

# 易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告期自 2023 年 4 月 25 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 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 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	18
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	81
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 .....	81
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 .....	81
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 .....	82
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 .....	82
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	82
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	82
8.12	投资组合报告附注 .....	82
<b>§ 9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>83</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	83
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
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 .....	83
<b>§ 10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>84</b>
<b>§ 11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>84</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	84
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 .....	84
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	85
11.4	基金投资策略的改变 .....	85
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	85
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 .....	85
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	85
11.8	其他重大事件 .....	87
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>88</b>
12.1	备查文件目录 .....	88
12.2	存放地点 .....	88
12.3	查阅方式 .....	88

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 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	293,938,434.57 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	155,129,390.48 份	138,809,044.09 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	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	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	www.efunds.com.cn

网网址	
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 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
本期已实现收益	-11,613,541.43	-10,411,618.18
本期利润	-12,410,700.93	-11,388,613.05
加权平均基金份额本期利润	-0.0651	-0.0651
本期加权平均净值利润率	-6.74%	-6.73%
本期基金份额净值增长率	-7.50%	-7.76%
3.1.2 期末数据和指标	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
期末可供分配利润	-11,639,975.48	-10,768,254.07
期末可供分配基金份额利润	-0.0750	-0.0776
期末基金资产净值	143,489,415.00	128,040,790.02
期末基金份额净值	0.9250	0.9224
3.1.3 累计期末指标	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
基金份额累计净值增长率	-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	-1.88%	1.00%	-2.98%	0.98%	1.10%	0.02%
过去六个月	-8.08%	0.94%	-10.28%	0.95%	2.20%	-0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.50%	0.82%	-11.83%	0.93%	4.33%	-0.11%

##### 易方达中证 1000 量化增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.99%	1.00%	-2.98%	0.98%	0.99%	0.02%
过去六个月	-8.26%	0.94%	-10.28%	0.95%	2.02%	-0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.76%	0.82%	-11.83%	0.93%	4.07%	-0.11%

#### 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

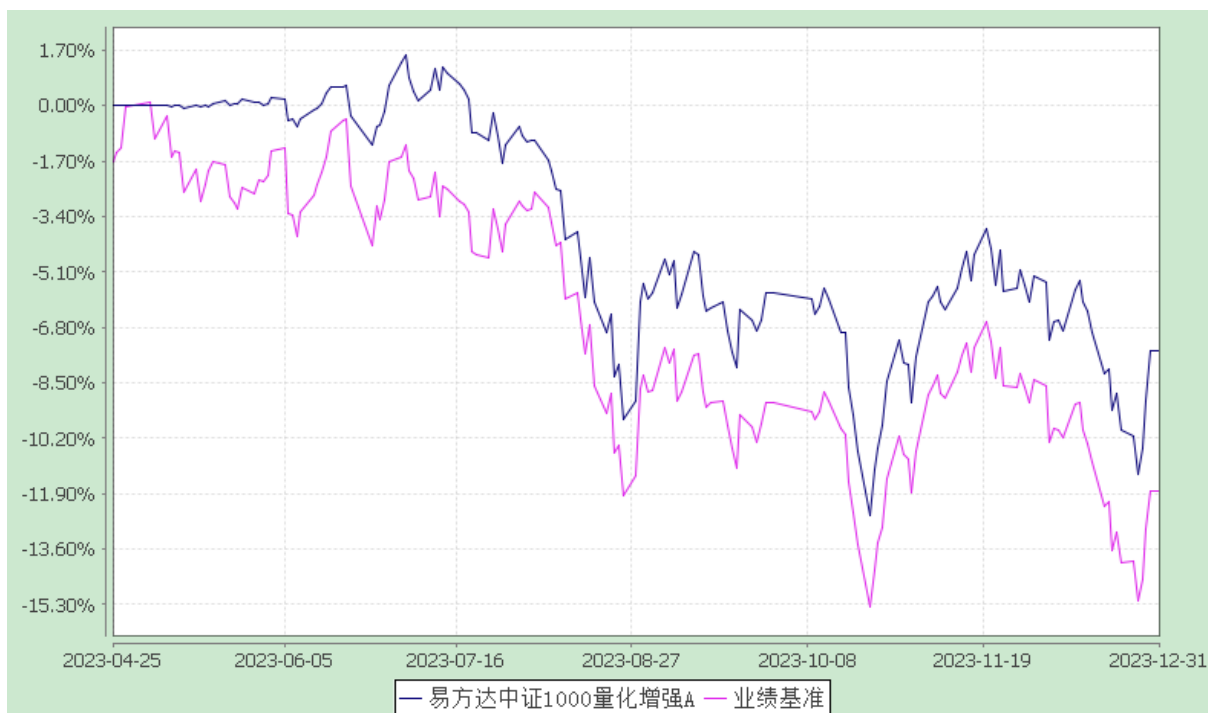
易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金

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

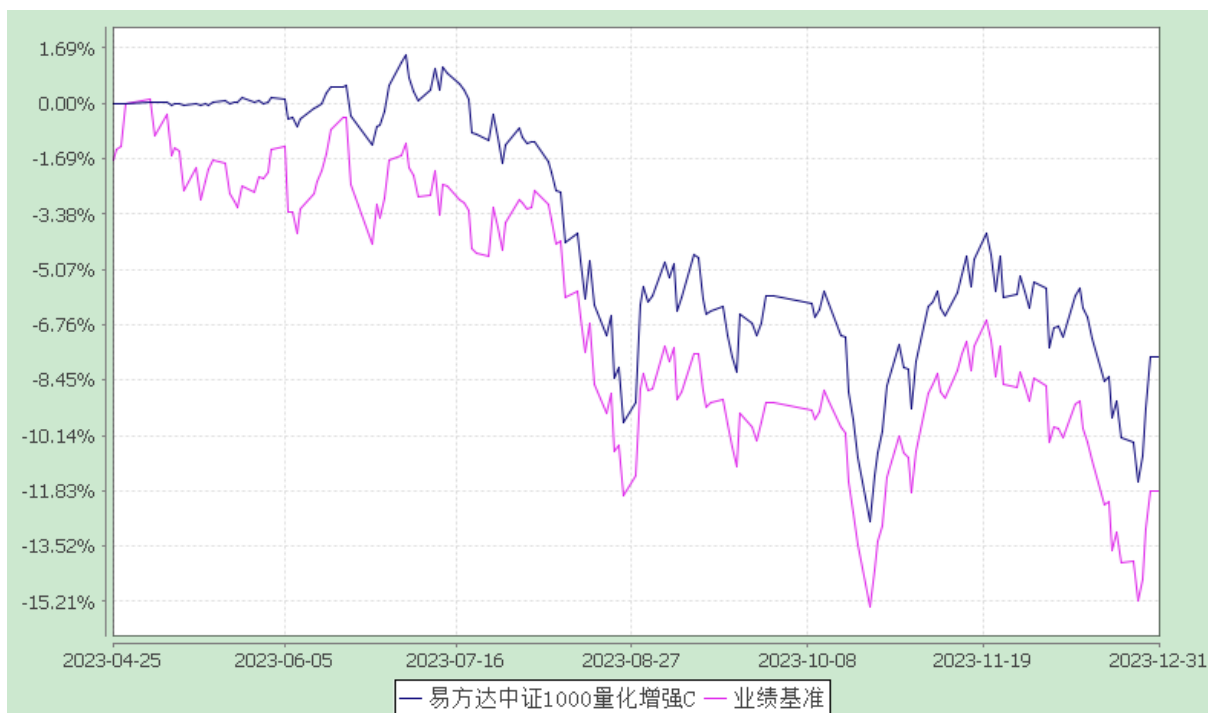
(2023 年 4 月 25 日至 2023 年 12 月 31 日)

##### 易方达中证 1000 量化增强 A





易方达中证 1000 量化增强 C



注：1.本基金合同于 2023 年 4 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

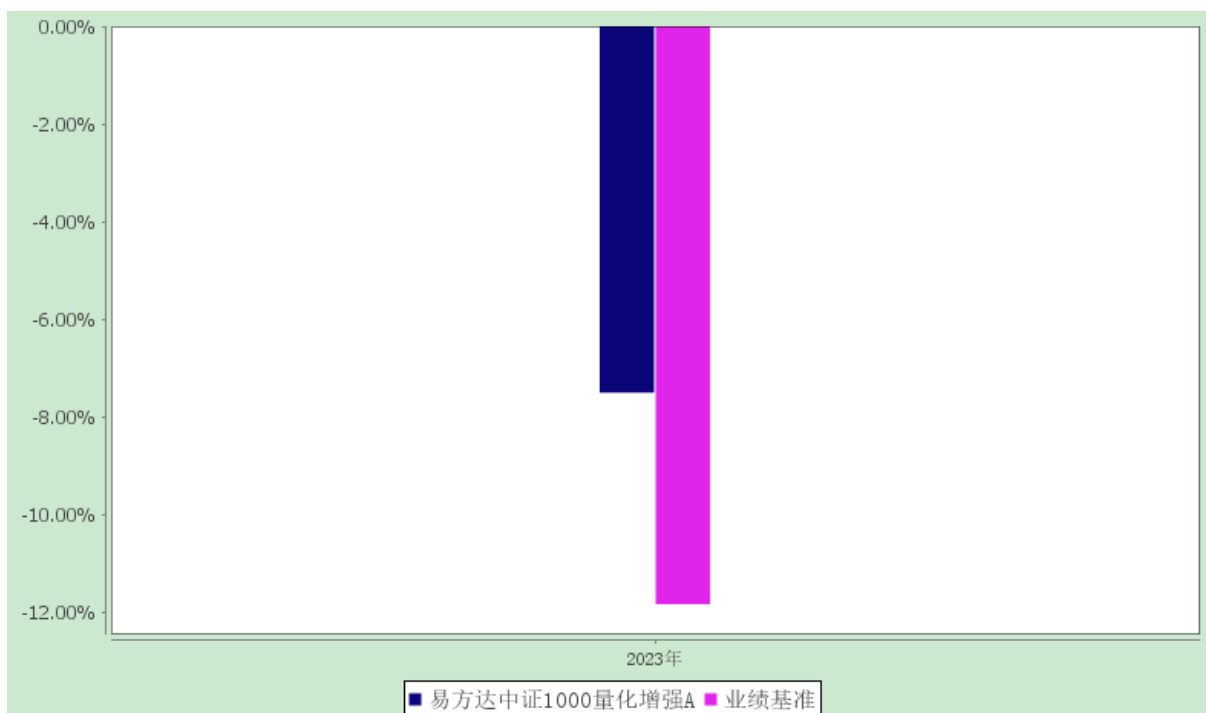
2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为-7.50%，同期业绩比较基准收益率为-11.83%；C 类基金份额净值增长率为-7.76%，同期业绩比较基准收益率为-11.83%。

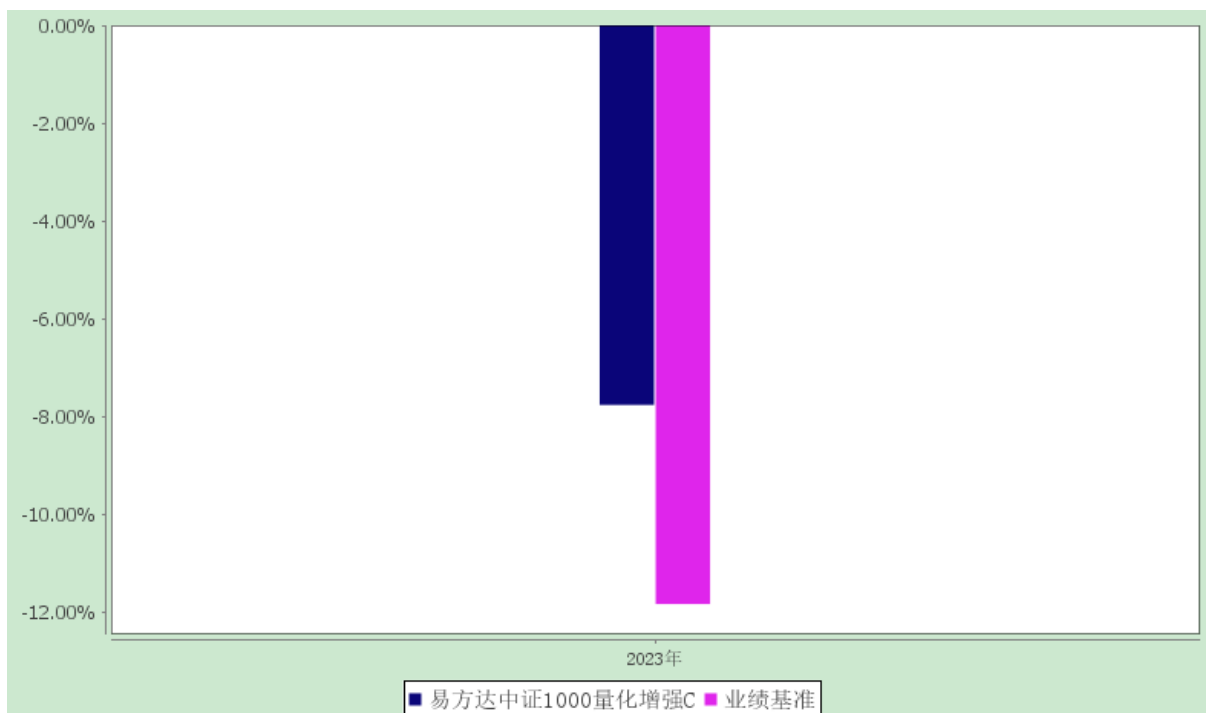
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
H U A N G J I A N S H E N G ( 黄 健 生 )	本基金的基金经理,易方达中证 500 量化增强(自 2021 年 09 月 04 日至 2023 年 11 月 08 日)的基金经理, 量化投资决策委员会委员	2023-04-25	-	12 年	加拿大籍, 硕士研究生, 具有基金从业资格。曾任美国 Sun Microsystems 资深软件工程师, 美国 GMN Capital/ 伦敦 GSA Capital 量化投资研究员, 美国巴克莱全球投资者 (Barclays Global Investors) 量化研究员, 加拿大阿尔伯特塔投资管理公司副基金经理, 华泰柏瑞基金管理有限公司量化投资部门总监、投资经理, 易方达基金管理有限公司量化投资部总经理, 易方达量化策略精选混合、易方达沪深 300 量化增强的基金经理。
殷 明	本基金的基金经理, 易方达易百智能量化策略混合的基金经理, 量化	2023-04-25	-	7 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

	投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员			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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利

益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾本报告期，随着新冠疫情影响逐步消退，经济生活回归常态，复工复产进展良好。国内经济政策向暖、流动性偏宽松、加上汽车和商品房销售出现阶段性好转，市场对于国内经济复苏的预期较为乐观，中证 1000 指数在一季度攀升至阶段性高点。然而 4 月份以来，经济数据有所回落，失业率偏高，内需低迷，外需承压，疫后经济复苏缓慢，中证 1000 指数持续大幅调整。

在报告期内，PMI（采购经理指数）数据除在 9 月份短暂回至荣枯线上（50.2），今年基本在荣枯线下徘徊，反映制造业景气有所回落。内需订单没有改善，而出口订单持续回落，需求端压力较大。在保交楼、限购放宽等政策指导下，房地产销售和竣工在三季度有较好表现，一、二线新房和二手房销售较好。但政策宽松的脉冲作用有所放缓，由于高库存和二手住宅挂盘的影响，四季度房产价格有下行压力。反映在价格指数上，CPI（消费者物价指数）和 PPI（生产者物价指数）也是持续回落的。面临经济压力，货币和财政政策多方发力，多次降准降息，保持流动性宽松。推动城中村改造，促进就业、生产和消费，反映政府呵护经济和民生决心。海外经济面临诸多不确定性，地缘政治冲突导致能源价格上升，通货膨胀上升，多个央行开始加息周期，抑制实体需求，增加融资成本，反映到国内是外需承压，但中国出口的全球份额依然高于疫情前，对美国和欧盟等的份额回落，而对东盟和拉美等份额上升更多。

国际方面，地缘政治冲突、美国大选临近等因素都会带来较大不确定性，成为影响资本市场的重要因素，全球经济存在衰退风险，出口可能承压。

国内方面，10 月社融新增 1.85 万亿，存量同比增速 9.3%，而 11 月增速 9.4%，主要源于政府融资发力，有力支持后续增量财政政策的落地，带动经济复苏。进入 12 月，看到建筑业景气回升，房建和土建均有起色，叠加因城施策的更多政策落地以及财政资金开始拨付，可预期下年地产会有较好回暖的可能。当下经济复苏处于蓄势待发的状态，随着经济回暖，市场信心和消费需求提升，市场有望走出底部拐点，实现价值回归。

我们继续从自上而下以及自下而上两个角度进行深入研究，通过量化模型紧密跟踪相关数据，快速灵活地做出投资决策。同时，我们依然坚持在大数据、机器学习、另类数据中的深入研究，充分利用另类因子和市场因子对选股模型进行增强，通过事件驱动策略等更加多样化的策略进一步优化模型，不断做好模型迭代。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 0.9250 元，本报告期份额净值增长率为-7.50%，同期业绩比较基准收益率为-11.83%；C 类基金份额净值为 0.9224 元，本报告期份额净值增长率为-7.76%，同期业绩比较基准收益率为-11.83%，年化跟踪误差 5.85%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从市场风格层面展望 2024 年，我们认为市场可能存在一些新的变化。具体来说，在当前宏观环境没有重大变化的情况下，过去三年大盘和小盘风格累计的超额收益可能会出现阶段性收敛。小盘和低流动性风格底层是以支付流动性溢价获得超额收益，但一旦市场反转，小盘资金更难撤出，会支付昂贵的流动性成本。因此，我们认为小盘风格需要密切关注。另一方面，在市场预期极低的情况下，如果宏观经济层面能看到一些有利的变化，那么成长和价值风格也有望出现阶段性收敛。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

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

业生态环境。

(2) 持续完善投资合规监控手段, 协同投资、研究、交易等业务部门完善相应的内控机制, 共同巩固投资合规内控防线。升级风控系统, 提升投资合规监控工作效能, 有效保障各类资产组合的合规运作。持续加强关联交易、公平交易、异常交易和内幕交易等监测管控机制, 保护投资者利益。

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

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达中证 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 2023 年 4 月 25 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。



## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 24456 号

易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### (一)我们审计的内容

我们审计了易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

#### (二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

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

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证 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。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达中证 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。

#### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

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

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

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

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

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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

赵珏 成磊

中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	16,028,890.45
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	255,369,543.76
其中：股票投资		255,205,536.22
基金投资		-
债券投资		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		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>272,176,128.65</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 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		322,242.39
应付管理人报酬		185,054.03
应付托管费		34,697.65
应付销售服务费		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	60,000.00
<b>负债合计</b>		<b>645,923.63</b>
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	293,938,434.57
未分配利润	7.4.7.8	-22,408,229.55
<b>净资产合计</b>		<b>271,530,205.02</b>
<b>负债和净资产总计</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。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 0.9250 元，C 类基金份额净值 0.9224 元；基金份额总额 293,938,434.57 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 155,129,390.48 份，C 类基金份额总额 138,809,044.09 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：2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		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>-20,961,957.10</b>
1.利息收入		1,327,825.55
其中：存款利息收入	7.4.7.9	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）		-20,542,213.47
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-22,104,973.81
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	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	-
股利收益	7.4.7.14	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	-1,774,154.37
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	26,585.19
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,837,356.88</b>
1. 管理人报酬		1,942,538.80
2. 托管费		364,226.02
3. 销售服务费		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		0.02
8. 其他费用	7.4.7.18	65,708.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</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>-23,799,313.98</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</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。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

单位：人民币元

项目	本期 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、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-220,225,124.85	-22,408,229.55	-242,633,354.40
（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。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：王永铨

## 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。

本基金募集期间为 2023 年 4 月 10 日至 2023 年 4 月 21 日，募集金额总额为人民币 514,163,559.42 元，其中：有效净认购金额为人民币 514,036,328.35 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 127,231.07 元，经安永华明（2023）验字第 60468000\_G15 号验资报告予以审验。

### 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，惟本会计年度期间为 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

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

###### 以摊余成本计量：

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



为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用

损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

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

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

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资

流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	11,355,465.57
等于：本金	11,354,682.78
加：应计利息	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	4,673,424.88
等于：本金	4,673,147.16
加：应计利息	277.72
合计	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 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

本基金本报告期末无其他资产。

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023 年 12 月 31 日	
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		60,000.00
合计		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	
	2023年4月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	255,740,919.08	255,740,919.08
本期申购	23,461,214.18	23,461,214.18
本期赎回（以“-”号填列）	-124,072,742.78	-124,072,742.78
本期末	155,129,390.48	155,129,390.48

易方达中证 1000 量化增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年4月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	258,422,640.34	258,422,640.34



本期申购	13,147,300.28	13,147,300.28
本期赎回（以“-”号填列）	-132,760,896.53	-132,760,896.53
本期末	138,809,044.09	138,809,044.09

注：1.本基金合同于 2023 年 4 月 25 日生效，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。

2.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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-11,613,541.43	-797,159.50	-12,410,700.93
本期基金份额交易产生的变动数	911,845.86	-141,120.41	770,725.45
其中：基金申购款	-1,101,478.38	-307,428.52	-1,408,906.90
基金赎回款	2,013,324.24	166,308.11	2,179,632.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,701,695.57	-938,279.91	-11,639,975.48

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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-10,411,618.18	-976,994.87	-11,388,613.05
本期基金份额交易产生的变动数	484,068.95	136,290.03	620,358.98
其中：基金申购款	-709,560.47	-10,265.08	-719,825.55
基金赎回款	1,193,629.42	146,555.11	1,340,184.53
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-9,927,549.23	-840,704.84	-10,768,254.07
-----	---------------	-------------	----------------

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	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	34,598.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	22,785.16
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	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
	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	-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	-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
	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	1,590,830,539.13
减：卖出股票成本总额	1,609,356,481.18
减：交易费用	3,579,031.76
买卖股票差价收入	-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
----	----

	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	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	-
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	7.33

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	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	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	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
	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	-1,774,154.37
——股票投资	-1,774,154.37
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——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	-1,774,154.37

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	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	26,576.56
其他	8.63
合计	26,585.19

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年4月25日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	4,908.94
其他	800.00
合计	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
	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	1,942,538.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	774,159.34
应支付基金管理人的净管理费	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
	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	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		
	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	易方达中证 1000 量化增强 C	合计

	A		
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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达中证 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 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
中国农业银行-活期存款	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

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001326	联域股份	2023-11-01	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
301251	威尔	2023-08-30	6 个月	新股	28.88	34.59	299	8,635.12	10,342.41	-



	高			流通受限						
301272	英华特	2023-07-06	6 个月	新股流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301329	信音电子	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6 个月	新股流通受限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6 个月	新股流通受限	55.68	37.58	203	11,303.04	7,628.74	-
301372	科净源	2023-08-03	6 个月	新股流通受限	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6 个月	新股流通受限	67.68	59.37	201	13,603.68	11,933.37	-
301413	安培龙	2023-12-11	6 个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6 个月	新股流通受限	51.88	50.20	186	9,649.68	9,337.20	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301469	恒达新材	2023-08-10	6 个月	新股流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股流通受限	57.66	47.25	369	21,276.54	17,435.25	-
301487	盟固利	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-

301489	思泉新材	2023-10-16	6 个月	新股 流通 受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6 个月	新股 流通 受限	39.99	38.81	292	11,677.08	11,332.52	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6 个月	新股 流通 受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023-08-24	6 个月	新股 流通 受限	10.00	15.85	712	7,120.00	11,285.20	-
301508	中机认检	2023-11-23	6 个月	新股 流通 受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固高科技	2023-08-04	6 个月	新股 流通 受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301516	中远通	2023-12-01	6 个月	新股 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6 个月	新股 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023-07-26	6 个月	新股 流通 受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6 个月	新股 流通 受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	新股 流通 受限	67.88	52.74	122	8,281.36	6,434.28	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6 个月	新股 流通 受限	99.57	81.46	93	9,260.01	7,575.78	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	4,816	12,810.56	21,431.20	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	新股 流通 受限	71.80	68.91	135	9,693.00	9,302.85	-
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	新股 流通	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-

				受限						
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	新股 流通 受限	66.80	58.99	105	7,014.00	6,193.95	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	新股 流通 受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023-09-21	6 个月	新股 流通 受限	7.33	13.40	1,128	8,268.24	15,115.20	-
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新股 流通 受限	24.22	18.24	372	9,009.84	6,785.28	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股 流通 受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新股 流通 受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	新股 流通 受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6 个月	新股 流通 受限	11.25	11.07	480	5,400.00	5,313.60	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6 个月	新股 流通 受限	1.70	4.06	2,424	4,120.80	9,841.44	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6 个月	新股 流通 受限	16.80	31.19	164	2,755.20	5,115.16	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新股 流通 受限	58.08	57.81	73	4,239.84	4,220.13	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新股 流通 受限	23.10	23.31	140	3,234.00	3,263.40	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月	新股 流通 受限	14.23	18.19	220	3,130.60	4,001.80	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	新股 流通 受限	15.32	23.87	204	3,125.28	4,869.48	-
603193	润本	2023-10-09	6 个月	新股	17.38	16.66	206	3,580.28	3,431.96	-

	股份			流通受限						
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月	新股流通受限	21.29	21.53	134	2,852.86	2,885.02	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	168	3,657.36	4,969.44	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	新股流通受限	80.80	77.75	158	12,766.40	12,284.50	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新股流通受限	9.87	12.75	1,417	13,985.79	18,066.75	-
688573	信宇人	2023-08-09	6 个月	新股流通受限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	38.67	580	15,509.20	22,428.60	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6 个月	新股流通受限	24.98	28.02	462	11,540.76	12,945.24	-
688592	司南导航	2023-08-07	6 个月	新股流通受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,063	9,205.58	11,756.78	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新股流通受限	47.29	37.97	219	10,356.51	8,315.43	-

688627	精智达	2023-07-11	6 个月	新股 流通 受限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6 个月	新股 流通 受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新股 流通 受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	新股 流通 受限	31.95	52.25	247	7,891.65	12,905.75	-
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股 流通 受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	新股 流通 受限	103.40	78.23	77	7,961.80	6,023.71	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新股 流通 受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6 个月	新股 流通 受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新股 流通 受限	42.66	48.18	206	8,787.96	9,925.08	-
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月	新股 流通 受限	29.66	36.39	233	6,910.78	8,478.87	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	新股 流通 受限	69.98	60.10	130	9,097.40	7,813.00	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月	新股 流通 受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博 23 转债	2023-12-25	1 个月内（含）	新发流通	100.00	100.00	1,640	164,000.00	164,007.54	-

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

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
000801	四川九洲	2023-12-21	重大事项停牌	7.70	2024-01-05	8.47	147,900	1,221,487.40	1,138,830.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金为股票型基金，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风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.06%。

##### 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 2023年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末
--------	-----

	2023年12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

## 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

## 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	164,007.54
未评级	0.00
合计	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、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00



合计	0.00
----	------

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	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

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
----	-------------------------

	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	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	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 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	13,524,853.13
	2.业绩比较基准下降 5%	-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 2023 年 12 月 31 日
第一层次	253,344,604.91
第二层次	1,302,837.54
第三层次	722,101.31
合计	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 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	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	255,205,536.22	93.76
	其中：股票	255,205,536.22	93.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	164,007.54	0.06
	其中：债券	164,007.54	0.06
	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	16,028,890.45	5.89
8	其他各项资产	777,694.44	0.29
9	合计	272,176,128.65	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	-	-
B	采矿业	3,021,339.00	1.11
C	制造业	134,809,127.81	49.65

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,616,782.00	2.44
E	建筑业	5,361,023.00	1.97
F	批发和零售业	7,277,208.99	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	6,567,255.00	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,270,722.60	9.31
J	金融业	3,326,439.00	1.23
K	房地产业	2,181,994.00	0.80
L	租赁和商务服务业	1,645,863.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	1,719,076.73	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	3,621,283.00	1.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,504,525.00	0.55
R	文化、体育和娱乐业	4,544,160.00	1.67
S	综合	-	-
	合计	207,466,799.13	76.41

#### 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	55,232.00	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	33,219,355.58	12.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	816,431.00	0.30
E	建筑业	312,879.00	0.12
F	批发和零售业	86,258.60	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	60,223.60	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,850,252.94	2.52
J	金融业	-	-
K	房地产业	80,283.00	0.03
L	租赁和商务服务业	184,956.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	2,760,406.54	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,118,056.83	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	54,670.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,139,732.00	0.79
S	综合	-	-
	合计	47,738,737.09	17.58

### 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	300323	华灿光电	198,500	1,453,020.00	0.54
2	002063	远光软件	226,700	1,401,006.00	0.52
3	600711	盛屯矿业	322,700	1,400,518.00	0.52
4	002402	和而泰	96,700	1,381,843.00	0.51
5	300303	聚飞光电	230,000	1,363,900.00	0.50
6	002130	沃尔核材	179,800	1,357,490.00	0.50
7	603027	千禾味业	83,000	1,342,110.00	0.49
8	600761	安徽合力	73,700	1,342,077.00	0.49
9	603298	杭叉集团	53,600	1,333,568.00	0.49
10	600201	生物股份	123,000	1,324,710.00	0.49
11	688106	金宏气体	54,933	1,323,335.97	0.49
12	300679	电连技术	31,800	1,319,700.00	0.49
13	688556	高测股份	33,809	1,318,212.91	0.49
14	600267	海正药业	138,100	1,292,616.00	0.48
15	002171	楚江新材	172,800	1,292,544.00	0.48
16	600480	凌云股份	141,800	1,291,798.00	0.48
17	000650	仁和药业	194,400	1,288,872.00	0.47
18	002085	万丰奥威	260,800	1,288,352.00	0.47



19	688235	百济神州	9,245	1,285,424.80	0.47
20	300319	麦捷科技	132,800	1,280,192.00	0.47
21	600562	国睿科技	92,400	1,278,816.00	0.47
22	002773	康弘药业	69,100	1,274,204.00	0.47
23	000951	中国重汽	94,500	1,262,520.00	0.46
24	600552	凯盛科技	94,700	1,262,351.00	0.46
25	300762	上海瀚讯	83,600	1,260,688.00	0.46
26	002219	新里程	414,700	1,256,541.00	0.46
27	300451	创业慧康	191,100	1,251,705.00	0.46
28	600578	京能电力	422,600	1,250,896.00	0.46
29	601019	山东出版	132,900	1,246,602.00	0.46
30	600422	昆药集团	59,200	1,234,912.00	0.45
31	002061	浙江交科	337,200	1,230,780.00	0.45
32	300348	长亮科技	119,300	1,229,983.00	0.45
33	600059	古越龙山	132,100	1,228,530.00	0.45
34	300458	全志科技	54,100	1,227,529.00	0.45
35	603300	华铁应急	188,900	1,208,960.00	0.45
36	000990	诚志股份	147,100	1,207,691.00	0.44
37	600850	电科数字	55,100	1,198,425.00	0.44
38	000848	承德露露	152,400	1,196,340.00	0.44
39	603466	风语筑	83,000	1,193,540.00	0.44
40	301153	中科江南	15,200	1,189,704.00	0.44
41	300369	绿盟科技	126,100	1,189,123.00	0.44
42	300674	宇信科技	72,900	1,186,812.00	0.44
43	688403	汇成股份	112,182	1,183,520.10	0.44
44	601606	长城军工	97,100	1,182,678.00	0.44
45	600577	精达股份	285,400	1,181,556.00	0.44
46	002626	金达威	72,300	1,180,659.00	0.43
47	688676	金盘科技	32,897	1,178,699.51	0.43
48	002960	青鸟消防	85,134	1,178,254.56	0.43
49	600206	有研新材	95,000	1,177,050.00	0.43
50	002283	天润工业	200,900	1,175,265.00	0.43
51	300638	广和通	61,300	1,166,539.00	0.43
52	601137	博威合金	75,100	1,166,303.00	0.43
53	600458	时代新材	126,500	1,165,065.00	0.43
54	600645	中源协和	57,300	1,161,471.00	0.43
55	600120	浙江东方	323,500	1,161,365.00	0.43
56	000881	中广核技	160,100	1,160,725.00	0.43
57	002416	爱施德	124,700	1,158,463.00	0.43
58	002206	海利得	229,700	1,153,094.00	0.42
59	603063	禾望电气	46,100	1,152,500.00	0.42
60	300036	超图软件	55,000	1,149,500.00	0.42
61	600835	上海机电	96,400	1,144,268.00	0.42
62	300768	迪普科技	77,200	1,141,016.00	0.42

63	300183	东软载波	75,600	1,140,804.00	0.42
64	300226	上海钢联	39,980	1,139,030.20	0.42
65	000801	四川九洲	147,900	1,138,830.00	0.42
66	300627	华测导航	36,700	1,138,434.00	0.42
67	300409	道氏技术	101,900	1,135,166.00	0.42
68	002516	旷达科技	230,000	1,133,900.00	0.42
69	000597	东北制药	211,600	1,132,060.00	0.42
70	603100	川仪股份	40,800	1,130,976.00	0.42
71	600557	康缘药业	55,000	1,128,600.00	0.42
72	603229	奥翔药业	85,300	1,126,813.00	0.41
73	002649	博彦科技	91,700	1,125,159.00	0.41
74	002895	川恒股份	59,100	1,122,900.00	0.41
75	603920	世运电路	61,000	1,115,080.00	0.41
76	002048	宁波华翔	85,400	1,111,054.00	0.41
77	601952	苏垦农发	108,500	1,111,040.00	0.41
78	002859	洁美科技	44,500	1,110,275.00	0.41
79	300738	奥飞数据	104,800	1,109,832.00	0.41
80	601801	皖新传媒	159,600	1,109,220.00	0.41
81	688127	蓝特光学	47,595	1,108,487.55	0.41
82	300841	康华生物	14,200	1,101,068.00	0.41
83	600662	外服控股	229,200	1,100,160.00	0.41
84	002163	海南发展	120,900	1,097,772.00	0.40
85	603588	高能环境	167,300	1,094,142.00	0.40
86	600787	中储股份	213,200	1,087,320.00	0.40
87	000543	皖能电力	172,900	1,082,354.00	0.40
88	600966	博汇纸业	174,200	1,081,782.00	0.40
89	300065	海兰信	106,200	1,080,054.00	0.40
90	600531	豫光金铅	177,300	1,072,665.00	0.40
91	600125	铁龙物流	177,000	1,070,850.00	0.39
92	300735	光弘科技	45,300	1,066,362.00	0.39
93	600575	淮河能源	441,400	1,063,774.00	0.39
94	000966	长源电力	239,900	1,062,757.00	0.39
95	002891	中宠股份	40,300	1,061,905.00	0.39
96	300457	赢合科技	57,200	1,054,768.00	0.39
97	002302	西部建设	162,500	1,053,000.00	0.39
98	605090	九丰能源	37,700	1,052,961.00	0.39
99	002254	泰和新材	70,200	1,050,192.00	0.39
100	603187	海容冷链	69,000	1,046,040.00	0.39
101	000789	万年青	151,700	1,040,662.00	0.38
102	300130	新国都	42,700	1,033,340.00	0.38
103	603936	博敏电子	98,700	1,030,428.00	0.38
104	002351	漫步者	58,300	1,030,161.00	0.38
105	603071	物产环能	67,700	1,029,040.00	0.38
106	002051	中工国际	125,900	1,022,308.00	0.38

107	603989	艾华集团	47,500	1,022,200.00	0.38
108	603368	柳药集团	53,900	1,019,788.00	0.38
109	603171	税友股份	28,800	1,018,944.00	0.38
110	002987	京北方	54,700	1,016,326.00	0.37
111	002573	清新环境	202,800	1,003,860.00	0.37
112	000582	北部湾港	133,500	1,002,585.00	0.37
113	002053	云南能投	104,100	1,001,442.00	0.37
114	300773	拉卡拉	62,300	999,292.00	0.37
115	000829	天音控股	104,100	993,114.00	0.37
116	002913	奥士康	32,300	989,995.00	0.36
117	300894	火星人	60,900	989,016.00	0.36
118	600810	神马股份	132,300	984,312.00	0.36
119	603733	仙鹤股份	60,500	976,470.00	0.36
120	002537	海联金汇	143,800	957,708.00	0.35
121	603583	捷昌驱动	47,700	955,431.00	0.35
122	603666	亿嘉和	30,200	947,978.00	0.35
123	688389	普门科技	41,826	941,503.26	0.35
124	600284	浦东建设	148,700	936,810.00	0.35
125	000989	九芝堂	92,200	933,064.00	0.34
126	600955	维远股份	51,900	931,605.00	0.34
127	600882	妙可蓝多	56,700	911,169.00	0.34
128	603055	台华新材	74,700	899,388.00	0.33
129	601330	绿色动力	135,400	899,056.00	0.33
130	300755	华致酒行	49,100	898,039.00	0.33
131	003039	顺控发展	58,200	882,312.00	0.32
132	603093	南华期货	73,300	879,600.00	0.32
133	600223	福瑞达	87,000	837,810.00	0.31
134	600572	康恩贝	163,100	823,655.00	0.30
135	601918	新集能源	151,800	799,986.00	0.29
136	601126	四方股份	53,200	753,312.00	0.28
137	300377	赢时胜	74,400	577,344.00	0.21
138	300206	理邦仪器	48,800	498,248.00	0.18
139	002436	兴森科技	33,500	493,455.00	0.18
140	000420	吉林化纤	165,900	482,769.00	0.18
141	000686	东北证券	63,900	453,690.00	0.17
142	002237	恒邦股份	38,900	419,342.00	0.15
143	300054	鼎龙股份	16,400	396,880.00	0.15
144	600710	苏美达	55,700	394,913.00	0.15
145	002233	塔牌集团	53,600	379,488.00	0.14
146	601208	东材科技	27,400	339,212.00	0.12
147	600363	联创光电	9,900	336,600.00	0.12
148	002212	天融信	32,800	320,784.00	0.12
149	002851	麦格米特	12,300	302,580.00	0.11
150	600986	浙文互联	54,400	297,024.00	0.11

151	002249	大洋电机	57,300	284,781.00	0.10
152	600100	同方股份	38,600	283,710.00	0.10
153	002706	良信股份	31,800	280,794.00	0.10
154	002745	木林森	32,400	280,584.00	0.10
155	600446	金证股份	24,200	279,994.00	0.10
156	688033	天宜上佳	16,560	279,864.00	0.10
157	300002	神州泰岳	30,700	271,695.00	0.10
158	002421	达实智能	83,400	268,548.00	0.10
159	600478	科力远	54,400	267,648.00	0.10
160	300113	顺网科技	18,900	264,600.00	0.10
161	600797	浙大网新	40,000	262,400.00	0.10
162	600420	国药现代	26,800	262,372.00	0.10
163	000758	中色股份	58,000	261,000.00	0.10
164	603323	苏农银行	62,100	258,336.00	0.10
165	002006	精工科技	16,900	258,232.00	0.10
166	600210	紫江企业	54,700	257,090.00	0.09
167	600888	新疆众和	35,400	256,296.00	0.09
168	002214	大立科技	22,300	255,781.00	0.09
169	002258	利尔化学	21,356	255,631.32	0.09
170	002405	四维图新	28,700	255,430.00	0.09
171	000950	重药控股	51,300	254,961.00	0.09
172	600717	天津港	61,600	253,176.00	0.09
173	600361	创新新材	50,500	253,005.00	0.09
174	002434	万里扬	33,900	252,555.00	0.09
175	000090	天健集团	54,700	251,620.00	0.09
176	002545	东方铁塔	34,600	247,390.00	0.09
177	300497	富祥药业	26,400	247,104.00	0.09
178	002158	汉钟精机	11,100	247,086.00	0.09
179	000059	华锦股份	44,900	246,501.00	0.09
180	600633	浙数文化	22,100	244,426.00	0.09
181	000901	航天科技	26,000	242,320.00	0.09
182	601163	三角轮胎	16,800	242,088.00	0.09
183	600675	中华企业	76,700	241,605.00	0.09
184	603328	依顿电子	29,600	241,240.00	0.09
185	300358	楚天科技	22,500	240,750.00	0.09
186	300233	金城医药	14,400	239,904.00	0.09
187	300119	瑞普生物	14,600	239,294.00	0.09
188	603010	万盛股份	22,100	238,459.00	0.09
189	300382	斯莱克	24,000	238,320.00	0.09
190	600649	城投控股	64,300	237,910.00	0.09
191	300639	凯普生物	25,400	237,236.00	0.09
192	688232	新点软件	6,530	236,386.00	0.09
193	601969	海南矿业	35,800	235,922.00	0.09
194	603567	珍宝岛	19,400	235,904.00	0.09

195	002746	仙坛股份	33,400	235,136.00	0.09
196	002204	大连重工	51,300	234,441.00	0.09
197	002320	海峡股份	40,100	233,783.00	0.09
198	002646	天佑德酒	17,100	232,731.00	0.09
199	603718	海利生物	21,700	232,407.00	0.09
200	000062	深圳华强	20,600	232,162.00	0.09
201	600872	中炬高新	8,200	230,420.00	0.08
202	002815	崇达技术	24,000	229,920.00	0.08
203	002724	海洋王	27,800	228,516.00	0.08
204	002378	章源钨业	40,200	227,532.00	0.08
205	002677	浙江美大	22,200	224,442.00	0.08
206	002314	南山控股	77,200	223,880.00	0.08
207	002838	道恩股份	17,300	221,613.00	0.08
208	600510	黑牡丹	39,000	220,350.00	0.08
209	002651	利君股份	31,400	217,288.00	0.08
210	605009	豪悦护理	5,600	213,752.00	0.08
211	301301	川宁生物	25,400	213,360.00	0.08
212	601222	林洋能源	33,000	210,870.00	0.08
213	000761	本钢板材	58,600	209,202.00	0.08
214	601811	新华文轩	15,300	208,998.00	0.08
215	688050	爱博医疗	1,179	202,835.16	0.07
216	300133	华策影视	32,700	191,949.00	0.07
217	002145	中核钛白	42,700	191,296.00	0.07
218	002389	航天彩虹	10,164	189,050.40	0.07
219	300634	彩讯股份	9,200	188,324.00	0.07
220	300666	江丰电子	3,100	181,598.00	0.07
221	601921	浙版传媒	23,600	180,304.00	0.07
222	688596	正帆科技	4,498	178,255.74	0.07
223	002139	拓邦股份	18,200	177,632.00	0.07
224	301262	海看股份	5,700	177,555.00	0.07
225	300775	三角防务	6,300	175,770.00	0.06
226	002484	江海股份	10,900	175,054.00	0.06
227	300393	中来股份	16,900	174,746.00	0.06
228	000921	海信家电	8,500	173,400.00	0.06
229	002544	普天科技	8,500	172,720.00	0.06
230	002099	海翔药业	23,900	171,841.00	0.06
231	000035	中国天楹	34,500	170,430.00	0.06
232	601333	广深铁路	65,500	169,645.00	0.06
233	600933	爱柯迪	7,700	168,938.00	0.06
234	601678	滨化股份	40,100	168,821.00	0.06
235	600596	新安股份	18,400	167,808.00	0.06
236	000875	吉电股份	38,000	167,200.00	0.06
237	600718	东软集团	18,000	166,500.00	0.06
238	600456	宝钛股份	5,300	166,367.00	0.06

239	600110	诺德股份	29,100	164,124.00	0.06
240	000902	新洋丰	14,400	164,016.00	0.06
241	601399	国机重装	57,900	163,857.00	0.06
242	601212	白银有色	60,900	163,821.00	0.06
243	600483	福能股份	19,800	163,746.00	0.06
244	688568	中科星图	3,309	162,339.54	0.06
245	002091	江苏国泰	20,700	162,081.00	0.06
246	002807	江阴银行	45,500	161,525.00	0.06
247	002079	苏州固锴	14,300	161,304.00	0.06
248	600057	厦门象屿	23,800	159,698.00	0.06
249	000012	南玻 A	28,600	159,302.00	0.06
250	300185	通裕重工	66,300	159,120.00	0.06
251	002539	云图控股	19,200	158,400.00	0.06
252	002004	华邦健康	33,900	157,974.00	0.06
253	600216	浙江医药	14,700	157,731.00	0.06
254	688209	英集芯	8,810	157,346.60	0.06
255	000917	电广传媒	28,700	157,276.00	0.06
256	600037	歌华有线	20,300	156,919.00	0.06
257	000818	航锦科技	5,000	156,900.00	0.06
258	600063	皖维高新	36,200	155,660.00	0.06
259	688508	芯朋微	3,162	155,602.02	0.06
260	600320	振华重工	46,400	154,048.00	0.06
261	600252	中恒集团	61,300	153,863.00	0.06
262	688707	振华新材	7,458	152,889.00	0.06
263	600869	远东股份	34,700	152,333.00	0.06
264	600740	山西焦化	30,200	152,208.00	0.06
265	002467	二六三	32,800	152,192.00	0.06
266	300398	飞凯材料	9,600	151,296.00	0.06
267	000555	神州信息	13,400	151,286.00	0.06
268	002081	金螳螂	40,100	150,776.00	0.06
269	601718	际华集团	53,000	150,520.00	0.06
270	600477	杭萧钢构	45,400	149,366.00	0.06
271	601311	骆驼股份	18,600	148,986.00	0.05
272	601369	陕鼓动力	18,600	148,428.00	0.05
273	300263	隆华科技	21,000	147,840.00	0.05
274	002060	粤水电	30,100	147,791.00	0.05
275	300623	捷捷微电	9,300	147,591.00	0.05
276	688100	威胜信息	5,098	147,434.16	0.05
277	600098	广州发展	27,400	147,138.00	0.05
278	002498	汉缆股份	36,700	146,800.00	0.05
279	002390	信邦制药	33,000	146,520.00	0.05
280	601567	三星医疗	7,100	145,550.00	0.05
281	688017	绿的谐波	946	145,211.00	0.05
282	600496	精工钢构	47,500	144,875.00	0.05

283	002226	江南化工	33,000	144,540.00	0.05
284	600776	东方通信	12,800	144,512.00	0.05
285	688192	迪哲医药	3,010	144,028.50	0.05
286	300772	运达股份	13,500	143,640.00	0.05
287	002191	劲嘉股份	26,700	143,379.00	0.05
288	688559	海目星	3,998	142,728.60	0.05
289	002218	拓日新能	31,600	142,516.00	0.05
290	601326	秦港股份	50,000	142,500.00	0.05
291	600996	贵广网络	15,900	142,464.00	0.05
292	600017	日照港	51,800	142,450.00	0.05
293	603896	寿仙谷	4,400	141,856.00	0.05
294	300284	苏交科	26,000	141,700.00	0.05
295	000061	农产品	21,700	140,399.00	0.05
296	600623	华谊集团	21,800	140,392.00	0.05
297	600811	东方集团	70,500	140,295.00	0.05
298	601609	金田股份	20,600	139,462.00	0.05
299	300726	宏达电子	4,600	138,874.00	0.05
300	600459	贵研铂业	9,645	138,502.20	0.05
301	688660	电气风电	26,941	138,476.74	0.05
302	002440	闰土股份	22,700	138,470.00	0.05
303	600169	太原重工	58,600	138,296.00	0.05
304	002489	浙江永强	45,400	138,016.00	0.05
305	600391	航发科技	7,200	137,664.00	0.05
306	002556	辉隆股份	23,300	137,004.00	0.05
307	605507	国邦医药	7,800	136,968.00	0.05
308	688161	威高骨科	3,278	135,873.10	0.05
309	688206	概伦电子	6,228	135,770.40	0.05
310	300232	洲明科技	15,400	135,520.00	0.05
311	301175	中科环保	27,100	135,229.00	0.05
312	000718	苏宁环球	52,000	134,680.00	0.05
313	600163	中闽能源	30,800	134,596.00	0.05
314	600587	新华医疗	5,200	134,108.00	0.05
315	600648	外高桥	13,600	134,096.00	0.05
316	600217	中再资环	30,500	133,590.00	0.05
317	301217	铜冠铜箔	11,200	132,832.00	0.05
318	002461	珠江啤酒	16,800	132,720.00	0.05
319	002534	西子洁能	10,600	132,394.00	0.05
320	300068	南都电源	10,200	131,988.00	0.05
321	600312	平高电气	10,400	131,976.00	0.05
322	603609	禾丰股份	15,400	131,824.00	0.05
323	688586	江航装备	11,860	131,527.40	0.05
324	603281	江瀚新材	5,000	131,450.00	0.05
325	000403	派林生物	4,800	130,752.00	0.05
326	300696	爱乐达	7,500	130,575.00	0.05

327	000019	深粮控股	17,300	130,442.00	0.05
328	688499	利元亨	3,421	130,271.68	0.05
329	603301	振德医疗	5,300	129,850.00	0.05
330	600400	红豆股份	46,500	129,735.00	0.05
331	601677	明泰铝业	11,400	129,276.00	0.05
332	301090	华润材料	11,900	129,234.00	0.05
333	688270	臻镭科技	1,888	129,101.44	0.05
334	002307	北新路桥	30,400	128,896.00	0.05
335	301308	江波龙	1,400	128,870.00	0.05
336	002932	明德生物	5,600	128,632.00	0.05
337	301060	兰卫医学	9,600	127,584.00	0.05
338	002950	奥美医疗	13,400	127,032.00	0.05
339	002332	仙琚制药	9,900	126,423.00	0.05
340	001338	永顺泰	10,400	125,424.00	0.05
341	000030	富奥股份	23,400	124,956.00	0.05
342	002100	天康生物	14,200	124,534.00	0.05
343	002182	宝武镁业	6,300	123,858.00	0.05
344	002015	协鑫能科	10,000	123,800.00	0.05
345	002567	唐人神	16,400	123,000.00	0.05
346	000528	柳工	18,200	122,668.00	0.05
347	600908	无锡银行	24,200	122,210.00	0.05
348	002617	露笑科技	19,700	122,140.00	0.04
349	300887	谱尼测试	10,300	121,643.00	0.04
350	002287	奇正藏药	5,400	121,446.00	0.04
351	301180	万祥科技	6,700	121,203.00	0.04
352	001322	箭牌家居	10,200	120,972.00	0.04
353	001301	尚太科技	3,300	120,846.00	0.04
354	301239	普瑞眼科	1,400	120,400.00	0.04
355	300820	英杰电气	2,100	120,288.00	0.04
356	600403	大有能源	31,600	120,080.00	0.04
357	301246	宏源药业	4,600	119,508.00	0.04
358	301035	润丰股份	1,700	119,000.00	0.04
359	301177	迪阿股份	4,000	117,960.00	0.04
360	600323	瀚蓝环境	6,800	117,844.00	0.04
361	301286	侨源股份	4,000	116,240.00	0.04
362	300079	数码视讯	20,400	116,076.00	0.04
363	300170	汉得信息	13,900	115,509.00	0.04
364	688123	聚辰股份	1,881	115,173.63	0.04
365	002020	京新药业	9,000	114,480.00	0.04
366	000811	冰轮环境	8,400	113,988.00	0.04
367	002597	金禾实业	5,200	113,932.00	0.04
368	300035	中科电气	10,800	113,832.00	0.04
369	300624	万兴科技	1,200	113,520.00	0.04
370	002324	普利特	8,600	113,090.00	0.04



371	600586	金晶科技	16,800	112,224.00	0.04
372	688066	航天宏图	2,656	112,189.44	0.04
373	300332	天壕能源	14,100	112,095.00	0.04
374	603530	神马电力	5,400	111,996.00	0.04
375	603565	中谷物流	13,600	111,928.00	0.04
376	300171	东富龙	6,200	111,538.00	0.04
377	002635	安洁科技	6,800	111,044.00	0.04
378	688381	帝奥微	4,378	110,850.96	0.04
379	000682	东方电子	13,753	110,711.65	0.04
380	002003	伟星股份	10,200	110,670.00	0.04
380	002583	海能达	18,600	110,670.00	0.04
382	002840	华统股份	5,300	110,187.00	0.04
383	000969	安泰科技	12,200	109,678.00	0.04
384	600971	恒源煤电	9,800	109,270.00	0.04
385	603033	三维股份	6,800	107,508.00	0.04
386	002215	诺普信	13,000	107,380.00	0.04
387	000028	国药一致	3,700	107,263.00	0.04
388	601200	上海环境	11,800	106,082.00	0.04
389	600502	安徽建工	22,600	105,090.00	0.04
390	600158	中体产业	13,500	105,030.00	0.04
391	300151	昌红科技	5,700	104,766.00	0.04
392	300203	聚光科技	6,600	104,610.00	0.04
393	600266	城建发展	21,600	104,544.00	0.04
394	601619	嘉泽新能	29,400	103,782.00	0.04
395	603881	数据港	5,200	103,064.00	0.04
396	603876	鼎胜新材	8,200	102,746.00	0.04
397	688037	芯源微	768	102,612.48	0.04
398	600643	爱建集团	20,100	102,510.00	0.04
399	603638	艾迪精密	6,300	102,375.00	0.04
400	688031	星环科技	1,570	102,159.90	0.04
401	002967	广电计量	6,800	102,068.00	0.04
402	000928	中钢国际	17,500	102,025.00	0.04
403	002705	新宝股份	7,000	101,990.00	0.04
404	603043	广州酒家	5,200	101,556.00	0.04
405	002125	湘潭电化	9,500	101,555.00	0.04
406	002243	力合科创	12,700	100,965.00	0.04
407	600073	上海梅林	14,800	100,788.00	0.04
408	001696	宗申动力	15,000	99,450.00	0.04
409	600997	开滦股份	13,000	99,190.00	0.04
410	002400	省广集团	17,800	98,790.00	0.04
411	603728	鸣志电器	1,500	98,775.00	0.04
412	000913	钱江摩托	7,900	98,513.00	0.04
413	300475	香农芯创	2,900	97,991.00	0.04
414	688110	东芯股份	2,836	97,643.48	0.04

415	600780	通宝能源	11,900	97,580.00	0.04
416	003012	东鹏控股	11,800	97,350.00	0.04
417	688046	药康生物	4,817	97,062.55	0.04
418	002088	鲁阳节能	6,800	96,900.00	0.04
419	600929	雪天盐业	15,000	96,750.00	0.04
420	600876	凯盛新能	6,800	95,404.00	0.04
421	300315	掌趣科技	18,500	95,275.00	0.04
422	300737	科顺股份	15,500	95,170.00	0.04
423	688238	和元生物	10,582	95,132.18	0.04
424	002928	华夏航空	13,300	94,962.00	0.03
425	600475	华光环能	9,100	94,640.00	0.03
426	000968	蓝焰控股	13,300	94,563.00	0.03
427	000885	城发环境	8,300	94,122.00	0.03
428	002242	九阳股份	7,400	94,054.00	0.03
429	301325	曼恩斯特	1,200	93,048.00	0.03
430	688408	中信博	1,295	92,916.25	0.03
431	600618	氯碱化工	10,100	91,910.00	0.03
432	600657	信达地产	25,500	91,545.00	0.03
433	002918	蒙娜丽莎	6,700	90,718.00	0.03
434	603995	甬金股份	4,700	90,381.00	0.03
435	000034	神州数码	3,000	89,730.00	0.03
436	300188	美亚柏科	5,600	89,712.00	0.03
437	000517	荣安地产	36,600	89,670.00	0.03
438	603533	掌阅科技	4,500	89,460.00	0.03
439	000791	甘肃能源	16,000	89,120.00	0.03
440	603208	江山欧派	3,000	89,070.00	0.03
441	601858	中国科传	3,600	88,812.00	0.03
442	002961	瑞达期货	5,900	87,910.00	0.03
443	002911	佛燃能源	7,500	85,950.00	0.03
444	688198	佰仁医疗	657	81,816.21	0.03
445	688617	惠泰医疗	200	77,700.00	0.03
446	002291	遥望科技	8,100	75,978.00	0.03
447	601375	中原证券	18,700	71,621.00	0.03
448	000681	视觉中国	4,800	70,560.00	0.03
449	300031	宝通科技	3,800	70,452.00	0.03
450	003021	兆威机电	700	65,793.00	0.02
451	000676	智度股份	7,300	63,729.00	0.02
452	688608	恒玄科技	413	63,713.51	0.02
453	300459	汤姆猫	12,800	63,232.00	0.02
454	002261	拓维信息	4,200	63,168.00	0.02
455	601949	中国出版	7,800	63,024.00	0.02
456	301205	联特科技	600	62,850.00	0.02
457	301171	易点天下	3,100	61,287.00	0.02
458	600874	创业环保	10,900	60,495.00	0.02

459	688372	伟测科技	748	58,643.20	0.02
460	688167	炬光科技	507	57,798.00	0.02
461	600195	中牧股份	4,700	55,742.00	0.02
462	300567	精测电子	600	52,572.00	0.02
463	688686	奥普特	461	51,632.00	0.02
464	000837	秦川机床	4,800	51,600.00	0.02
465	300869	康泰医学	2,500	51,575.00	0.02
466	300598	诚迈科技	1,200	51,516.00	0.02
467	301015	百洋医药	1,400	50,204.00	0.02
468	688798	艾为电子	726	50,115.78	0.02
469	688322	奥比中光	1,306	49,079.48	0.02
470	688088	虹软科技	1,172	48,098.88	0.02
471	300182	捷成股份	9,100	46,228.00	0.02
472	603888	新华网	1,800	45,342.00	0.02
473	603083	剑桥科技	1,200	45,264.00	0.02
474	002396	星网锐捷	2,500	45,175.00	0.02
475	688001	华兴源创	1,286	44,945.70	0.02
476	603299	苏盐井神	5,200	44,304.00	0.02
477	000810	创维数字	2,800	43,988.00	0.02
478	000719	中原传媒	4,100	39,893.00	0.01
479	603915	国茂股份	2,400	39,552.00	0.01
480	300827	上能电气	1,300	39,338.00	0.01
480	600602	云赛智联	3,400	39,338.00	0.01
482	688048	长光华芯	625	39,168.75	0.01
483	605168	三人行	600	38,016.00	0.01
484	300693	盛弘股份	1,200	35,892.00	0.01
485	688018	乐鑫科技	341	35,105.95	0.01
486	601890	亚星锚链	3,500	34,650.00	0.01
487	002698	博实股份	2,100	31,899.00	0.01
488	300620	光库科技	700	31,710.00	0.01
489	002747	埃斯顿	1,700	31,603.00	0.01
490	300476	胜宏科技	1,700	31,365.00	0.01
491	688400	凌云光	1,127	30,429.00	0.01
492	002201	正威新材	4,200	30,366.00	0.01
493	002837	英维克	1,100	30,228.00	0.01
494	300672	国科微	500	29,470.00	0.01
495	300083	创世纪	4,600	29,118.00	0.01
496	002605	姚记科技	1,300	28,886.00	0.01
497	603197	保隆科技	500	28,200.00	0.01
498	688173	希荻微	1,590	27,968.10	0.01
499	603489	八方股份	500	27,475.00	0.01
500	688262	国芯科技	928	27,227.52	0.01
501	688578	艾力斯	648	26,995.68	0.01
502	301165	锐捷网络	700	26,523.00	0.01

503	603556	海兴电力	900	26,127.00	0.01
504	603599	广信股份	1,800	26,100.00	0.01
505	002906	华阳集团	700	24,675.00	0.01
506	002979	雷赛智能	1,100	23,705.00	0.01
507	002222	福晶科技	800	23,624.00	0.01
508	000032	深桑达 A	1,100	23,298.00	0.01
509	300432	富临精工	2,200	23,100.00	0.01
510	603005	晶方科技	900	19,764.00	0.01
511	300803	指南针	300	18,078.00	0.01
512	301155	海力风电	300	17,745.00	0.01
513	300613	富瀚微	400	16,976.00	0.01
514	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.01
515	001311	多利科技	300	14,853.00	0.01
516	002675	东诚药业	800	14,664.00	0.01
517	002335	科华数据	500	13,840.00	0.01
518	002777	久远银海	500	12,555.00	0.00
519	001270	铖昌科技	200	12,542.00	0.00
520	601519	大智慧	1,300	9,594.00	0.00
521	002068	黑猫股份	300	3,480.00	0.00
522	300260	新莱应材	100	3,043.00	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	300421	力星股份	85,400	1,102,514.00	0.41
2	600114	东睦股份	63,000	975,870.00	0.36
3	300389	艾比森	55,100	955,434.00	0.35
4	688076	诺泰生物	20,540	923,273.00	0.34
5	688138	清溢光电	40,087	906,767.94	0.33
6	301096	百诚医药	13,700	891,870.00	0.33
7	603518	锦泓集团	88,300	884,766.00	0.33
8	000920	沃顿科技	87,400	867,882.00	0.32
9	300559	佳发教育	55,700	863,350.00	0.32
10	000534	万泽股份	65,800	861,322.00	0.32
11	002533	金杯电工	106,500	860,520.00	0.32
12	601500	通用股份	207,500	859,050.00	0.32
13	000612	焦作万方	147,700	849,275.00	0.31
14	605116	奥锐特	32,600	841,732.00	0.31
15	688387	信科移动	116,489	839,885.69	0.31
16	600977	中国电影	68,300	835,992.00	0.31
17	601700	风范股份	166,100	832,161.00	0.31
18	000888	峨眉山 A	93,000	830,490.00	0.31

19	301302	华如科技	32,900	826,119.00	0.30
20	603538	美诺华	43,000	822,160.00	0.30
21	002035	华帝股份	132,200	820,962.00	0.30
22	600023	浙能电力	177,100	816,431.00	0.30
23	002367	康力电梯	108,200	813,664.00	0.30
24	600987	航民股份	92,350	808,986.00	0.30
25	002615	哈尔斯	110,100	807,033.00	0.30
26	688222	成都先导	53,280	798,667.20	0.29
27	300404	博济医药	89,000	796,550.00	0.29
28	688180	君实生物	18,983	794,058.89	0.29
29	002668	奥马电器	119,400	789,234.00	0.29
30	002558	巨人网络	70,800	788,712.00	0.29
31	300314	戴维医疗	51,700	782,738.00	0.29
32	601900	南方传媒	60,000	779,400.00	0.29
33	002602	世纪华通	149,000	768,840.00	0.28
34	301185	鸥玛软件	37,400	761,464.00	0.28
35	002919	名臣健康	25,200	646,128.00	0.24
36	688589	力合微	12,629	504,023.39	0.19
37	002517	恺英网络	36,200	404,354.00	0.15
38	301566	达利凯普	5,755	162,891.85	0.06
39	688160	步科股份	2,432	141,493.76	0.05
40	300494	盛天网络	8,200	129,642.00	0.05
41	603163	圣晖集成	3,900	129,207.00	0.05
42	300394	天孚通信	1,400	128,128.00	0.05
43	688535	华海诚科	1,368	126,923.04	0.05
44	688111	金山办公	367	116,045.40	0.04
45	603662	柯力传感	3,200	115,168.00	0.04
46	001309	德明利	1,200	113,868.00	0.04
47	002896	中大力德	3,100	112,685.00	0.04
48	688416	恒烁股份	1,916	112,258.44	0.04
49	300580	贝斯特	3,700	112,036.00	0.04
50	300570	太辰光	2,800	109,340.00	0.04
51	300474	景嘉微	1,500	106,065.00	0.04
52	688120	华海清科	563	105,675.10	0.04
53	688766	普冉股份	1,069	104,740.62	0.04
54	688698	伟创电气	2,862	103,976.46	0.04
55	300308	中际旭创	900	101,619.00	0.04
56	688195	腾景科技	2,793	100,520.07	0.04
57	688525	佰维存储	1,603	100,443.98	0.04
58	688320	禾川科技	2,436	99,876.00	0.04
59	002073	软控股份	15,000	98,550.00	0.04
60	688008	澜起科技	1,667	97,952.92	0.04
61	688582	芯动联科	2,468	95,437.56	0.04
62	688012	中微公司	621	95,385.60	0.04

63	688095	福昕软件	1,342	93,738.70	0.03
64	300502	新易盛	1,900	93,708.00	0.03
65	688072	拓荆科技	399	92,288.70	0.03
66	300364	中文在线	3,500	90,055.00	0.03
67	603258	电魂网络	3,900	89,622.00	0.03
68	300654	世纪天鸿	7,900	89,112.00	0.03
69	300042	朗科科技	2,500	87,500.00	0.03
70	300660	江苏雷利	2,800	84,728.00	0.03
71	300499	高澜股份	5,700	81,738.00	0.03
72	301013	利和兴	5,000	79,250.00	0.03
73	688256	寒武纪	574	77,467.04	0.03
74	000158	常山北明	8,900	76,718.00	0.03
75	603000	人民网	2,700	75,546.00	0.03
76	603986	兆易创新	800	73,912.00	0.03
77	301191	菲菱科思	800	73,760.00	0.03
78	688082	盛美上海	696	72,669.36	0.03
79	688205	德科立	1,468	72,636.64	0.03
80	603496	恒为科技	2,300	71,668.00	0.03
81	300418	昆仑万维	1,900	71,060.00	0.03
82	688041	海光信息	991	70,341.18	0.03
83	300809	华辰装备	2,400	70,200.00	0.03
84	300058	蓝色光标	9,500	68,210.00	0.03
85	000936	华西股份	8,400	68,040.00	0.03
86	300251	光线传媒	8,300	67,645.00	0.02
87	688220	翱捷科技	946	66,636.24	0.02
88	688300	联瑞新材	1,252	66,293.40	0.02
89	688609	九联科技	4,980	65,736.00	0.02
90	301052	果麦文化	1,500	65,670.00	0.02
91	301550	斯菱股份	1,400	64,932.00	0.02
92	688036	传音控股	468	64,771.20	0.02
93	300223	北京君正	1,000	64,650.00	0.02
94	688153	唯捷创芯	976	63,928.00	0.02
95	688255	凯尔达	2,608	63,765.60	0.02
96	688003	天准科技	1,698	63,708.96	0.02
97	603650	彤程新材	1,900	63,270.00	0.02
98	600498	烽火通信	3,800	63,232.00	0.02
99	300212	易华录	2,000	62,900.00	0.02
100	600536	中国软件	1,700	61,642.00	0.02
101	300413	芒果超媒	2,400	60,480.00	0.02
102	300351	永贵电器	2,900	60,088.00	0.02
103	688390	固德威	459	59,936.22	0.02
104	300480	光力科技	2,800	59,780.00	0.02
105	688517	金冠电气	3,763	59,417.77	0.02
106	688115	思林杰	1,713	59,389.71	0.02

107	601689	拓普集团	800	58,800.00	0.02
108	300788	中信出版	2,000	58,200.00	0.02
109	688655	迅捷兴	3,826	57,772.60	0.02
110	688659	元琛科技	4,632	57,668.40	0.02
111	688681	科汇股份	3,732	57,659.40	0.02
112	002463	沪电股份	2,600	57,512.00	0.02
113	688607	康众医疗	2,821	57,491.98	0.02
114	688616	西力科技	4,209	57,410.76	0.02
115	300329	海伦钢琴	7,700	57,365.00	0.02
116	300913	兆龙互连	1,900	57,057.00	0.02
117	301336	趣睡科技	1,300	56,927.00	0.02
118	301040	中环海陆	3,000	56,910.00	0.02
119	600768	宁波富邦	4,800	56,880.00	0.02
120	688376	美埃科技	1,497	56,871.03	0.02
121	688379	华光新材	2,876	56,858.52	0.02
122	603045	福达合金	3,600	56,844.00	0.02
123	688350	富淼科技	3,428	56,664.84	0.02
124	688067	爱威科技	2,374	56,524.94	0.02
125	300640	德艺文创	8,800	56,496.00	0.02
126	000977	浪潮信息	1,700	56,440.00	0.02
127	300626	华瑞股份	5,200	56,420.00	0.02
128	300923	研奥股份	2,300	56,396.00	0.02
129	300509	新美星	7,800	56,394.00	0.02
130	002295	精艺股份	6,900	56,373.00	0.02
131	603657	春光科技	3,500	56,315.00	0.02
132	301027	华蓝集团	4,500	56,295.00	0.02
133	688129	东来技术	3,396	56,203.80	0.02
134	688395	正弦电气	2,442	56,141.58	0.02
135	300321	同大股份	2,900	56,115.00	0.02
136	002857	三晖电气	3,400	56,100.00	0.02
137	688367	工大高科	3,142	56,053.28	0.02
138	300535	达威股份	3,200	56,032.00	0.02
139	688679	通源环境	4,364	55,990.12	0.02
140	300929	华骐环保	4,600	55,982.00	0.02
141	688577	浙海德曼	594	55,954.80	0.02
142	603499	翔港科技	5,200	55,952.00	0.02
143	003017	大洋生物	2,300	55,936.00	0.02
144	300823	建科机械	2,600	55,926.00	0.02
145	688092	爱科科技	1,818	55,921.68	0.02
146	688501	青达环保	3,342	55,911.66	0.02
147	301198	喜悦智行	4,600	55,844.00	0.02
148	300854	中兰环保	3,200	55,840.00	0.02
149	603955	大千生态	3,800	55,822.00	0.02
150	301037	保立佳	2,800	55,804.00	0.02

151	688215	瑞晟智能	1,552	55,794.40	0.02
152	002921	联诚精密	3,400	55,658.00	0.02
153	688096	京源环保	5,938	55,639.06	0.02
154	300906	日月明	2,200	55,638.00	0.02
155	002890	弘宇股份	3,600	55,620.00	0.02
155	300749	顶固集创	6,000	55,620.00	0.02
157	688163	赛伦生物	2,782	55,612.18	0.02
158	300743	天地数码	4,000	55,520.00	0.02
159	301098	金埔园林	4,700	55,507.00	0.02
160	300907	康平科技	2,500	55,475.00	0.02
161	301057	汇隆新材	3,300	55,440.00	0.02
162	300717	华信新材	3,300	55,407.00	0.02
163	301079	邵阳液压	3,200	55,360.00	0.02
164	300995	奇德新材	2,600	55,302.00	0.02
165	300970	华绿生物	3,200	55,232.00	0.02
166	301273	瑞晨环保	2,000	55,180.00	0.02
167	003003	天元股份	4,800	55,152.00	0.02
168	002836	新宏泽	6,300	55,125.00	0.02
169	002830	名雕股份	3,700	55,093.00	0.02
170	300703	创源股份	4,900	55,076.00	0.02
171	301288	清研环境	2,900	55,042.00	0.02
172	688485	九州一轨	3,929	54,927.42	0.02
173	301209	联合化学	2,200	54,912.00	0.02
174	603813	原尚股份	3,400	54,910.00	0.02
175	000929	兰州黄河	5,600	54,880.00	0.02
176	301125	腾亚精工	2,900	54,868.00	0.02
177	300971	博亚精工	2,200	54,780.00	0.02
178	688171	纬德信息	2,434	54,765.00	0.02
179	300948	冠中生态	3,800	54,758.00	0.02
180	300920	润阳科技	2,600	54,730.00	0.02
181	301156	美农生物	2,900	54,694.00	0.02
182	600455	博通股份	2,200	54,670.00	0.02
183	600137	浪莎股份	3,000	54,660.00	0.02
184	605318	法狮龙	3,400	54,638.00	0.02
185	002899	英派斯	3,300	54,615.00	0.02
186	002144	宏达高科	4,700	54,614.00	0.02
187	603022	新通联	5,300	54,590.00	0.02
188	301339	通行宝	2,700	54,486.00	0.02
189	600493	凤竹纺织	8,100	54,432.00	0.02
190	600883	博闻科技	6,400	54,400.00	0.02
191	688021	奥福环保	2,607	54,355.95	0.02
192	603161	科华控股	3,400	54,332.00	0.02
193	300845	捷安高科	3,000	54,210.00	0.02
194	301010	晶雪节能	2,900	54,201.00	0.02



195	605155	西大门	3,500	54,180.00	0.02
196	301312	智立方	500	54,170.00	0.02
197	001231	农心科技	2,600	54,158.00	0.02
198	301167	建研设计	3,200	54,144.00	0.02
199	688329	艾隆科技	2,177	54,120.22	0.02
200	603320	迪贝电气	3,400	54,094.00	0.02
201	688335	复洁环保	4,212	54,039.96	0.02
202	002883	中设股份	4,400	54,032.00	0.02
203	603272	联翔股份	3,200	54,016.00	0.02
204	688032	禾迈股份	200	54,000.00	0.02
205	300992	泰福泵业	2,500	53,950.00	0.02
206	001259	利仁科技	1,900	53,808.00	0.02
207	301300	远翔新材	1,700	53,771.00	0.02
208	300877	金春股份	3,100	53,661.00	0.02
209	600793	宜宾纸业	4,600	53,452.00	0.02
210	301075	多瑞医药	2,000	53,340.00	0.02
211	300607	拓斯达	3,400	53,278.00	0.02
212	603506	南都物业	4,900	53,263.00	0.02
213	603860	中公高科	1,700	52,785.00	0.02
214	688251	井松智能	1,812	52,692.96	0.02
215	000066	中国长城	5,200	52,624.00	0.02
216	688039	当虹科技	1,450	52,432.00	0.02
217	688223	晶科能源	5,840	51,742.40	0.02
218	002780	三夫户外	4,100	51,291.00	0.02
219	300280	紫天科技	1,200	51,276.00	0.02
220	688687	凯因科技	1,467	51,139.62	0.02
221	000988	华工科技	1,700	50,592.00	0.02
222	688217	睿昂基因	1,410	50,449.80	0.02
223	688496	清越科技	2,215	49,593.85	0.02
224	002712	思美传媒	8,700	49,416.00	0.02
225	688458	美芯晟	627	48,253.92	0.02
226	688207	格灵深瞳	2,283	47,851.68	0.02
227	301360	荣旗科技	500	46,800.00	0.02
228	301005	超捷股份	1,500	46,695.00	0.02
229	002315	焦点科技	1,400	46,382.00	0.02
230	688601	力芯微	857	44,898.23	0.02
231	688052	纳芯微	267	44,548.95	0.02
232	002368	太极股份	1,500	44,295.00	0.02
233	300556	丝路视觉	1,200	44,220.00	0.02
234	000700	模塑科技	6,300	44,100.00	0.02
235	300274	阳光电源	500	43,795.00	0.02
236	000021	深科技	2,700	43,767.00	0.02
237	301421	波长光电	700	43,701.00	0.02
238	603019	中科曙光	1,100	43,439.00	0.02

239	688362	甬矽电子	1,644	43,056.36	0.02
240	603918	金桥信息	2,300	43,010.00	0.02
241	301368	丰立智能	900	42,426.00	0.02
242	688028	沃尔德	1,701	42,337.89	0.02
243	600584	长电科技	1,400	41,804.00	0.02
244	002230	科大讯飞	900	41,742.00	0.02
245	301525	儒竞科技	493	41,327.78	0.02
246	002050	三花智控	1,400	41,160.00	0.02
247	600105	永鼎股份	7,400	40,996.00	0.02
248	688486	龙迅股份	345	40,975.65	0.02
249	688313	仕佳光子	3,217	40,888.07	0.02
250	605128	上海沿浦	700	40,635.00	0.01
251	301369	联动科技	700	40,509.00	0.01
252	300445	康斯特	2,300	40,089.00	0.01
253	002555	三七互娱	2,100	39,501.00	0.01
254	300007	汉威科技	1,900	39,482.00	0.01
255	002131	利欧股份	17,300	39,444.00	0.01
256	300299	富春股份	6,800	39,236.00	0.01
257	688332	中科蓝讯	516	38,916.72	0.01
258	002236	大华股份	2,100	38,745.00	0.01
259	688147	微导纳米	991	38,639.09	0.01
260	688071	华依科技	743	36,191.53	0.01
261	300533	冰川网络	1,300	36,010.00	0.01
262	002955	鸿合科技	1,100	35,541.00	0.01
263	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
264	300842	帝科股份	500	35,275.00	0.01
265	601928	凤凰传媒	4,000	35,240.00	0.01
266	300549	优德精密	1,800	34,470.00	0.01
267	002902	铭普光磁	1,500	34,380.00	0.01
268	301391	卡莱特	300	34,344.00	0.01
269	688331	荣昌生物	552	34,257.12	0.01
270	002338	奥普光电	1,000	33,650.00	0.01
271	600732	爱旭股份	1,900	33,516.00	0.01
272	603380	易德龙	1,300	33,293.00	0.01
273	601138	工业富联	2,200	33,264.00	0.01
274	688533	上声电子	851	32,440.12	0.01
275	002947	恒铭达	1,000	32,180.00	0.01
276	603501	韦尔股份	300	32,013.00	0.01
277	000561	烽火电子	3,800	31,920.00	0.01
278	300403	汉宇集团	3,600	31,860.00	0.01
279	300115	长盈精密	2,400	31,800.00	0.01
280	300571	平治信息	900	31,797.00	0.01
281	600839	四川长虹	6,000	31,740.00	0.01
282	603228	景旺电子	1,400	31,584.00	0.01

283	605277	新亚电子	2,100	31,374.00	0.01
284	002281	光迅科技	1,100	31,350.00	0.01
285	688084	晶品特装	416	31,179.20	0.01
286	002865	钧达股份	400	30,992.00	0.01
287	688292	浩瀚深度	1,125	30,960.00	0.01
288	300984	金沃股份	1,100	30,756.00	0.01
289	603633	徕木股份	3,200	30,656.00	0.01
290	688612	威迈斯	791	30,594.83	0.01
291	300440	运达科技	4,100	30,545.00	0.01
292	300604	长川科技	800	30,392.00	0.01
293	300088	长信科技	4,500	30,105.00	0.01
294	300884	狄耐克	2,300	30,084.00	0.01
295	002997	瑞鹄模具	900	29,988.00	0.01
296	688233	神工股份	837	29,537.73	0.01
297	688369	致远互联	853	29,522.33	0.01
298	002031	巨轮智能	7,100	29,394.00	0.01
299	300893	松原股份	1,000	29,230.00	0.01
300	301310	鑫宏业	600	29,190.00	0.01
301	002373	千方科技	2,600	29,146.00	0.01
302	688361	中科飞测	390	29,027.70	0.01
303	001282	三联锻造	800	28,936.00	0.01
304	300782	卓胜微	200	28,200.00	0.01
305	301168	通灵股份	600	27,696.00	0.01
306	605133	嵘泰股份	1,000	27,670.00	0.01
307	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01
308	600895	张江高科	1,400	27,020.00	0.01
309	300548	博创科技	1,000	26,970.00	0.01
310	688045	必易微	623	26,683.09	0.01
311	603999	读者传媒	3,800	26,106.00	0.01
312	688663	新风光	920	25,796.80	0.01
313	688252	天德钰	1,283	25,608.68	0.01
314	688226	威腾电气	1,354	25,455.20	0.01
315	003043	华亚智能	500	25,105.00	0.01
316	688141	杰华特	897	24,811.02	0.01
317	688484	南芯科技	619	24,667.15	0.01
318	688348	昱能科技	200	24,476.00	0.01
319	600418	江淮汽车	1,500	24,225.00	0.01
320	603327	福蓉科技	1,800	23,994.00	0.01
321	688143	长盈通	669	23,649.15	0.01
322	002472	双环传动	900	23,418.00	0.01
323	301221	光庭信息	400	23,320.00	0.01
324	002821	凯莱英	200	23,220.00	0.01
325	605319	无锡振华	1,000	23,020.00	0.01
326	300235	方直科技	2,000	22,940.00	0.01

327	603528	多伦科技	2,500	22,700.00	0.01
328	688058	宝兰德	474	22,377.54	0.01
329	002897	意华股份	600	22,296.00	0.01
330	300850	新强联	700	22,281.00	0.01
331	688579	山大地纬	1,744	22,148.80	0.01
332	301313	凡拓数创	600	21,636.00	0.01
333	002664	信质集团	1,300	21,619.00	0.01
334	002138	顺络电子	800	21,608.00	0.01
335	301526	国际复材	4,816	21,431.20	0.01
336	688401	路维光电	684	21,012.48	0.01
337	301255	通力科技	500	21,005.00	0.01
338	688502	茂莱光学	96	20,831.04	0.01
339	002156	通富微电	900	20,808.00	0.01
340	603035	常熟汽饰	1,100	20,757.00	0.01
341	603160	汇顶科技	300	20,730.00	0.01
342	688035	德邦科技	380	20,276.80	0.01
343	002908	德生科技	1,400	19,964.00	0.01
344	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.01
345	603721	中广天择	700	19,628.00	0.01
346	688627	精智达	222	19,473.84	0.01
347	300946	恒而达	600	19,362.00	0.01
348	688475	萤石网络	430	19,307.00	0.01
349	603893	瑞芯微	300	19,020.00	0.01
350	688025	杰普特	200	18,510.00	0.01
351	688548	广钢气体	1,417	18,066.75	0.01
352	688311	盟升电子	353	18,006.53	0.01
353	300161	华中数控	500	17,950.00	0.01
354	688282	理工导航	452	17,763.60	0.01
355	301486	致尚科技	369	17,435.25	0.01
356	000938	紫光股份	900	17,415.00	0.01
357	605289	罗曼股份	300	17,250.00	0.01
358	603606	东方电缆	400	17,100.00	0.01
359	301117	佳缘科技	300	16,353.00	0.01
360	300258	精锻科技	1,200	15,504.00	0.01
361	300825	阿尔特	1,100	15,125.00	0.01
362	301558	三态股份	1,128	15,115.20	0.01
363	301398	星源卓镁	300	14,787.00	0.01
364	002876	三利谱	400	14,708.00	0.01
365	002422	科伦药业	500	14,525.00	0.01
366	301510	固高科技	396	13,863.96	0.01
367	603596	伯特利	200	13,860.00	0.01
368	000997	新大陆	700	13,727.00	0.01
369	002262	恩华药业	500	13,560.00	0.00
370	301297	富乐德	500	13,480.00	0.00

371	688428	诺诚健华	1,170	13,455.00	0.00
372	002115	三维通信	1,800	12,996.00	0.00
373	688591	泰凌微	462	12,945.24	0.00
374	688652	京仪装备	247	12,905.75	0.00
375	002241	歌尔股份	600	12,606.00	0.00
376	603296	华勤技术	158	12,284.50	0.00
377	300531	优博讯	800	12,264.00	0.00
378	601098	中南传媒	1,200	12,204.00	0.00
379	301393	昊帆生物	201	11,933.37	0.00
380	603809	豪能股份	1,000	11,850.00	0.00
381	688602	康鹏科技	1,063	11,756.78	0.00
382	002045	国光电器	700	11,655.00	0.00
383	301498	乖宝宠物	292	11,332.52	0.00
384	688728	格科微	553	11,319.91	0.00
385	301507	民生健康	712	11,285.20	0.00
386	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
387	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
388	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
389	301251	威尔高	299	10,342.41	0.00
390	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
391	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
392	688702	盛科通信	206	9,925.08	0.00
393	601096	宏盛华源	2,424	9,841.44	0.00
394	300129	泰胜风能	900	9,693.00	0.00
395	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
396	688378	奥来德	200	9,468.00	0.00
397	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
398	301418	协昌科技	186	9,337.20	0.00
399	301528	多浦乐	135	9,302.85	0.00
400	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
401	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
402	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
403	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
404	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
405	688716	中研股份	233	8,478.87	0.00
406	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
407	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
408	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
409	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
410	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
411	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
412	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
413	300832	新产业	100	7,820.00	0.00
414	688719	爱科赛博	130	7,813.00	0.00

415	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
416	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
417	002185	华天科技	900	7,668.00	0.00
418	301371	敷尔佳	203	7,628.74	0.00
419	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
420	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
421	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
422	688200	华峰测控	58	7,122.40	0.00
423	688419	耐科装备	200	7,110.00	0.00
424	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
425	301559	中集环科	372	6,785.28	0.00
426	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
427	301520	万邦医药	122	6,434.28	0.00
428	301548	崇德科技	105	6,193.95	0.00
429	300122	智飞生物	100	6,111.00	0.00
430	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
431	688657	浩辰软件	77	6,023.71	0.00
432	603305	旭升集团	300	5,919.00	0.00
433	300926	博俊科技	200	5,866.00	0.00
434	688099	晶晨股份	85	5,323.55	0.00
435	601083	锦江航运	480	5,313.60	0.00
436	300857	协创数据	100	5,299.00	0.00
437	603004	鼎龙科技	164	5,115.16	0.00
438	603270	金帝股份	168	4,969.44	0.00
439	603119	浙江荣泰	204	4,869.48	0.00
440	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
441	002238	天威视讯	300	4,659.00	0.00
442	600276	恒瑞医药	100	4,523.00	0.00
443	603062	麦加芯彩	73	4,220.13	0.00
444	600636	国新文化	400	4,216.00	0.00
445	603107	上海汽配	220	4,001.80	0.00
446	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
447	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
448	301307	美利信	100	3,469.00	0.00
449	603193	润本股份	206	3,431.96	0.00
450	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
451	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
452	603075	热威股份	140	3,263.40	0.00
453	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
454	300759	康龙化成	100	2,898.00	0.00
455	603231	索宝蛋白	134	2,885.02	0.00
456	603456	九洲药业	100	2,421.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002859	洁美科技	8,017,806.69	2.95
2	002402	和而泰	7,172,779.77	2.64
3	600223	福瑞达	7,141,890.06	2.63
4	300627	华测导航	7,099,212.00	2.61
5	688083	中望软件	7,029,547.96	2.59
6	300777	中简科技	6,974,146.00	2.57
7	600761	安徽合力	6,958,433.52	2.56
8	600977	中国电影	6,842,396.32	2.52
9	688568	中科星图	6,817,684.32	2.51
10	002851	麦格米特	6,769,304.00	2.49
11	603071	物产环能	6,582,698.00	2.42
12	603466	风语筑	6,460,188.80	2.38
13	002484	江海股份	6,426,919.00	2.37
14	688127	蓝特光学	6,360,524.63	2.34
15	603179	新泉股份	6,352,317.00	2.34
16	688676	金盘科技	6,301,965.38	2.32
17	688050	爱博医疗	6,268,147.88	2.31
18	601222	林洋能源	6,200,660.00	2.28
19	605123	派克新材	6,192,892.00	2.28
20	002541	鸿路钢构	6,166,137.40	2.27
21	301039	中集车辆	6,082,115.00	2.24
22	603300	华铁应急	5,961,680.00	2.20
23	600531	豫光金铅	5,958,645.00	2.19
24	688131	皓元医药	5,916,619.63	2.18
25	000528	柳工	5,877,954.00	2.16
26	000811	冰轮环境	5,865,740.00	2.16
27	688088	虹软科技	5,815,759.50	2.14
28	002747	埃斯顿	5,787,583.00	2.13
29	600933	爱柯迪	5,758,101.00	2.12
30	688617	惠泰医疗	5,756,561.81	2.12
31	002727	一心堂	5,744,610.88	2.12
32	601019	山东出版	5,736,356.00	2.11
33	688389	普门科技	5,730,549.70	2.11
34	603505	金石资源	5,687,161.20	2.09
35	002583	海能达	5,536,954.00	2.04

36	300768	迪普科技	5,504,766.50	2.03
37	603197	保隆科技	5,467,933.34	2.01
38	601801	皖新传媒	5,467,621.00	2.01
39	002139	拓邦股份	5,465,985.00	2.01
40	000951	中国重汽	5,458,844.80	2.01

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002859	洁美科技	7,089,609.00	2.61
2	688083	中望软件	6,692,208.08	2.46
3	603179	新泉股份	6,686,556.00	2.46
4	688568	中科星图	6,653,499.48	2.45
5	002851	麦格米特	6,571,943.75	2.42
6	600761	安徽合力	6,445,229.00	2.37
7	300777	中简科技	6,277,362.43	2.31
8	300627	华测导航	6,253,045.75	2.30
9	600223	福瑞达	6,154,649.00	2.27
10	600977	中国电影	6,107,532.41	2.25
11	002484	江海股份	6,062,393.68	2.23
12	301039	中集车辆	6,053,804.84	2.23
13	002541	鸿路钢构	6,013,470.00	2.21
14	002583	海能达	5,918,296.00	2.18
15	002402	和而泰	5,902,112.36	2.17
16	000811	冰轮环境	5,872,845.00	2.16
17	605123	派克新材	5,858,064.11	2.16
18	688131	皓元医药	5,775,878.09	2.13
19	603505	金石资源	5,677,734.00	2.09
20	688676	金盘科技	5,638,264.07	2.08
21	000528	柳工	5,635,364.97	2.08
22	601222	林洋能源	5,635,066.00	2.08
23	688127	蓝特光学	5,618,330.71	2.07
24	600933	爱柯迪	5,599,461.00	2.06
25	002747	埃斯顿	5,551,586.33	2.04
26	002458	益生股份	5,491,407.18	2.02
27	688578	艾力斯	5,476,658.72	2.02
28	688050	爱博医疗	5,441,820.81	2.00

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	1,866,336,171.77
卖出股票收入（成交）总额	1,590,830,539.13

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	164,007.54	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	164,007.54	0.06

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113069	博 23 转债	1,640	164,007.54	0.06

## 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**

本基金本报告期末投资股指期货。

**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	777,694.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	777,694.44

**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	3,487	44,487.92	148,032.00	0.10%	154,981,358.48	99.90%
易方达中证 1000 量化增强 C	2,329	59,600.28	1,441,813.97	1.04%	137,367,230.12	98.96%
合计	5,816	50,539.62	1,589,845.97	0.54%	292,348,588.60	99.46%

## 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	810,398.17	0.5224%
	易方达中证 1000 量化增强 C	100.01	0.0001%
	合计	810,498.18	0.2757%

## 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	23,461,214.18	13,147,300.28
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	124,072,742.78	132,760,896.53
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	155,129,390.48	138,809,044.09

注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 25 日。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	3	1,508,686,250.33	43.71%	1,010,428.88	43.78%	-
平安证券	3	1,942,747,321.57	56.29%	1,297,533.42	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》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）。

d) 本基金管理人负责选择证券经营机构，选择标准如下：

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

e) 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。

#### 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	-	-	6,560,726,000.00	44.80%	-	-
平安证券	-	-	8,084,194,000.00	55.20%	-	-

### 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	易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-26
2	易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-17
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-07-20
4	易方达基金管理有限公司董事长（联席）任职公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-23
5	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-23
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证券报	2023-08-30
7	关于易方达中证 1000 指数量化增强型证券投资基金 2023 年港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-10-16
8	关于旗下部分基金 2023 年 10 月 23 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-10-18
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-10-25
10	关于旗下部分基金 2023 年 12 月 25 日至 2023 年 12 月 26 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-20

## § 12 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

二〇二四年三月二十九日