.55	271,530,205.02

注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 25 日，2023 年度实际报告期间为 2023 年 4 月 25 日至 2023 年 12 月 31 日。

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 1000 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[2022]2508 号《关于准予易方达中证 1000 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 1000 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 1000 指数量化增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 514,163,559.42 份基金份额，其中认购资金利息折合 127,231.07 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

### 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 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	5,177,107.77	11,355,465.57

等于：本金	5,176,480.21	11,354,682.78
加：应计利息	627.56	782.79
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	10,045,149.81	4,673,424.88
等于：本金	10,044,573.24	4,673,147.16
加：应计利息	576.57	277.72
合计	15,222,257.58	16,028,890.45

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 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		264,794,379.56	-	264,610,513.44	-183,866.12
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	100,748.00	596.05	101,446.05	102.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	100,748.00	596.05	101,446.05	102.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		264,895,127.56	596.05	264,711,959.49	-183,764.12
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		256,979,690.59	-	255,205,536.22	-1,774,154.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	163,996.76	10.78	164,007.54	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	163,996.76	10.78	164,007.54	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		257,143,687.35	10.78	255,369,543.76	-1,774,154.37

#### 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

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-

其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	60,000.00
合计	160,000.00	60,000.00

#### 7.4.7.7 实收基金

易方达中证 1000 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	155,129,390.48	155,129,390.48
本期申购	166,828,868.26	166,828,868.26
本期赎回（以“-”号填列）	-163,882,189.71	-163,882,189.71
本期末	158,076,069.03	158,076,069.03

易方达中证 1000 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	138,809,044.09	138,809,044.09
本期申购	200,547,851.63	200,547,851.63
本期赎回（以“-”号填列）	-218,896,491.07	-218,896,491.07
本期末	120,460,404.65	120,460,404.65

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 1000 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	-10,701,695.57	-938,279.91	-11,639,975.48
本期期初	-10,701,695.57	-938,279.91	-11,639,975.48

本期利润	9,718,041.15	-307,689.85	9,410,351.30
本期基金份额交易产生的变动数	751,958.11	3,041,399.08	3,793,357.19
其中：基金申购款	-18,248,681.18	10,971,495.23	-7,277,185.95
基金赎回款	19,000,639.29	-7,930,096.15	11,070,543.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-231,696.31	1,795,429.32	1,563,733.01

易方达中证 1000 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	-9,927,549.23	-840,704.84	-10,768,254.07
本期期初	-9,927,549.23	-840,704.84	-10,768,254.07
本期利润	6,019,834.93	1,898,080.10	7,917,915.03
本期基金份额交易产生的变动数	2,927,615.86	296,128.73	3,223,744.59
其中：基金申购款	-19,462,114.93	10,778,985.53	-8,683,129.40
基金赎回款	22,389,730.79	-10,482,856.80	11,906,873.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-980,098.44	1,353,503.99	373,405.55

## 7.4.7.9 存款利息收入

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 4 月 25 日（基金合同 生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	24,511.14	34,598.79
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	10,198.54	22,785.16
结算备付金利息收入	17,314.71	-
其他	817.31	-

合计	52,841.70	57,383.95
----	-----------	-----------

## 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 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年4月25日（基金合 同生效日）至2023年12月 31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,683,997.57	-22,104,973.81
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	15,683,997.57	-22,104,973.81

## 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 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年4月25日（基金合 同生效日）至2023年12月31 日
卖出股票成交总额	1,433,653,699.33	1,590,830,539.13
减：卖出股票成本总额	1,415,886,721.13	1,609,356,481.18
减：交易费用	2,082,980.63	3,579,031.76
买卖股票差价收入	15,683,997.57	-22,104,973.81

## 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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年4月25日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	321.47	7.33
债券投资收益——买卖债券（债转股 及债券到期兑付）差价收入	31,385.26	-
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	31,706.73	7.33

## 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4月25日（基金合同生效日）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	220,428.82	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	188,996.75	-
减：应计利息总额	34.78	-
减：交易费用	12.03	-
买卖债券差价收入	31,385.26	-

## 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4月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	178,466.93	-

## 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4月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,360,394.02	1,562,753.01
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	2,360,394.02	1,562,753.01

## 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4月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	1,590,390.25	-1,774,154.37
——股票投资	1,590,288.25	-1,774,154.37
——债券投资	102.00	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,590,390.25	-1,774,154.37

## 7.4.7.16 其他收入

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4月25日（基金合同生效日）至 2023年12月31日
基金赎回费收入	210,538.42	26,576.56
其他	-	8.63
合计	210,538.42	26,585.19

## 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4月25日（基金合同生效日） 至2023年12月31日
----	---------------------------------	--

审计费用	40,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	5,890.78	4,908.94
其他	-	800.00
合计	165,890.78	65,708.94

#### 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
中国农业银行股份有限公司	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
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

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股票交易。

**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**

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交易。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**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 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年4月25日（基金合同 生效日）至2023年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,832,209.97	1,942,538.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	676,384.74	774,159.34
应支付基金管理人的净管理费	1,155,825.23	1,168,379.46

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，在月初 3 个工作日内按照与基金管理人协商一致的方式进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

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4月25日（基金合同 生效日）至2023年12月31
----	---------------------------------	---

		日
当期发生的基金应支付的托管费	343,539.24	364,226.02

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，在月初 3 个工作日内按照与基金管理人协商一致的方式进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

#### 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 1000 量化增强 A	易方达中证 1000 量化增强 C	合计
易方达基金管理有限 公司	-	15,799.91	15,799.91
中国农业银行	-	11,511.19	11,511.19
合计	-	27,311.10	27,311.10
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2023年4月25日（基金合同生效日）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1000量化增强 A	易方达中证1000量化增强 C	合计
易方达基金管理有限 公司	-	1,138.43	1,138.43
中国农业银行	-	16,560.79	16,560.79
合计	-	17,699.22	17,699.22

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 0.40%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金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，在月初 3 个工作日内按照与基金管理人协商一致的方式进行资金支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

#### 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自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自有资金投资本基金。

##### 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 1000 量化增强 A

无。

易方达中证 1000 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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年4月25日（基金合同生效日） 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
中国农业银行-活期存款	5,177,107.77	24,511.14	11,355,465.57	34,598.79

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国农业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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 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 1000 量化增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证 1000 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
301522	上大股份	2024-10-09	6 个月	新股流通受限	6.88	24.84	765	5,263.20	19,002.60	-
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	-
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	208	5,512.00	8,731.84	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6 个月	新股流通受限	21.21	36.49	259	5,493.39	9,450.91	-
301608	博实结	2024-07-25	6 个月	新股流通受限	44.50	65.38	126	5,607.00	8,237.88	-

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	102	7,444.98	10,399.92	-
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	223	4,531.36	6,272.99	-
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	116	2,163.40	2,622.76	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	120	2,086.80	2,154.00	-
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	1,110	12,487.50	32,678.40	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	489	13,242.12	23,936.55	-
688710	益诺思	2024-08-27	6 个月	新股流通	19.06	33.58	326	6,213.56	10,947.08	-

				受限						
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 受限	7.16	15.44	1,639	11,735.24	25,306.16	-

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

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备 注
002494	华斯股份	2024-12-30	重大事项 停牌	3.99	2025-01-14	3.60	15,600	61,010.86	62,244.00	-
688139	海尔生物	2024-12-23	重大事项 停牌	35.20	2025-01-07	30.60	2,157	75,386.40	75,926.40	-

#### 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。

本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。日常经营活动中本基金面临的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：0.06%)。

##### 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	101,446.05	0.00
合计	101,446.05	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	0.00	164,007.54
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	164,007.54

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 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

## 7.4.13.3 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	15,222,257.58	-	-	-	15,222,257.58
结算备付金	1,001,143.19	-	-	-	1,001,143.19
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	101,446.05	-	-	264,610,513.44	264,711,959.49
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	-	-	-	667,238.82	667,238.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,324,846.82	-	-	265,277,752.26	281,602,599.08
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	-	-	-	705,650.96	705,650.96
应付管理人报酬	-	-	-	188,360.18	188,360.18
应付托管费	-	-	-	35,317.52	35,317.52
应付销售服务费	-	-	-	39,658.18	39,658.18
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	-	-	-	160,000.00	160,000.00
负债总计	-	-	-	1,128,986.84	1,128,986.84
利率敏感度缺口	16,324,846.82	-	-	264,148,765.42	280,473,612.24
<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	16,028,890.45	-	-	-	16,028,890.45
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	164,007.54	-	255,205,536.22	255,369,543.76
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	-	-	777,694.44	777,694.44
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	16,028,890.45	164,007.54	255,983,230.66	272,176,128.65
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	-	-	322,242.39	322,242.39
应付管理人报酬	-	-	185,054.03	185,054.03
应付托管费	-	-	34,697.65	34,697.65
应付销售服务费	-	-	43,929.33	43,929.33
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	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	645,923.63	645,923.63
利率敏感度缺口	16,028,890.45	164,007.54	255,337,307.03	271,530,205.02

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

假设	除市场利率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.市场利率下降 25 个基点	183.42	-
2.市场利率上升 25 个基点	-183.02	-	

#### 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	264,610,513.44	94.34	255,205,536.22	93.99
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	264,610,513.44	94.34	255,205,536.22	93.99

#### 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%	14,608,526.50	13,524,853.13
2.业绩比较基准下降 5%	-14,608,526.50	-13,524,853.13	

#### 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	264,150,254.76	253,344,604.91
第二层次	267,352.95	1,302,837.54
第三层次	294,351.78	722,101.31
合计	264,711,959.49	255,369,543.76

##### 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	-	722,101.31	722,101.31
当期购买	-	288,247.72	288,247.72
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	899,615.21	899,615.21
当期利得或损失总额	-	183,617.96	183,617.96
其中：计入损益的利得或损失	-	183,617.96	183,617.96
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

(若有)			
期末余额	-	294,351.78	294,351.78
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	-	164,932.84	164,932.84
项目	上年度可比期间 2023 年 4 月 25 日 (基金合同生效日) 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	-	-	-
当期购买	-	573,645.53	573,645.53
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	7,539.34	7,539.34
当期利得或损失总额	-	155,995.12	155,995.12
其中: 计入损益的利得或损失	-	155,995.12	155,995.12
计入其他综合收益的利得或损失 (若有)	-	-	-
期末余额	-	722,101.31	722,101.31
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	-	155,098.98	155,098.98

## 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	294,351.78	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	722,101.31	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	264,610,513.44	93.97
	其中：股票	264,610,513.44	93.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	101,446.05	0.04
	其中：债券	101,446.05	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	16,223,400.77	5.76
8	其他各项资产	667,238.82	0.24
9	合计	281,602,599.08	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	47,010.00	0.02
B	采矿业	3,465,114.00	1.24
C	制造业	140,283,344.70	50.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,691,068.56	2.03
E	建筑业	3,181,883.36	1.13
F	批发和零售业	6,275,981.00	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	6,303,657.00	2.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,858,329.52	11.00
J	金融业	5,269,335.55	1.88
K	房地产业	4,331,130.00	1.54
L	租赁和商务服务业	5,435,885.77	1.94
M	科学研究和技术服务业	2,090,474.64	0.75
N	水利、环境和公共设施管理业	2,526,255.00	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,025.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	2,883,853.00	1.03
S	综合	-	-
	合计	218,660,347.10	77.96

## 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	-	-
B	采矿业	141,790.00	0.05
C	制造业	33,714,576.84	12.02

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	112,113.00	0.04
E	建筑业	374,675.00	0.13
F	批发和零售业	240,464.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	62,505.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,041,755.39	2.15
J	金融业	1,506,998.00	0.54
K	房地产业	63,825.00	0.02
L	租赁和商务服务业	522,004.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	986,732.68	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	811,879.43	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	418,070.00	0.15
Q	卫生和社会工作	920.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	951,858.00	0.34
S	综合	-	-
	合计	45,950,166.34	16.38

### 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	002139	拓邦股份	82,100	1,117,381.00	0.40
2	002400	省广集团	138,500	1,106,615.00	0.39
3	300315	掌趣科技	200,100	1,100,550.00	0.39
4	002456	欧菲光	88,000	1,054,240.00	0.38
5	000528	柳工	87,100	1,050,426.00	0.37
6	300666	江丰电子	14,300	993,135.00	0.35
7	300115	长盈精密	60,300	979,272.00	0.35
8	000686	东北证券	120,100	953,594.00	0.34
9	300432	富临精工	61,900	952,022.00	0.34
10	300570	太辰光	12,900	937,830.00	0.33

11	000766	通化金马	58,900	924,730.00	0.33
12	688110	东芯股份	36,957	920,229.30	0.33
13	000415	渤海租赁	241,600	910,832.00	0.32
14	300777	中简科技	32,100	908,109.00	0.32
15	688141	杰华特	29,611	906,392.71	0.32
16	300827	上能电气	20,600	904,340.00	0.32
17	002222	福晶科技	27,910	904,284.00	0.32
18	688019	安集科技	6,460	900,265.60	0.32
19	002906	华阳集团	29,000	891,750.00	0.32
20	600602	云赛智联	56,000	885,920.00	0.32
21	300035	中科电气	59,200	885,040.00	0.32
22	001301	尚太科技	12,400	850,020.00	0.30
23	300083	创世纪	129,800	844,998.00	0.30
24	002396	星网锐捷	44,000	835,560.00	0.30
25	002174	游族网络	88,400	826,540.00	0.29
26	300634	彩讯股份	37,900	826,220.00	0.29
27	688066	航天宏图	40,469	825,567.60	0.29
28	000829	天音控股	62,400	822,432.00	0.29
29	688400	凌云光	37,450	820,904.00	0.29
30	688200	华峰测控	7,812	816,354.00	0.29
31	300593	新雷能	71,200	797,440.00	0.28
32	601528	瑞丰银行	141,500	796,645.00	0.28
33	605376	博迁新材	27,500	796,125.00	0.28
34	002807	江阴银行	180,500	785,175.00	0.28
35	688484	南芯科技	21,630	779,545.20	0.28
36	000875	吉电股份	148,000	778,480.00	0.28
37	002036	联创电子	82,800	778,320.00	0.28
38	600216	浙江医药	49,000	777,140.00	0.28
39	300363	博腾股份	49,200	775,884.00	0.28
40	300181	佐力药业	50,500	775,680.00	0.28
41	601333	广深铁路	224,500	770,035.00	0.27
42	000676	智度股份	90,900	769,014.00	0.27
43	002446	盛路通信	116,900	765,695.00	0.27
44	300811	铂科新材	14,200	765,522.00	0.27
45	300031	宝通科技	41,500	760,280.00	0.27
46	000917	电广传媒	107,200	757,904.00	0.27
47	002605	姚记科技	28,400	757,144.00	0.27
48	301155	海力风电	14,100	751,671.00	0.27
49	688123	聚辰股份	12,811	749,699.72	0.27
50	002649	博彦科技	61,800	749,016.00	0.27
51	603766	隆鑫通用	82,000	746,200.00	0.27
52	600210	紫江企业	112,400	742,964.00	0.26
53	000736	中交地产	86,100	740,460.00	0.26
54	300772	运达股份	55,900	740,116.00	0.26

55	688372	伟测科技	12,437	727,813.24	0.26
56	300303	聚飞光电	106,700	727,694.00	0.26
57	000970	中科三环	70,000	725,900.00	0.26
58	688766	普冉股份	7,161	725,122.86	0.26
59	002675	东诚药业	59,100	722,202.00	0.26
60	300101	振芯科技	33,300	721,278.00	0.26
61	002928	华夏航空	92,700	719,352.00	0.26
62	600452	涪陵电力	67,700	716,943.00	0.26
63	002317	众生药业	59,000	716,850.00	0.26
64	300620	光库科技	14,700	714,420.00	0.25
65	600667	太极实业	102,900	712,068.00	0.25
66	002063	远光软件	123,600	711,936.00	0.25
67	600718	东软集团	66,000	710,820.00	0.25
68	600552	凯盛科技	62,200	709,702.00	0.25
69	688270	臻镭科技	20,218	707,630.00	0.25
70	600330	天通股份	99,300	705,030.00	0.25
71	002745	木林森	80,800	704,576.00	0.25
72	600882	妙可蓝多	39,100	699,890.00	0.25
73	002668	TCL 智家	53,200	697,984.00	0.25
74	300319	麦捷科技	55,900	697,632.00	0.25
75	001270	铖昌科技	18,250	695,325.00	0.25
76	600428	中远海特	95,000	693,500.00	0.25
77	603317	天味食品	51,900	692,346.00	0.25
78	601678	滨化股份	184,000	691,840.00	0.25
79	002043	兔宝宝	58,200	691,416.00	0.25
80	300170	汉得信息	55,600	689,440.00	0.25
81	300638	广和通	34,200	689,130.00	0.25
82	301078	孩子王	60,400	687,352.00	0.25
83	600986	浙文互联	114,900	687,102.00	0.24
84	601126	四方股份	40,400	685,184.00	0.24
85	300726	宏达电子	22,000	684,200.00	0.24
86	002254	泰和新材	72,700	683,380.00	0.24
87	002987	京北方	47,800	680,194.00	0.24
88	300079	数码视讯	125,700	680,037.00	0.24
89	000680	山推股份	70,100	679,970.00	0.24
90	002567	唐人神	133,300	679,830.00	0.24
91	601778	晶科科技	240,700	678,774.00	0.24
92	688232	新点软件	23,357	677,119.43	0.24
93	300226	上海钢联	29,580	676,494.60	0.24
94	002020	京新药业	52,800	675,840.00	0.24
95	002100	天康生物	102,700	672,685.00	0.24
96	600420	国药现代	56,300	672,222.00	0.24
97	603383	顶点软件	17,900	671,250.00	0.24
98	688403	汇成股份	74,792	670,136.32	0.24

99	002726	龙大美食	84,000	665,280.00	0.24
100	000035	中国天楹	136,300	663,781.00	0.24
101	300463	迈克生物	50,200	662,640.00	0.24
102	300415	伊之密	33,000	661,980.00	0.24
103	601860	紫金银行	232,123	661,550.55	0.24
104	002539	云图控股	84,000	656,880.00	0.23
105	300323	华灿光电	79,300	656,604.00	0.23
106	688388	嘉元科技	44,446	654,689.58	0.23
107	603323	苏农银行	123,300	652,257.00	0.23
108	300685	艾德生物	28,600	652,080.00	0.23
109	002061	浙江交科	159,500	650,760.00	0.23
110	601369	陕鼓动力	74,700	649,890.00	0.23
111	002015	协鑫能科	83,600	648,736.00	0.23
112	600717	天津港	133,000	647,710.00	0.23
113	603100	川仪股份	30,000	646,500.00	0.23
114	600273	嘉化能源	81,100	646,367.00	0.23
115	603699	纽威股份	29,100	645,147.00	0.23
116	002777	久远银海	37,400	644,028.00	0.23
117	300598	诚迈科技	13,300	643,720.00	0.23
118	300049	福瑞股份	20,400	643,416.00	0.23
119	300236	上海新阳	17,200	642,764.00	0.23
120	600114	东睦股份	39,700	641,949.00	0.23
121	300663	科蓝软件	36,900	640,584.00	0.23
122	000969	安泰科技	57,400	640,010.00	0.23
123	688209	英集芯	36,172	639,159.24	0.23
124	688131	皓元医药	17,902	639,101.40	0.23
125	603612	索通发展	47,200	637,672.00	0.23
126	688392	骄成超声	15,626	637,540.80	0.23
127	002099	海翔药业	123,500	637,260.00	0.23
128	002237	恒邦股份	63,000	636,300.00	0.23
129	603305	旭升集团	48,200	633,830.00	0.23
130	688206	概伦电子	33,509	633,655.19	0.23
131	688167	炬光科技	9,929	632,477.30	0.23
132	002773	康弘药业	32,200	631,120.00	0.23
133	002023	海特高新	62,100	630,315.00	0.22
134	002585	双星新材	117,700	628,518.00	0.22
135	002468	申通快递	62,000	628,060.00	0.22
136	000090	天健集团	152,700	627,597.00	0.22
137	002108	沧州明珠	174,800	627,532.00	0.22
138	000603	盛达资源	52,300	627,077.00	0.22
139	600017	日照港	195,300	624,960.00	0.22
140	301367	怡和嘉业	9,900	623,700.00	0.22
141	600459	贵研铂业	45,400	623,342.00	0.22
142	600550	保变电气	79,000	620,150.00	0.22

143	688608	恒玄科技	1,902	618,853.74	0.22
144	600116	三峡水利	88,200	616,518.00	0.22
145	002461	珠江啤酒	62,100	614,169.00	0.22
146	002226	江南化工	113,300	614,086.00	0.22
147	000062	深圳华强	27,400	613,760.00	0.22
148	600059	古越龙山	69,000	612,720.00	0.22
149	688261	东微半导	14,583	612,340.17	0.22
150	600395	盘江股份	120,300	612,327.00	0.22
151	002706	良信股份	79,500	610,560.00	0.22
152	301339	通行宝	30,000	610,200.00	0.22
152	600409	三友化工	113,000	610,200.00	0.22
154	301262	海看股份	24,500	609,315.00	0.22
155	600478	科力远	147,500	609,175.00	0.22
156	600063	皖维高新	152,100	608,400.00	0.22
157	000923	河钢资源	43,700	607,430.00	0.22
158	300627	华测导航	14,500	606,100.00	0.22
159	600073	光明肉业	87,300	605,862.00	0.22
160	002214	大立科技	54,300	605,445.00	0.22
161	688063	派能科技	15,079	603,913.95	0.22
162	300757	罗博特科	2,680	603,857.60	0.22
163	002891	中宠股份	16,900	603,330.00	0.22
164	002550	千红制药	97,300	603,260.00	0.22
165	600531	豫光金铅	93,900	602,838.00	0.21
166	603171	税友股份	19,700	600,850.00	0.21
167	603588	高能环境	114,300	598,932.00	0.21
168	000582	北部湾港	76,000	598,880.00	0.21
169	002626	金达威	39,600	597,960.00	0.21
170	600366	宁波韵升	80,800	594,688.00	0.21
171	600812	华北制药	115,000	594,550.00	0.21
172	605507	国邦医药	28,500	593,655.00	0.21
173	600328	中盐化工	75,400	593,398.00	0.21
174	600869	远东股份	124,900	593,275.00	0.21
175	002498	汉缆股份	174,900	592,911.00	0.21
176	300579	数字认证	18,800	590,696.00	0.21
177	600248	陕建股份	131,807	590,495.36	0.21
178	688007	光峰科技	39,880	589,825.20	0.21
179	688048	长光华芯	15,097	588,632.03	0.21
180	600888	新疆众和	82,900	588,590.00	0.21
181	600682	南京新百	86,000	588,240.00	0.21
182	600649	城投控股	132,100	587,845.00	0.21
183	000966	长源电力	123,700	587,575.00	0.21
184	600033	福建高速	151,200	586,656.00	0.21
185	003012	东鹏控股	88,700	586,307.00	0.21
186	000848	承德露露	65,300	585,741.00	0.21

187	300705	九典制药	32,600	585,170.00	0.21
188	600557	康缘药业	42,800	582,936.00	0.21
189	002249	大洋电机	99,000	581,130.00	0.21
190	002097	山河智能	77,400	580,500.00	0.21
191	001914	招商积余	54,900	580,293.00	0.21
192	601949	中国出版	80,800	580,144.00	0.21
193	603299	苏盐井神	51,900	578,166.00	0.21
194	301015	百洋医药	23,800	576,198.00	0.21
195	002204	大连重工	115,700	576,186.00	0.21
196	300232	洲明科技	83,700	575,019.00	0.21
197	600866	星湖科技	88,800	574,536.00	0.20
198	603328	依顿电子	58,200	573,852.00	0.20
199	000061	农产品	81,800	573,418.00	0.20
200	600710	苏美达	61,600	572,880.00	0.20
201	688001	华兴源创	21,127	572,541.70	0.20
202	002967	广电计量	34,900	572,360.00	0.20
203	301175	中科环保	105,700	570,780.00	0.20
204	600335	国机汽车	91,400	569,422.00	0.20
205	000049	德赛电池	24,200	568,942.00	0.20
206	002511	中顺洁柔	83,500	568,635.00	0.20
207	300257	开山股份	62,300	568,176.00	0.20
208	002755	奥赛康	44,600	566,866.00	0.20
209	301219	腾远钴业	12,500	565,125.00	0.20
210	600169	太原重工	226,800	564,732.00	0.20
211	603039	泛微网络	11,500	563,500.00	0.20
212	003006	百亚股份	23,400	561,366.00	0.20
213	002190	成飞集成	29,000	560,860.00	0.20
214	000672	上峰水泥	73,200	559,980.00	0.20
215	002091	江苏国泰	76,300	558,516.00	0.20
216	600783	鲁信创投	44,000	557,480.00	0.20
217	600780	通宝能源	99,000	557,370.00	0.20
218	603055	台华新材	50,300	557,324.00	0.20
219	603169	兰石重装	102,200	556,990.00	0.20
220	000550	江铃汽车	23,700	555,765.00	0.20
221	688432	有研硅	49,142	555,304.60	0.20
222	000488	晨鸣纸业	182,000	555,100.00	0.20
223	300261	雅本化学	80,900	554,165.00	0.20
224	600929	雪天盐业	98,900	552,851.00	0.20
225	688586	江航装备	57,737	552,543.09	0.20
226	600475	华光环能	61,200	551,412.00	0.20
227	002194	武汉凡谷	49,000	549,780.00	0.20
228	002349	精华制药	71,700	548,505.00	0.20
229	601969	海南矿业	77,300	548,057.00	0.20
230	601921	浙版传媒	69,500	547,660.00	0.20

231	603888	新华网	24,500	547,330.00	0.20
232	600810	神马股份	67,400	545,266.00	0.19
233	600508	上海能源	41,200	545,076.00	0.19
234	600639	浦东金桥	49,000	543,900.00	0.19
235	002258	利尔化学	65,700	543,339.00	0.19
236	002434	万里扬	87,400	541,880.00	0.19
237	600662	外服控股	106,531	540,112.17	0.19
238	000597	东北制药	102,400	539,648.00	0.19
239	300366	创意信息	57,900	538,470.00	0.19
240	603609	禾丰股份	62,400	537,888.00	0.19
241	000791	甘肃能源	88,100	531,243.00	0.19
242	002489	浙江永强	163,900	531,036.00	0.19
243	002516	旷达科技	104,400	529,308.00	0.19
244	300869	康泰医学	37,900	528,326.00	0.19
245	688343	云天励飞	10,620	526,752.00	0.19
246	688298	东方生物	17,761	520,930.13	0.19
247	002130	沃尔核材	20,600	520,150.00	0.19
248	603566	普莱柯	40,600	518,056.00	0.18
249	300768	迪普科技	29,400	514,500.00	0.18
250	603025	大豪科技	33,700	513,925.00	0.18
251	601022	宁波远洋	63,900	513,117.00	0.18
252	603267	鸿远电子	14,100	510,843.00	0.18
253	002651	利君股份	69,600	510,168.00	0.18
254	601187	厦门银行	90,100	508,164.00	0.18
255	688658	悦康药业	35,169	506,785.29	0.18
256	301327	华宝新能	6,600	506,286.00	0.18
257	002314	南山控股	212,200	505,036.00	0.18
258	002913	奥士康	20,300	489,433.00	0.17
259	301511	德福科技	38,200	479,792.00	0.17
260	000767	晋控电力	189,100	478,423.00	0.17
261	600757	长江传媒	49,000	468,930.00	0.17
262	301180	万祥科技	29,600	457,912.00	0.16
263	688347	华虹公司	9,830	456,800.10	0.16
264	002544	普天科技	21,000	450,030.00	0.16
265	688798	艾为电子	6,393	446,359.26	0.16
266	688083	中望软件	5,191	444,193.87	0.16
267	600633	浙数文化	42,400	443,504.00	0.16
268	603920	世运电路	14,900	438,060.00	0.16
269	601886	江河集团	80,700	435,780.00	0.16
270	603533	掌阅科技	21,400	434,634.00	0.15
271	600675	中华企业	150,400	422,624.00	0.15
272	000821	京山轻机	33,900	422,055.00	0.15
273	002697	红旗连锁	70,200	414,882.00	0.15
274	002851	麦格米特	6,600	405,636.00	0.14

275	601801	皖新传媒	55,100	404,434.00	0.14
276	688498	源杰科技	2,927	392,803.40	0.14
277	688037	芯源微	4,644	388,377.72	0.14
278	688018	乐鑫科技	1,754	382,372.00	0.14
279	300580	贝斯特	16,249	372,914.55	0.13
280	600266	城建发展	71,500	364,650.00	0.13
281	300674	宇信科技	18,100	353,312.00	0.13
282	601869	长飞光纤	11,800	352,702.00	0.13
283	688262	国芯科技	12,498	346,194.60	0.12
284	002315	焦点科技	8,300	345,944.00	0.12
285	001213	中铁特货	81,500	339,855.00	0.12
286	688050	爱博医疗	3,716	338,267.48	0.12
287	002837	英维克	8,372	338,228.80	0.12
288	300133	华策影视	44,500	321,290.00	0.11
289	300857	协创数据	3,000	320,670.00	0.11
290	300459	汤姆猫	55,200	316,848.00	0.11
291	603662	柯力传感	4,900	316,540.00	0.11
292	300679	电连技术	5,200	310,440.00	0.11
293	600827	百联股份	27,400	299,482.00	0.11
294	000801	四川九洲	20,600	294,786.00	0.11
295	003021	兆威机电	3,920	289,727.20	0.10
296	300762	上海瀚讯	13,500	283,905.00	0.10
297	688027	国盾量子	931	277,773.16	0.10
298	000058	深赛格	34,300	275,429.00	0.10
299	688362	甬矽电子	8,157	274,727.76	0.10
300	688322	奥比中光	5,814	270,351.00	0.10
301	688629	华丰科技	7,860	263,231.40	0.09
302	300346	南大光电	6,700	258,553.00	0.09
303	688332	中科蓝讯	1,950	254,475.00	0.09
304	688327	云从科技	20,933	253,289.30	0.09
305	300624	万兴科技	3,993	252,157.95	0.09
306	688183	生益电子	6,413	251,774.38	0.09
307	688318	财富趋势	1,448	247,608.00	0.09
308	002405	四维图新	25,500	245,820.00	0.09
309	603337	杰克股份	8,000	243,680.00	0.09
310	300820	英杰电气	4,400	243,100.00	0.09
311	688568	中科星图	4,738	241,780.14	0.09
312	300475	香农芯创	8,400	239,316.00	0.09
313	688582	芯动联科	4,724	237,664.44	0.08
314	600389	江山股份	15,900	229,755.00	0.08
315	300850	新强联	12,000	229,320.00	0.08
316	688686	奥普特	3,011	227,661.71	0.08
317	600657	信达地产	54,500	226,720.00	0.08
318	605599	莱百股份	19,900	225,865.00	0.08

319	300451	创业慧康	49,700	222,656.00	0.08
320	300738	奥飞数据	15,200	220,400.00	0.08
321	688702	盛科通信	2,613	219,492.00	0.08
322	688116	天奈科技	5,631	218,539.11	0.08
323	301171	易点天下	7,700	217,063.00	0.08
324	603218	日月股份	18,000	216,900.00	0.08
325	600641	万业企业	14,700	214,914.00	0.08
326	601595	上海电影	8,700	214,890.00	0.08
327	002402	和而泰	11,500	208,265.00	0.07
328	605589	圣泉集团	8,700	205,146.00	0.07
329	300618	寒锐钴业	6,000	202,620.00	0.07
330	002126	银轮股份	10,700	200,304.00	0.07
331	600320	振华重工	50,900	199,528.00	0.07
332	002048	宁波华翔	15,600	196,872.00	0.07
333	301205	联特科技	2,600	196,794.00	0.07
334	300458	全志科技	5,000	193,800.00	0.07
335	688235	百济神州	1,196	192,579.92	0.07
336	688696	极米科技	1,952	191,335.04	0.07
337	688596	正帆科技	5,353	190,299.15	0.07
338	300525	博思软件	12,000	186,960.00	0.07
339	301050	雷电微力	3,600	185,688.00	0.07
340	688127	蓝特光学	6,833	185,174.30	0.07
341	002292	奥飞娱乐	21,300	184,245.00	0.07
342	300913	兆龙互连	3,200	184,032.00	0.07
343	688300	联瑞新材	2,809	180,899.60	0.06
344	300672	国科微	2,700	180,225.00	0.06
345	603283	赛腾股份	2,600	179,816.00	0.06
346	688321	微芯生物	9,583	178,052.14	0.06
347	002960	青鸟消防	15,100	176,217.00	0.06
348	300973	立高食品	4,500	175,635.00	0.06
349	688559	海目星	5,092	175,164.80	0.06
350	600623	华谊集团	25,000	175,000.00	0.06
351	001696	宗申动力	7,000	174,300.00	0.06
352	300737	科顺股份	34,200	173,394.00	0.06
353	688147	微导纳米	6,407	172,284.23	0.06
354	600100	同方股份	24,100	171,351.00	0.06
355	002123	梦网科技	15,800	170,798.00	0.06
356	002654	万润科技	13,900	168,607.00	0.06
357	300660	江苏雷利	4,400	168,168.00	0.06
358	688088	虹软科技	4,353	167,851.68	0.06
359	603678	火炬电子	5,500	167,750.00	0.06
360	002351	漫步者	10,100	166,650.00	0.06
361	300602	飞荣达	8,600	165,292.00	0.06
362	002990	盛视科技	7,100	164,507.00	0.06

363	300182	捷成股份	27,600	162,012.00	0.06
364	002245	蔚蓝锂芯	14,500	155,005.00	0.06
365	600458	时代新材	12,100	155,001.00	0.06
366	300253	卫宁健康	21,600	154,656.00	0.06
367	603083	剑桥科技	3,800	154,280.00	0.06
368	002127	南极电商	34,500	151,800.00	0.05
369	002212	天融信	23,500	151,575.00	0.05
370	002698	博实股份	8,900	151,300.00	0.05
371	300725	药石科技	4,500	151,200.00	0.05
372	000950	重药控股	28,100	151,178.00	0.05
373	600559	老白干酒	7,200	151,128.00	0.05
374	688523	航天环宇	7,510	150,200.00	0.05
375	002991	甘源食品	1,600	149,632.00	0.05
376	600967	内蒙一机	17,200	146,200.00	0.05
377	300088	长信科技	22,200	145,188.00	0.05
378	300783	三只松鼠	3,900	143,793.00	0.05
379	603801	志邦家居	11,200	143,472.00	0.05
380	600621	华鑫股份	8,700	143,376.00	0.05
381	002497	雅化集团	12,200	142,740.00	0.05
382	603866	桃李面包	21,600	142,560.00	0.05
383	688433	华曙高科	6,094	142,233.96	0.05
384	002068	黑猫股份	13,300	141,512.00	0.05
385	688631	莱斯信息	1,615	140,650.35	0.05
386	000555	神州信息	12,500	140,000.00	0.05
387	688408	中信博	1,942	139,824.00	0.05
388	002747	埃斯顿	7,500	138,750.00	0.05
389	603983	丸美生物	4,300	138,718.00	0.05
390	603236	移远通信	2,000	136,880.00	0.05
391	600577	精达股份	18,700	136,323.00	0.05
392	600728	佳都科技	29,100	136,188.00	0.05
393	688192	迪哲医药	3,284	136,187.48	0.05
394	688612	威迈斯	5,742	135,166.68	0.05
395	300568	星源材质	13,800	134,136.00	0.05
396	000503	国新健康	12,200	133,956.00	0.05
397	688326	经纬恒润	1,582	133,046.20	0.05
398	601375	中原证券	30,700	132,624.00	0.05
399	688150	莱特光电	5,887	132,575.24	0.05
400	688443	智翔金泰	5,255	131,847.95	0.05
401	002617	露笑科技	17,100	130,815.00	0.05
402	601908	京运通	42,800	130,540.00	0.05
403	688700	东威科技	4,429	130,478.34	0.05
404	301095	广立微	2,500	130,175.00	0.05
405	601311	骆驼股份	15,700	130,153.00	0.05
406	301325	曼恩斯特	2,400	130,056.00	0.05

407	300613	富瀚微	2,200	128,700.00	0.05
408	603103	横店影视	8,900	128,071.00	0.05
409	002324	普利特	13,400	127,702.00	0.05
410	000837	秦川机床	14,100	126,477.00	0.05
411	600562	国睿科技	6,300	125,559.00	0.04
412	300443	金雷股份	6,300	125,496.00	0.04
413	605111	新洁能	3,660	124,110.60	0.04
414	605333	沪光股份	3,800	123,994.00	0.04
415	603306	华懋科技	3,900	123,279.00	0.04
416	301153	中科江南	4,300	120,142.00	0.04
417	002484	江海股份	6,800	119,544.00	0.04
418	600850	电科数字	5,000	119,500.00	0.04
419	002216	三全食品	9,900	118,800.00	0.04
420	603915	国茂股份	10,100	118,372.00	0.04
421	300036	超图软件	6,900	117,162.00	0.04
422	600729	重庆百货	4,000	117,000.00	0.04
423	300130	新国都	5,400	116,964.00	0.04
424	688352	硕中科技	9,557	115,926.41	0.04
425	000885	城发环境	8,800	115,368.00	0.04
426	300457	赢合科技	6,000	114,840.00	0.04
427	600601	方正科技	26,000	114,140.00	0.04
428	688289	圣湘生物	5,007	113,658.90	0.04
429	300456	赛微电子	6,600	113,388.00	0.04
430	688006	杭可科技	6,286	112,267.96	0.04
431	600477	杭萧钢构	43,600	112,052.00	0.04
432	301238	瑞泰新材	7,100	111,186.00	0.04
433	688409	富创精密	2,134	110,050.38	0.04
434	603108	润达医疗	6,900	109,917.00	0.04
435	603730	岱美股份	12,100	108,779.00	0.04
436	688097	博众精工	4,093	107,441.25	0.04
437	603489	八方股份	4,500	107,190.00	0.04
438	600861	北京人力	5,500	106,425.00	0.04
439	300409	道氏技术	7,800	106,158.00	0.04
440	000762	西藏矿业	4,900	105,350.00	0.04
441	688598	金博股份	4,908	103,362.48	0.04
442	300260	新莱应材	3,800	102,942.00	0.04
443	603063	禾望电气	5,100	101,796.00	0.04
444	605168	三人行	2,800	100,576.00	0.04
445	600775	南京熊猫	10,000	100,400.00	0.04
446	002192	融捷股份	3,100	98,890.00	0.04
447	300045	华力创通	4,700	98,183.00	0.04
448	300188	国投智能	7,100	97,909.00	0.03
449	688503	聚和材料	2,183	96,685.07	0.03
450	688029	南微医学	1,427	96,450.93	0.03

451	688639	华恒生物	2,960	95,341.60	0.03
452	603008	喜临门	5,600	93,856.00	0.03
453	688515	裕太微	948	93,852.00	0.03
454	600596	新安股份	10,500	92,190.00	0.03
455	000657	中钨高新	10,000	92,100.00	0.03
456	600586	金晶科技	16,000	89,920.00	0.03
457	600502	安徽建工	18,700	89,386.00	0.03
458	688776	国光电气	1,888	89,359.04	0.03
459	688336	三生国健	4,158	89,064.36	0.03
460	000420	吉林化纤	24,600	88,806.00	0.03
461	002378	章源钨业	13,680	88,509.60	0.03
462	002079	苏州固锴	8,600	88,322.00	0.03
463	002847	盐津铺子	1,400	87,640.00	0.03
464	601028	玉龙股份	7,600	87,096.00	0.03
465	001323	慕思股份	2,300	86,963.00	0.03
466	603327	福蓉科技	7,000	84,980.00	0.03
467	002096	易普力	7,100	84,348.00	0.03
468	300776	帝尔激光	1,300	82,654.00	0.03
469	300298	三诺生物	3,200	82,592.00	0.03
470	601890	亚星锚链	10,600	82,574.00	0.03
471	600363	联创光电	1,700	81,396.00	0.03
472	000099	中信海直	3,000	79,080.00	0.03
473	688139	海尔生物	2,157	75,926.40	0.03
474	300438	鹏辉能源	2,700	75,897.00	0.03
475	688348	昱能科技	1,534	74,859.20	0.03
476	688389	普门科技	4,865	72,439.85	0.03
477	002389	航天彩虹	4,000	72,200.00	0.03
478	002171	楚江新材	8,800	72,160.00	0.03
479	300129	泰胜风能	10,200	71,910.00	0.03
480	300633	开立医疗	2,400	70,536.00	0.03
481	603619	中曼石油	3,600	69,696.00	0.02
482	300855	图南股份	3,100	67,952.00	0.02
483	603026	石大胜华	1,900	66,500.00	0.02
484	600587	新华医疗	3,920	65,268.00	0.02
485	601137	博威合金	3,200	64,960.00	0.02
486	688522	纳睿雷达	1,151	64,847.34	0.02
487	603027	千禾味业	5,300	64,183.00	0.02
488	601677	明泰铝业	5,300	63,759.00	0.02
489	603985	恒润股份	5,400	63,072.00	0.02
490	688177	百奥泰	3,193	61,880.34	0.02
491	603881	数据港	2,730	61,834.50	0.02
492	301363	美好医疗	1,900	61,598.00	0.02
493	300348	长亮科技	4,300	61,490.00	0.02
494	603005	晶方科技	2,160	61,020.00	0.02

495	300735	光弘科技	2,100	58,779.00	0.02
496	688062	迈威生物	2,823	57,024.60	0.02
497	688208	道通科技	1,444	56,547.04	0.02
498	300327	中颖电子	2,300	56,281.00	0.02
499	688502	茂莱光学	279	56,190.60	0.02
500	601222	林洋能源	7,800	55,146.00	0.02
501	002701	奥瑞金	9,500	53,865.00	0.02
502	300075	数字政通	3,100	53,630.00	0.02
503	600064	南京高科	6,900	53,613.00	0.02
504	300655	晶瑞电材	5,700	53,352.00	0.02
505	688707	振华新材	4,848	53,085.60	0.02
506	300229	拓尔思	2,500	52,350.00	0.02
507	600269	赣粤高速	9,200	51,612.00	0.02
508	600110	诺德股份	12,900	51,600.00	0.02
509	300185	通裕重工	19,900	51,143.00	0.02
510	600399	抚顺特钢	8,700	50,460.00	0.02
511	600664	哈药股份	12,000	49,560.00	0.02
512	300393	中来股份	7,900	49,375.00	0.02
513	600037	歌华有线	6,600	49,236.00	0.02
514	002332	仙琚制药	4,900	48,706.00	0.02
515	000758	中色股份	9,800	48,412.00	0.02
516	600595	中孚实业	17,100	48,393.00	0.02
517	002004	华邦健康	10,700	48,364.00	0.02
518	600645	中源协和	2,500	48,250.00	0.02
519	300455	航天智装	3,700	47,952.00	0.02
520	603733	仙鹤股份	2,300	47,449.00	0.02
521	000156	华数传媒	6,400	46,080.00	0.02
522	688333	铂力特	1,147	45,226.21	0.02
523	002705	新宝股份	3,000	45,000.00	0.02
524	001311	多利科技	1,700	43,843.00	0.02
525	002859	洁美科技	2,100	43,575.00	0.02
526	688779	五矿新能	8,136	43,283.52	0.02
527	603355	莱克电气	1,900	43,035.00	0.02
528	600874	创业环保	7,200	42,984.00	0.02
529	002399	海普瑞	4,000	42,760.00	0.02
530	600996	贵广网络	5,000	42,750.00	0.02
531	603719	良品铺子	3,000	42,630.00	0.02
532	000968	蓝焰控股	6,400	42,560.00	0.02
533	600987	航民股份	6,100	42,334.00	0.02
534	301217	铜冠铜箔	3,800	42,104.00	0.02
535	301031	中熔电气	400	41,608.00	0.01
536	002191	劲嘉股份	9,900	41,580.00	0.01
537	002275	桂林三金	2,700	40,743.00	0.01
538	603989	艾华集团	2,700	40,716.00	0.01

539	600640	国脉文化	3,400	40,596.00	0.01
540	000030	富奥股份	7,900	40,527.00	0.01
541	600058	五矿发展	5,600	39,872.00	0.01
542	600864	哈投股份	5,300	38,955.00	0.01
543	002534	西子洁能	3,500	38,885.00	0.01
544	688128	中国电研	1,827	38,385.27	0.01
545	603301	振德医疗	1,700	37,383.00	0.01
546	603075	热威股份	2,000	37,260.00	0.01
547	601279	英利汽车	9,700	37,151.00	0.01
548	002895	川恒股份	1,500	36,900.00	0.01
549	601718	际华集团	12,200	34,648.00	0.01
550	300171	东富龙	2,600	34,528.00	0.01
551	300623	捷捷微电	1,000	34,160.00	0.01
552	002978	安宁股份	1,200	34,104.00	0.01
553	600223	福瑞达	4,500	34,020.00	0.01
554	002506	协鑫集成	12,600	33,642.00	0.01
555	000951	中国重汽	1,900	32,262.00	0.01
556	300085	银之杰	800	30,600.00	0.01
557	000543	皖能电力	3,800	30,058.00	0.01
558	002075	沙钢股份	4,700	29,422.00	0.01
559	002183	怡亚通	6,500	29,185.00	0.01
560	002390	信邦制药	6,400	29,120.00	0.01
561	600422	昆药集团	1,800	28,530.00	0.01
562	300775	三角防务	1,100	27,423.00	0.01
563	600138	中青旅	2,700	27,378.00	0.01
564	300841	康华生物	500	27,260.00	0.01
565	000029	深深房 A	1,800	27,108.00	0.01
566	603368	柳药集团	1,500	26,790.00	0.01
567	600072	中船科技	1,900	26,695.00	0.01
568	301268	铭利达	1,600	26,528.00	0.01
569	000990	诚志股份	3,400	26,350.00	0.01
570	688548	广钢气体	2,610	26,282.70	0.01
571	000928	中钢国际	4,100	26,117.00	0.01
572	600323	瀚蓝环境	1,100	25,982.00	0.01
573	600773	西藏城投	2,400	25,872.00	0.01
574	600997	开滦股份	3,800	25,688.00	0.01
575	300723	一品红	1,500	25,590.00	0.01
576	002003	伟星股份	1,800	25,506.00	0.01
577	001389	广合科技	507	25,502.10	0.01
578	600961	株冶集团	3,200	25,184.00	0.01
579	603477	巨星农牧	1,400	24,850.00	0.01
580	300641	正丹股份	1,000	24,840.00	0.01
581	000581	威孚高科	1,300	24,544.00	0.01
582	601975	招商南油	7,800	24,414.00	0.01

583	300926	博俊科技	1,100	24,211.00	0.01
584	601015	陕西黑猫	7,200	24,048.00	0.01
585	601069	西部黄金	2,100	24,045.00	0.01
586	000718	苏宁环球	10,000	23,600.00	0.01
587	605365	立达信	1,500	23,550.00	0.01
588	603439	贵州三力	1,800	23,400.00	0.01
589	600894	广日股份	1,600	23,360.00	0.01
590	300702	天宇股份	1,400	23,324.00	0.01
591	605577	龙版传媒	1,600	23,248.00	0.01
592	002597	金禾实业	1,000	22,830.00	0.01
593	600456	宝钛股份	800	22,760.00	0.01
594	000690	宝新能源	5,000	22,400.00	0.01
595	605296	神农集团	800	22,160.00	0.01
596	601068	中铝国际	5,000	22,050.00	0.01
597	002270	华明装备	1,300	21,957.00	0.01
598	000913	钱江摩托	1,200	21,612.00	0.01
599	605123	派克新材	400	21,504.00	0.01
600	600572	康恩贝	4,500	20,970.00	0.01
601	000902	新洋丰	1,600	20,864.00	0.01
602	000012	南玻 A	3,800	20,064.00	0.01
603	605009	豪悦护理	500	19,980.00	0.01
604	002233	塔牌集团	2,600	19,942.00	0.01
605	601882	海天精工	900	19,737.00	0.01
606	300682	朗新集团	1,600	19,520.00	0.01
607	301035	润丰股份	400	19,488.00	0.01
608	688380	中微半导	647	19,345.30	0.01
609	600648	外高桥	1,600	19,056.00	0.01
610	601208	东材科技	2,500	18,850.00	0.01
611	300034	钢研高纳	1,200	18,720.00	0.01
612	603638	艾迪精密	1,100	18,579.00	0.01
613	000869	张裕 A	800	18,552.00	0.01
614	600020	中原高速	4,300	18,146.00	0.01
615	301039	中集车辆	2,000	18,100.00	0.01
616	688106	金宏气体	1,055	17,945.55	0.01
617	600305	恒顺醋业	2,200	17,556.00	0.01
618	688556	高测股份	1,563	17,474.34	0.01
619	601811	新华文轩	1,100	17,435.00	0.01
620	300741	华宝股份	1,000	17,390.00	0.01
621	301216	万凯新材	1,700	17,340.00	0.01
622	600643	爱建集团	3,300	17,061.00	0.01
623	688146	中船特气	587	17,046.48	0.01
624	300244	迪安诊断	1,500	17,025.00	0.01
625	002088	鲁阳节能	1,300	16,627.00	0.01
626	000025	特力 A	1,000	16,520.00	0.01

627	300770	新媒股份	400	16,164.00	0.01
628	688531	日联科技	339	16,146.57	0.01
629	000761	本钢板材	4,900	15,680.00	0.01
630	688268	华特气体	337	15,475.04	0.01
631	603093	南华期货	1,300	15,470.00	0.01
632	002901	大博医疗	500	15,420.00	0.01
633	605222	起帆电缆	1,000	15,400.00	0.01
634	301090	华润材料	2,200	15,268.00	0.01
635	600388	龙净环保	1,200	15,180.00	0.01
636	688383	新益昌	338	15,166.06	0.01
637	600403	大有能源	5,100	14,994.00	0.01
638	603466	风语筑	1,600	14,912.00	0.01
639	688526	科前生物	1,038	14,833.02	0.01
640	603530	神马电力	600	14,826.00	0.01
641	000517	荣安地产	6,500	14,495.00	0.01
642	688630	芯碁微装	238	13,737.36	0.00
643	002101	广东鸿图	1,100	13,178.00	0.00
644	002312	川发龙蟒	900	13,023.00	0.00
645	300039	上海凯宝	2,100	12,978.00	0.00
646	301606	绿联科技	259	9,450.91	0.00
647	603162	海通发展	900	8,280.00	0.00
648	002948	青岛银行	1,800	6,984.00	0.00
649	000810	创维数字	400	6,368.00	0.00
650	603496	恒为科技	200	5,436.00	0.00
651	300693	盛弘股份	200	5,392.00	0.00
652	600171	上海贝岭	100	3,968.00	0.00
653	603220	中贝通信	100	2,297.00	0.00
654	600285	羚锐制药	100	2,216.00	0.00
655	000681	视觉中国	100	2,082.00	0.00
656	300747	锐科激光	100	1,916.00	0.00
657	000811	冰轮环境	100	1,226.00	0.00
658	603567	珍宝岛	100	1,160.00	0.00
659	600480	凌云股份	100	1,081.00	0.00
660	002815	崇达技术	100	1,020.00	0.00
661	002911	佛燃能源	79	998.56	0.00
662	000795	英洛华	100	973.00	0.00
663	002163	海南发展	100	935.00	0.00
664	600158	中体产业	100	827.00	0.00
665	002038	双鹭药业	100	747.00	0.00
666	600201	生物股份	100	686.00	0.00
667	000650	仁和药业	100	576.00	0.00
668	000600	建投能源	100	566.00	0.00
669	000059	华锦股份	100	479.00	0.00
670	000813	德展健康	100	313.00	0.00

671	600252	中恒集团	100	246.00	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	688313	仕佳光子	35,904	588,466.56	0.21
2	605305	中际联合	20,100	569,433.00	0.20
3	600732	爱旭股份	48,500	534,470.00	0.19
4	688381	帝奥微	25,024	482,462.72	0.17
5	300752	隆利科技	28,100	477,700.00	0.17
6	603138	海量数据	31,900	458,403.00	0.16
7	688233	神工股份	19,339	453,499.55	0.16
8	600438	通威股份	20,400	451,044.00	0.16
9	000725	京东方 A	100,300	440,317.00	0.16
10	300529	健帆生物	14,800	434,232.00	0.15
11	603890	春秋电子	36,800	432,400.00	0.15
12	000783	长江证券	63,100	430,342.00	0.15
13	002284	亚太股份	55,300	428,022.00	0.15
14	002869	金溢科技	16,000	425,600.00	0.15
15	003032	传智教育	43,100	418,070.00	0.15
16	688256	寒武纪	635	417,830.00	0.15
17	300684	中石科技	18,600	417,198.00	0.15
18	688609	九联科技	38,587	409,022.20	0.15
19	688158	优刻得	28,683	400,988.34	0.14
20	688017	绿的谐波	3,433	370,969.98	0.13
21	688361	中科飞测	3,834	335,666.70	0.12
22	300502	新易盛	2,900	335,182.00	0.12
23	300308	中际旭创	2,660	328,536.60	0.12
24	300474	景嘉微	3,300	308,517.00	0.11
25	001215	千味央厨	10,000	306,800.00	0.11
26	688205	德科立	3,355	305,305.00	0.11
27	601377	兴业证券	47,500	297,350.00	0.11
28	688692	达梦数据	790	287,907.60	0.10
29	688525	佰维存储	4,241	262,814.77	0.09
30	688099	晶晨股份	3,744	257,137.92	0.09
31	300494	盛天网络	22,000	247,280.00	0.09
32	300394	天孚通信	2,700	246,672.00	0.09
33	688698	伟创电气	5,495	241,780.00	0.09
34	300364	中文在线	9,800	240,394.00	0.09
35	688047	龙芯中科	1,815	240,088.20	0.09
36	002436	兴森科技	20,600	228,866.00	0.08
37	688041	海光信息	1,525	228,429.75	0.08

38	688627	精智达	2,892	210,855.72	0.08
39	688072	拓荆科技	1,345	206,686.15	0.07
40	688120	华海清科	1,240	202,107.60	0.07
41	300033	同花顺	700	201,250.00	0.07
42	688160	步科股份	3,430	196,744.80	0.07
43	002779	中坚科技	2,800	190,400.00	0.07
44	688052	纳芯微	1,453	189,325.90	0.07
45	688012	中微公司	996	188,403.36	0.07
46	603809	豪能股份	16,100	187,243.00	0.07
47	301231	荣信文化	10,400	186,992.00	0.07
48	002549	凯美特气	30,200	185,126.00	0.07
49	002995	天地在线	8,400	184,044.00	0.07
50	688111	金山办公	620	177,561.80	0.06
51	002472	双环传动	5,700	174,534.00	0.06
52	688535	华海诚科	2,290	170,261.50	0.06
53	002850	科达利	1,700	166,056.00	0.06
54	002050	三花智控	7,000	164,570.00	0.06
55	002230	科大讯飞	3,400	164,288.00	0.06
56	301550	斯菱股份	2,200	160,138.00	0.06
57	601689	拓普集团	3,255	159,495.00	0.06
58	002371	北方华创	400	156,400.00	0.06
59	300383	光环新网	10,600	154,654.00	0.06
60	688375	国博电子	3,090	152,522.40	0.05
61	002939	长城证券	18,600	152,520.00	0.05
62	603019	中科曙光	2,100	151,872.00	0.05
63	300059	东方财富	5,800	149,756.00	0.05
64	301358	湖南裕能	3,300	149,556.00	0.05
65	600183	生益科技	6,200	149,110.00	0.05
66	300347	泰格医药	2,700	147,474.00	0.05
67	300652	雷迪克	4,900	145,628.00	0.05
68	000034	神州数码	4,100	143,705.00	0.05
69	688031	星环科技	3,106	143,279.78	0.05
70	603893	瑞芯微	1,300	143,078.00	0.05
71	000066	中国长城	9,800	142,786.00	0.05
72	603712	七一二	7,300	142,131.00	0.05
73	688252	天德钰	5,932	142,071.40	0.05
74	603810	丰山集团	15,600	141,024.00	0.05
75	002902	铭普光磁	6,000	140,280.00	0.05
76	688486	龙迅股份	1,787	139,457.48	0.05
77	300395	菲利华	3,700	139,157.00	0.05
78	300042	朗科科技	6,000	138,600.00	0.05
79	603738	泰晶科技	9,200	137,816.00	0.05
80	301165	锐捷网络	1,900	137,180.00	0.05
81	300369	绿盟科技	19,000	136,610.00	0.05

82	688095	福昕软件	2,031	136,401.96	0.05
83	300781	因赛集团	2,300	135,769.00	0.05
84	688800	瑞可达	2,705	135,547.55	0.05
85	002979	雷赛智能	4,400	135,476.00	0.05
86	300853	申昊科技	5,400	135,432.00	0.05
87	300607	拓斯达	5,300	135,097.00	0.05
88	000977	浪潮信息	2,600	134,888.00	0.05
89	301191	菲菱科思	1,500	134,175.00	0.05
90	300002	神州泰岳	11,500	133,285.00	0.05
91	603667	五洲新春	5,300	131,175.00	0.05
92	002281	光迅科技	2,500	130,425.00	0.05
93	300007	汉威科技	6,300	128,835.00	0.05
94	002465	海格通信	11,700	128,466.00	0.05
95	688305	科德数控	1,880	128,159.60	0.05
96	688668	鼎通科技	2,714	127,178.04	0.05
97	301030	仕净科技	5,200	125,528.00	0.04
98	301413	安培龙	2,343	125,373.93	0.04
99	688195	腾景科技	3,106	124,799.08	0.04
100	002824	和胜股份	7,900	124,030.00	0.04
101	688577	浙海德曼	3,157	123,691.26	0.04
102	688416	恒烁股份	3,170	123,630.00	0.04
103	603598	引力传媒	7,300	123,297.00	0.04
104	603977	国泰集团	9,300	120,435.00	0.04
105	688558	国盛智科	5,627	120,136.45	0.04
106	688159	有方科技	3,965	119,901.60	0.04
107	688353	华盛锂电	5,103	119,308.14	0.04
108	603728	鸣志电器	2,200	118,800.00	0.04
109	301392	汇成真空	1,919	118,517.44	0.04
110	688697	纽威数控	7,097	118,094.08	0.04
111	688003	天准科技	2,726	118,035.80	0.04
112	002558	巨人网络	9,300	118,017.00	0.04
113	601788	光大证券	6,500	117,715.00	0.04
114	688621	阳光诺和	3,118	117,548.60	0.04
115	301236	软通动力	2,000	117,420.00	0.04
116	688281	华秦科技	1,257	117,026.70	0.04
117	605289	罗曼股份	4,600	115,276.00	0.04
118	688234	天岳先进	2,242	114,790.40	0.04
119	002407	多氟多	9,500	114,000.00	0.04
120	300707	威唐工业	7,400	113,738.00	0.04
121	300476	胜宏科技	2,700	113,643.00	0.04
122	002261	拓维信息	6,200	113,522.00	0.04
123	688369	致远互联	5,649	113,375.43	0.04
124	300759	康龙化成	4,400	113,080.00	0.04
125	301556	托普云农	1,300	112,346.00	0.04

126	688521	芯原股份	2,139	112,147.77	0.04
127	688165	埃夫特	4,202	110,932.80	0.04
128	688778	厦钨新能	2,429	110,859.56	0.04
129	603081	大丰实业	9,800	110,740.00	0.04
130	300161	华中数控	4,200	110,628.00	0.04
131	300212	易华录	4,700	109,980.00	0.04
132	300567	精测电子	1,700	109,310.00	0.04
133	688005	容百科技	3,464	109,289.20	0.04
134	301011	华立科技	4,200	107,898.00	0.04
135	603258	电魂网络	5,400	107,406.00	0.04
136	688286	敏芯股份	1,782	107,365.50	0.04
137	300548	博创科技	2,300	106,743.00	0.04
138	688082	盛美上海	1,062	106,200.00	0.04
139	688084	晶品特装	1,885	106,125.50	0.04
140	600316	洪都航空	3,300	105,996.00	0.04
141	688659	元琛科技	15,490	104,557.50	0.04
142	300403	汉宇集团	10,500	104,475.00	0.04
143	301052	果麦文化	4,100	104,304.00	0.04
144	002045	国光电器	4,800	104,112.00	0.04
145	600549	厦门钨业	5,400	104,058.00	0.04
146	000938	紫光股份	3,700	102,971.00	0.04
147	300586	美联新材	12,400	100,936.00	0.04
148	002080	中材科技	7,700	100,716.00	0.04
149	300860	锋尚文化	3,600	100,188.00	0.04
150	688312	燕麦科技	3,239	99,761.20	0.04
151	688682	霍莱沃	2,864	99,667.20	0.04
152	000988	华工科技	2,300	99,590.00	0.04
153	688239	航宇科技	2,659	99,180.70	0.04
154	603232	格尔软件	7,700	99,176.00	0.04
155	300654	世纪天鸿	9,800	98,882.00	0.04
156	000936	华西股份	12,100	98,857.00	0.04
157	688002	睿创微纳	2,090	98,250.90	0.04
158	601099	太平洋	23,000	97,980.00	0.03
159	605555	德昌股份	4,500	97,380.00	0.03
160	688320	禾川科技	2,498	97,172.20	0.03
161	300258	精锻科技	10,900	97,119.00	0.03
162	605488	福莱新材	4,600	97,106.00	0.03
163	000733	振华科技	2,300	96,991.00	0.03
164	603906	龙蟠科技	9,300	96,348.00	0.03
165	300980	祥源新材	4,200	96,180.00	0.03
166	300556	丝路视觉	5,000	95,250.00	0.03
167	301310	鑫宏业	3,700	94,720.00	0.03
168	300174	元力股份	6,400	94,208.00	0.03
169	688518	联赢激光	5,877	93,091.68	0.03

170	002829	星网宇达	4,900	92,904.00	0.03
171	002896	中大力德	2,400	92,184.00	0.03
172	688295	中复神鹰	4,601	91,697.93	0.03
173	688025	杰普特	1,893	89,917.50	0.03
174	300217	东方电热	19,300	87,043.00	0.03
175	688636	智明达	3,088	86,772.80	0.03
176	688170	德龙激光	3,845	86,474.05	0.03
177	688186	广大特材	5,623	86,313.05	0.03
178	688685	迈信林	2,593	86,061.67	0.03
179	688143	长盈通	3,898	85,833.96	0.03
180	688311	盟升电子	2,561	84,794.71	0.03
181	300611	美力科技	8,000	84,560.00	0.03
182	301005	超捷股份	2,880	84,240.00	0.03
183	002917	金奥博	8,800	84,128.00	0.03
184	002240	盛新锂能	6,100	84,058.00	0.03
185	603650	彤程新材	2,400	83,928.00	0.03
186	300354	东华测试	2,400	83,496.00	0.03
187	605277	新亚电子	5,900	83,249.00	0.03
188	300378	鼎捷数智	3,200	82,784.00	0.03
189	688651	盛邦安全	2,338	82,695.06	0.03
190	300900	广联航空	3,700	81,400.00	0.03
191	002858	力盛体育	7,100	81,224.00	0.03
192	300499	高澜股份	4,000	80,640.00	0.03
193	688579	山大地纬	8,696	79,916.24	0.03
194	688008	澜起科技	1,172	79,578.80	0.03
195	002683	广东宏大	3,000	79,440.00	0.03
196	002756	永兴材料	2,100	79,212.00	0.03
197	300809	华辰装备	2,500	79,200.00	0.03
198	300114	中航电测	1,100	78,958.00	0.03
199	002965	祥鑫科技	2,300	78,729.00	0.03
200	002368	太极股份	3,300	78,144.00	0.03
201	001282	三联锻造	3,720	78,120.00	0.03
202	002738	中矿资源	2,200	78,100.00	0.03
203	301312	智立方	1,600	77,760.00	0.03
204	002765	蓝黛科技	9,000	77,400.00	0.03
205	002156	通富微电	2,600	76,830.00	0.03
206	000768	中航西飞	2,700	76,248.00	0.03
207	300724	捷佳伟创	1,200	75,852.00	0.03
208	301517	陕西华达	1,400	75,642.00	0.03
209	688543	国科军工	1,500	75,180.00	0.03
210	300320	海达股份	7,800	74,880.00	0.03
211	688053	思科瑞	2,624	74,259.20	0.03
212	300305	裕兴股份	13,600	74,120.00	0.03
213	002712	思美传媒	14,500	73,950.00	0.03

214	002892	科力尔	4,800	73,920.00	0.03
215	002531	天顺风能	9,300	73,563.00	0.03
216	300731	科创新源	3,400	73,474.00	0.03
217	688328	深科达	4,848	72,623.04	0.03
218	300382	斯莱克	6,700	71,958.00	0.03
219	002865	钧达股份	1,400	71,540.00	0.03
220	002202	金风科技	6,900	71,277.00	0.03
221	688202	美迪西	2,352	70,959.84	0.03
222	600893	航发动力	1,700	70,465.00	0.03
223	301257	普蕊斯	2,600	70,096.00	0.02
224	301333	诺思格	1,400	69,986.00	0.02
225	603121	华培动力	6,300	69,489.00	0.02
226	002517	恺英网络	5,100	69,411.00	0.02
227	002466	天齐锂业	2,100	69,300.00	0.02
228	300418	昆仑万维	1,800	69,264.00	0.02
229	603185	弘元绿能	4,200	68,250.00	0.02
230	603800	洪田股份	2,700	68,175.00	0.02
231	002460	赣锋锂业	1,900	66,519.00	0.02
232	003003	天元股份	6,900	66,309.00	0.02
233	688669	聚石化学	4,266	65,867.04	0.02
234	003002	壶化股份	2,900	65,424.00	0.02
235	301037	保立佳	6,300	64,953.00	0.02
236	603709	中源家居	5,960	64,785.20	0.02
237	300955	嘉亨家化	4,100	64,780.00	0.02
238	300118	东方日升	5,400	64,692.00	0.02
239	002664	信质集团	4,600	64,676.00	0.02
240	301081	严牌股份	7,600	64,448.00	0.02
241	603160	汇顶科技	800	64,432.00	0.02
242	688096	京源环保	8,626	64,349.96	0.02
243	603903	中持股份	10,000	64,300.00	0.02
244	688466	金科环境	4,730	64,091.50	0.02
245	688501	青达环保	4,568	64,089.04	0.02
246	688265	南模生物	2,768	63,996.16	0.02
247	688718	唯赛勃	6,399	63,990.00	0.02
248	688156	路德环境	4,723	63,902.19	0.02
249	688081	兴图新科	4,058	63,872.92	0.02
250	001366	播恩集团	6,100	63,867.00	0.02
251	603506	南都物业	7,500	63,825.00	0.02
252	301098	金埔园林	8,000	63,600.00	0.02
253	600883	博闻科技	9,700	63,535.00	0.02
254	603022	新通联	8,700	63,510.00	0.02
255	688193	仁度生物	1,775	63,456.25	0.02
256	002921	联诚精密	5,800	63,452.00	0.02
257	301167	建研设计	5,000	63,450.00	0.02

258	002910	庄园牧场	8,400	63,252.00	0.02
259	300877	金春股份	4,500	63,225.00	0.02
259	600137	浪莎股份	4,500	63,225.00	0.02
261	688067	爱威科技	3,779	63,184.88	0.02
262	605287	德才股份	5,200	63,180.00	0.02
263	300804	广康生化	2,800	63,168.00	0.02
263	603172	万丰股份	4,800	63,168.00	0.02
265	688255	凯尔达	2,362	63,089.02	0.02
266	300517	海波重科	7,500	63,075.00	0.02
267	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.02
268	301234	五洲医疗	2,500	62,875.00	0.02
269	001210	金房能源	4,500	62,865.00	0.02
270	002842	翔鹭钨业	10,100	62,721.00	0.02
271	688671	碧兴物联	3,713	62,712.57	0.02
272	002809	红墙股份	7,900	62,647.00	0.02
273	001259	利仁科技	2,900	62,640.00	0.02
273	688021	奥福环保	6,000	62,640.00	0.02
275	600493	凤竹纺织	12,100	62,557.00	0.02
276	300535	达威股份	4,800	62,544.00	0.02
277	001202	炬申股份	4,500	62,505.00	0.02
278	688350	富淼科技	4,950	62,469.00	0.02
279	002830	名雕股份	5,000	62,450.00	0.02
280	603918	金桥信息	4,900	62,328.00	0.02
281	688508	芯朋微	1,450	62,306.50	0.02
282	688335	复洁环保	7,390	62,297.70	0.02
283	002494	华斯股份	15,600	62,244.00	0.02
284	300658	延江股份	12,000	62,160.00	0.02
285	688393	安必平	3,590	62,142.90	0.02
286	301131	聚赛龙	1,800	62,100.00	0.02
287	300886	华业香料	3,300	62,007.00	0.02
288	688565	力源科技	10,756	61,954.56	0.02
289	688607	康众医疗	4,661	61,758.25	0.02
290	001231	农心科技	3,700	61,753.00	0.02
291	301300	远翔新材	2,400	61,752.00	0.02
292	300995	奇德新材	3,900	61,659.00	0.02
293	002828	贝肯能源	7,200	61,632.00	0.02
294	002898	赛隆药业	6,400	61,568.00	0.02
295	301227	森鹰窗业	3,800	61,560.00	0.02
296	001336	楚环科技	3,500	61,530.00	0.02
297	002658	雪迪龙	9,600	61,440.00	0.02
298	688069	德林海	4,087	61,386.74	0.02
299	603073	彩蝶实业	4,200	61,362.00	0.02
300	002883	中设股份	6,020	61,343.80	0.02
301	300717	华信新材	4,400	61,292.00	0.02

302	301057	汇隆新材	4,900	61,250.00	0.02
303	605567	春雪食品	6,800	61,200.00	0.02
304	603045	福达合金	4,800	61,152.00	0.02
305	600448	华纺股份	23,000	60,950.00	0.02
306	301192	泰祥股份	3,500	60,935.00	0.02
307	300920	润阳科技	3,600	60,912.00	0.02
308	300749	顶固集创	9,900	60,885.00	0.02
309	688679	通源环境	5,798	60,879.00	0.02
310	600768	宁波富邦	7,100	60,847.00	0.02
311	301372	科净源	3,000	60,810.00	0.02
312	003011	海象新材	4,000	60,800.00	0.02
313	301113	雅艺科技	2,600	60,788.00	0.02
314	688511	天微电子	3,903	60,769.71	0.02
315	603458	勘设股份	10,500	60,690.00	0.02
316	000929	兰州黄河	8,700	60,639.00	0.02
317	300929	华骐环保	7,300	60,371.00	0.02
318	300207	欣旺达	2,700	60,237.00	0.02
319	300948	冠中生态	6,400	60,224.00	0.02
320	688011	新光光电	3,928	60,176.96	0.02
321	605033	美邦股份	5,000	60,150.00	0.02
322	603151	邦基科技	6,000	60,060.00	0.02
323	300854	中兰环保	4,900	59,878.00	0.02
324	000633	合金投资	13,500	59,805.00	0.02
325	301288	清研环境	3,900	59,787.00	0.02
326	002836	新宏泽	8,100	59,616.00	0.02
327	003017	大洋生物	3,200	59,584.00	0.02
328	000632	三木集团	16,200	59,454.00	0.02
329	300871	回盛生物	5,900	59,354.00	0.02
330	688058	宝兰德	2,154	59,235.00	0.02
331	605255	天普股份	4,700	59,173.00	0.02
332	300769	德方纳米	1,600	59,008.00	0.02
333	688670	金迪克	4,854	58,830.48	0.02
334	300614	百川畅银	6,200	58,776.00	0.02
335	002718	友邦吊顶	4,800	58,704.00	0.02
336	300445	康斯特	3,600	58,572.00	0.02
337	300651	金陵体育	4,600	58,236.00	0.02
338	603127	昭衍新药	3,500	58,205.00	0.02
339	603272	联翔股份	4,200	57,792.00	0.02
340	603688	石英股份	2,000	57,460.00	0.02
341	688386	泛亚微透	1,890	57,115.80	0.02
342	688217	睿昂基因	3,066	56,537.04	0.02
343	300073	当升科技	1,400	56,392.00	0.02
344	301168	通灵股份	2,100	56,343.00	0.02
345	688283	坤恒顺维	2,288	56,330.56	0.02

346	688182	灿勤科技	3,129	55,946.52	0.02
347	000997	新大陆	2,800	55,860.00	0.02
348	002373	千方科技	5,500	55,770.00	0.02
349	300953	震裕科技	800	55,712.00	0.02
350	301368	丰立智能	1,200	55,380.00	0.02
351	688056	莱伯泰科	1,885	54,966.60	0.02
352	603721	中广天择	2,100	54,747.00	0.02
353	300223	北京君正	800	54,560.00	0.02
354	001330	博纳影业	8,900	54,557.00	0.02
355	300884	狄耐克	4,800	53,664.00	0.02
356	301150	中一科技	2,500	53,600.00	0.02
357	688591	泰凌微	1,700	53,380.00	0.02
358	300690	双一科技	2,300	52,003.00	0.02
359	301308	江波龙	600	51,600.00	0.02
360	300014	亿纬锂能	1,100	51,414.00	0.02
361	688023	安恒信息	1,260	51,408.00	0.02
362	603396	金辰股份	1,900	51,110.00	0.02
363	300706	阿石创	2,100	50,505.00	0.02
364	688499	利元亨	2,242	50,153.54	0.02
365	000537	中绿电	5,400	49,248.00	0.02
366	300842	帝科股份	1,200	49,224.00	0.02
367	001339	智微智能	1,300	47,567.00	0.02
368	300559	佳发教育	3,900	46,644.00	0.02
369	002908	德生科技	5,300	46,428.00	0.02
370	688345	博力威	2,552	46,369.84	0.02
371	688489	三未信安	1,344	46,368.00	0.02
372	301018	申菱环境	1,200	46,248.00	0.02
373	301255	通力科技	1,400	46,060.00	0.02
374	603507	振江股份	1,900	45,676.00	0.02
375	300537	广信材料	2,300	45,494.00	0.02
376	688601	力芯微	1,095	45,365.85	0.02
377	300659	中孚信息	2,800	45,332.00	0.02
378	002882	金龙羽	2,800	45,024.00	0.02
379	688733	壹石通	2,312	43,696.80	0.02
380	603659	璞泰来	2,700	42,957.00	0.02
381	600636	国新文化	4,600	42,688.00	0.02
382	300549	优德精密	2,500	40,950.00	0.01
383	300531	优博讯	2,900	40,455.00	0.01
384	000021	深科技	2,100	40,026.00	0.01
385	605166	聚合顺	3,300	39,501.00	0.01
386	688719	爱科赛博	1,354	38,318.20	0.01
387	603330	天洋新材	6,000	38,040.00	0.01
388	002273	水晶光电	1,700	37,774.00	0.01
389	301099	雅创电子	900	37,305.00	0.01

390	300433	蓝思科技	1,700	37,230.00	0.01
391	300700	岱勒新材	4,200	36,876.00	0.01
392	605399	晨光新材	3,100	36,208.00	0.01
393	600237	铜峰电子	5,300	34,715.00	0.01
394	002988	豪美新材	1,600	33,872.00	0.01
395	300569	天能重工	6,800	33,864.00	0.01
396	301117	佳缘科技	1,100	33,693.00	0.01
397	605366	宏柏新材	6,200	33,604.00	0.01
398	688449	联芸科技	1,110	32,678.40	0.01
399	300648	星云股份	1,400	32,200.00	0.01
400	601858	中国科传	1,500	30,570.00	0.01
401	688728	格科微	2,169	29,151.36	0.01
402	601615	明阳智能	2,300	29,003.00	0.01
403	688387	信科移动	4,857	28,947.72	0.01
404	300803	指南针	300	28,785.00	0.01
405	688173	希荻微	2,531	28,043.48	0.01
406	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.01
407	688201	信安世纪	3,111	27,470.13	0.01
408	605133	嵘泰股份	1,100	25,883.00	0.01
409	688750	金天钛业	1,639	25,306.16	0.01
410	300696	爱乐达	1,600	24,848.00	0.01
411	688708	佳驰科技	489	23,936.55	0.01
412	301040	中环海陆	1,900	23,541.00	0.01
413	600155	华创云信	3,100	22,940.00	0.01
414	600765	中航重机	1,000	20,470.00	0.01
415	300450	先导智能	1,000	20,020.00	0.01
416	301522	上大股份	765	19,002.60	0.01
417	002409	雅克科技	300	17,385.00	0.01
418	300263	隆华科技	2,300	16,790.00	0.01
419	003038	鑫铂股份	1,000	16,580.00	0.01
420	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.01
421	300082	奥克股份	2,400	15,048.00	0.01
422	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
423	002149	西部材料	800	14,160.00	0.01
424	002997	瑞鹄模具	400	13,860.00	0.00
425	300316	晶盛机电	400	12,760.00	0.00
426	301261	恒工精密	300	12,414.00	0.00
427	603200	上海洗霸	500	12,135.00	0.00
428	600498	烽火通信	600	11,676.00	0.00
429	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
430	688710	益诺思	326	10,947.08	0.00
431	300671	富满微	300	10,662.00	0.00
432	301631	壹连科技	102	10,399.92	0.00
433	301603	乔锋智能	208	8,731.84	0.00



1	002139	拓邦股份	4,458,193.00	1.64
2	601677	明泰铝业	3,921,737.00	1.44
3	688578	艾力斯	3,656,866.79	1.35
4	603236	移远通信	3,612,544.66	1.33
5	300476	胜宏科技	3,576,016.00	1.32
6	300002	神州泰岳	3,526,885.00	1.30
7	002906	华阳集团	3,239,942.00	1.19
8	002617	露笑科技	3,233,274.00	1.19
9	000034	神州数码	3,206,633.00	1.18
10	301078	孩子王	3,179,562.00	1.17
11	000528	柳工	3,167,130.00	1.17
12	300049	福瑞股份	3,137,696.00	1.16
13	300170	汉得信息	3,099,858.00	1.14
14	300133	华策影视	3,086,527.00	1.14
15	601949	中国出版	3,086,325.00	1.14
16	002245	蔚蓝锂芯	3,030,283.00	1.12
17	688019	安集科技	3,026,219.74	1.11
18	002777	久远银海	3,024,161.00	1.11
19	600110	诺德股份	3,013,096.00	1.11
20	000917	电广传媒	2,986,243.00	1.10

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	300762	上海瀚讯	4,107,468.00	1.51
2	601677	明泰铝业	4,045,105.76	1.49
3	300476	胜宏科技	3,961,810.00	1.46
4	002402	和而泰	3,910,458.00	1.44
5	688578	艾力斯	3,838,777.45	1.41
6	603236	移远通信	3,824,723.00	1.41
7	601137	博威合金	3,725,545.00	1.37
8	300133	华策影视	3,700,973.00	1.36
9	300002	神州泰岳	3,695,437.00	1.36
10	002139	拓邦股份	3,653,432.00	1.35
11	600577	精达股份	3,512,984.00	1.29
12	002245	蔚蓝锂芯	3,468,310.00	1.28
13	000681	视觉中国	3,419,963.00	1.26
14	300679	电连技术	3,409,488.00	1.26
15	002960	青鸟消防	3,326,445.92	1.23

16	000801	四川九洲	3,235,267.00	1.19
17	600120	浙江东方	3,228,197.00	1.19
18	603936	博敏电子	3,226,794.00	1.19
19	688389	普门科技	3,190,384.99	1.17
20	000034	神州数码	3,154,624.00	1.16

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	1,423,701,410.10
卖出股票收入（成交）总额	1,433,653,699.33

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	101,446.05	0.04
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	101,446.05	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	019723	23 国债 20	1,000	101,446.05	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 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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	667,238.82

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	667,238.82

#### 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 1000 量化增强 A	5,695	27,756.99	47,696,970.70	30.17%	110,379,098.33	69.83%
易方达中证 1000 量化增强 C	1,907	63,167.49	13,949,687.46	11.58%	106,510,717.19	88.42%
合计	7,602	36,639.89	61,646,658.16	22.13%	216,889,815.52	77.87%

#### 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 1000 量化增强 A	820,685.01	0.5192%

	易方达中证 1000 量化增强 C	19,654.09	0.0163%
	合计	840,339.10	0.3017%

### 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 1000 量化增强 A	0
	易方达中证 1000 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 1000 量化增强 A	50~100
	易方达中证 1000 量化增强 C	0
	合计	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证 1000 量化增强 A	易方达中证 1000 量化增强 C
基金合同生效日（2023 年 4 月 25 日）基金份额总额	255,740,919.08	258,422,640.34
本报告期期初基金份额总额	155,129,390.48	138,809,044.09
本报告期基金总申购份额	166,828,868.26	200,547,851.63
减：本报告期基金总赎回份额	163,882,189.71	218,896,491.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	158,076,069.03	120,460,404.65

## § 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）更换为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本基金首次聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务，本报告年度的审计费用为 40,000.00 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
方正证券	3	1,294,153,338.84	45.33%	517,829.13	43.78%	-
平安证券	3	1,560,732,549.55	54.67%	664,901.09	56.22%	-

注：a) 本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（2024 年 7 月 1 日起失效）以及《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（2024 年 7 月 1 日起实施）中关于交易佣金分仓的规定。

b) 本基金选择的证券经纪商为平安证券股份有限公司、方正证券股份有限公司。本基金管理人与平安证券股份有限公司、方正证券股份有限公司不存在关联方关系。

c) 证券经营机构的佣金费率如下：

平安证券股份有限公司：沪深交易所 A 股普通交易佣金率为 0.06854%、大宗交易佣金率为 0.068978%（其中上海 A 股包含经手费、证管费；深圳 A 股包含经手费、证管费、过户费），北交所股票交易佣金率为 0.0575%（包含经手费），基金交易佣金率为 0.01%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，港股通股票交易佣金率为 0.063%，可转换债券交易佣金率为 0.005%，可转换债券以外的其他债券、回购交易佣金率为 0.001%（以上债券及债券回购类交易佣金均为全佣金，包含交易所规定的费用）。

方正证券股份有限公司：沪深交易所 A 股普通交易佣金率为 0.06854%、大宗交易佣金率为 0.068978%（其中上海 A 股包含经手费、证管费；深圳 A 股包含经手费、证管费、过户费），北交所股票交易佣金率为 0.0575%（包含经手费），基金交易佣金率为 0.01%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，港股通股票交易佣金率为 0.063%，可转换债券交易佣金率为 0.005%，可转换债券以外的其他债券、回购交易佣金率为 0.001%（以上债券及债券回购类交易佣金均为全佣金，包含交易所规定的费用）。

2024 年 6 月 28 日起佣金率有调整，调整后的佣金率如下：

平安证券股份有限公司：上交所 A 股交易佣金率为 0.024%（包含经手费、证管费），深交所 A 股交易佣金率为 0.025%（包含经手费、证管费、过户费），北交所股票交易佣金率为 0.024%（包含经手费），基金交易佣金率为 0.01%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，港股通股票交易佣金率为 0.0165%，债券、回购交易佣金率为 0.001%。

方正证券股份有限公司：上交所 A 股交易佣金率为 0.024%（包含经手费、证管费），深交所 A 股交易佣金率为 0.025%（包含经手费、证管费、过户费），北交所股票交易佣金率为 0.024%（包含经手费），基金交易佣金率为 0.01%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，港股通股票交易佣金率为 0.0165%，可转换债券交易佣金率为 0.005%，可转换债券以外的其他债券、回购交易佣金率为 0.001%（以上债券及债券回购类交易佣金均为全佣金，包含交易所规定的费用）。

d) 本基金管理人负责选择证券经营机构，本报告期内选择标准有调整，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。

e) 本报告期内基金的证券经营机构的选择程序如下：

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经纪服务协议。

f) 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，报告的主要内容为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
方正证券	138,144.02	43.01%	-	-	-	-
平安证券	183,032.80	56.99%	-	-	-	-

#### 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
2	关于易方达中证 1000 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
3	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	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

	投资业务的提示性公告		
4	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
5	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
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	2024-04-23
7	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
8	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
9	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
10	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
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	中国证券报	2024-08-30
12	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
13	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
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	2024-10-21
15	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
16	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
17	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
18	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2024-12-19

	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	金电子披露网站	
--	---------------------------------	---------	--

## § 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 1000 指数量化增强型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达中证 1000 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