

# 易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## § 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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 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	49
7.7 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	50
7.8 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	50
7.9 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	50

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	投资组合报告附注	50
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>51</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3	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	52
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>52</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>52</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	52
10.2	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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	56
<b>§ 11</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>56</b>
11.1	备查文件目录	56
11.2	存放地点	57
11.3	查阅方式	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达沪深 300 量化增强证券投资基金
基金简称	易方达沪深 300 量化增强
基金主代码	110030
交易代码	110030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 7 月 5 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	366,775,528.67 份
基金合同存续期	不定期

### 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，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，主要通过运用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。
投资策略	本基金主要策略为复制标的指数，投资组合将以标的指数的构成为基础，主要利用基金管理人自主开发的定量投资模型在有限范围内进行超配或低配。一方面严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪指数的基础上力求超越指数。基金管理人自主开发的定量投资模型充分借鉴国内外定量分析的研究成果，结合基金管理人的长期研究与实践应用，利用多因子量化模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。本基金可投资存托凭证。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times 95\%$ + 活期存款利率（税后） $\times 5\%$
风险收益特征	本基金属股票型基金中的指数增强型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228

传真	020-38798812	021-60635778
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼；广 东省珠海市横琴新区荣粤道188 号6层	北京市西城区闹市口大街1号院 1号楼
邮政编码	510620; 519031	100033
法定代表人	刘晓艳	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号 广州银行大厦 40-43 楼；广东省珠海市 横琴新区荣粤道 188 号 6 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-85,284,062.05
本期利润	12,572,818.91
加权平均基金份额本期利润	0.0343
本期加权平均净值利润率	1.52%
本期基金份额净值增长率	1.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	406,150,159.13
期末可供分配基金份额利润	1.1074
期末基金资产净值	826,989,143.06
期末基金份额净值	2.2548

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	125.48%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-3.20%	0.51%	-3.14%	0.46%	-0.06%	0.05%
过去三个月	-0.70%	0.74%	-2.03%	0.72%	1.33%	0.02%
过去六个月	1.42%	0.89%	0.88%	0.85%	0.54%	0.04%
过去一年	-9.01%	0.88%	-9.38%	0.83%	0.37%	0.05%
过去三年	-34.86%	1.08%	-32.19%	0.99%	-2.67%	0.09%
自基金合同生效起至今	125.48%	1.31%	40.02%	1.28%	85.46%	0.03%

### 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

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

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

(2012 年 7 月 5 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 125.48%，同期业绩比较基准收益率为 40.02%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王建军	本基金的基金经理，易方达量化策略精选混合、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通量化增强的基金经理，量化投资部负责人、量化投资决策委	2021-09-04	-	17 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化

	员会委员、投资经理				投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、量化投资部副总经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF 联接、易方达创业板 ETF、易方达中小板指数分级、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达重组分级的基金经理。
明朗	本基金的基金经理，量化研究员	2023-11-09	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任交通银行股份有限公司高级投资经理，易方达基金管理有限公司投资经理助理、投资经理。

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王建军	公募基金	3	988,534,824.14	2021-09-04
	私募资产管理计划	1	13,597,411,855.40	2019-07-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	4	14,585,946,679.54	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后

监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 31 次，其中 26 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，5 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。

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。

### 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，国内经济呈现复苏态势。制造业采购经理指数 PMI 在三月四月站上荣枯平衡线之上后，连续两个月跌落至荣枯平衡线之下，6 月最新的数据显示需求侧以劳动密集型产品为代表的出口动能边际回落，建筑业也处在低位。从广义货币供给 M2 指标来看，上半年的货币增速呈现趋势性下探，并在六月份创下了年内的新低，整体经济的扩张动能相对较弱。消费方面，社会消费品零售总额春节期间表现亮眼，随后出现下滑，6 月增速仅为 2%。投资方面，整体固定资产投资略有下滑，房地产投资依然呈现拖累状态，而制造业投资增速保持高位。尽管最新的 PMI 数据显示出口增速边际放缓，进出口的贸易顺差对整体经济依然呈现显著正贡献。

从股票市场来看，在国内经济弱复苏的环境下，上半年 A 股大盘先扬后抑呈现震荡走势。从宽基指数来看，上证指数收益率为-0.25%，沪深 300 指数收益率为 0.89%，中证 500 指数收益率为-8.96%，创业板指数收益率为-10.99%，风格上大盘相对小盘占优。从行业表现来看，银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业等行业表现较好，消费者服务、计算机、商贸零售、传媒、医药、房地产等行业表现较差。

报告期内，本基金依托量化选股模型，平衡中长期基本面与短期情绪指标，优选长期质地好、中短期具有性价比的公司进行均衡配置。在市场的震荡行情中，本基金积极进行调仓换股，坚持配置基本面相对优质的标的，并通过量化指标尽量减少因标的拥挤度过高带来的风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.2548 元，本报告期份额净值增长率为 1.42%，同期业绩比

较基准收益率为 0.88%。年化跟踪误差 2.46%，在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，国内经济在新旧动能切换的过程中复苏较为缓慢。一方面地产对整体经济仍然会有拖累，另一方面居民消费需求偏弱。在供给侧，新质生产力将受到政策的支持大力发展，改革开放以来积累的工程师红利将得到有效释放，叠加中国人民勤劳奋斗、追求美好生活的向往，制造业领域有望获得中长期较好发展。展望下半年的证券市场，在整体经济动能还未明显起来之前，市场大概率呈现震荡行情。就行业而言，新质生产力发展相关的领域或呈现结构性机会，如计算机、电子、医药生物等。

管理人在下阶段的投资运作中，将坚持使用基本面量化模型优选质地优良、性价比有优势的标的进行配置，重点把握市场的结构性机会。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	6.4.7.1	54,296,806.65	51,359,102.90
结算备付金		1,984,190.87	1,487,272.33
存出保证金		119,787.18	67,690.75
交易性金融资产	6.4.7.2	771,462,722.45	748,216,767.73
其中：股票投资		771,462,722.45	748,183,766.21
基金投资		-	-
债券投资		-	33,001.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		4,569,047.45	2,563,198.33
应收股利		-	-
应收申购款		529,731.08	1,443,193.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		832,962,285.68	805,137,225.99
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,487,129.97	2,673,780.73
应付赎回款		306,525.12	388,009.19
应付管理人报酬		551,654.31	533,640.12
应付托管费		103,435.19	100,057.51
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	524,398.03	313,500.72
负债合计		5,973,142.62	4,008,988.34
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	366,775,528.67	360,331,899.04
未分配利润	6.4.7.8	460,213,614.39	440,796,338.61
净资产合计		826,989,143.06	801,128,237.65
负债和净资产总计		832,962,285.68	805,137,225.99

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.2548 元，基金份额总额 366,775,528.67 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		16,684,495.41	-37,509,038.76
1.利息收入		108,701.28	105,584.44
其中：存款利息收入	6.4.7.9	108,701.28	105,584.44
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-81,335,628.64	-10,729,796.36
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-90,632,676.26	-19,704,865.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	10,060.74	210.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	9,286,986.88	8,974,859.18
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	97,856,880.96	-26,988,587.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	54,541.81	103,761.08
<b>减：二、营业总支出</b>		4,111,676.50	4,422,150.14
1. 管理人报酬		3,295,317.91	3,556,995.69
2. 托管费		617,872.11	666,936.59
3. 销售服务费		-	-
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		0.13	0.85
8. 其他费用	6.4.7.18	198,486.35	198,217.01
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>12,572,818.91</b>	<b>-41,931,188.90</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>12,572,818.91</b>	<b>-41,931,188.90</b>

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,572,818.91	-41,931,188.90

### 6.3 净资产变动表

会计主体：易方达沪深 300 量化增强证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	360,331,899.04	440,796,338.61	801,128,237.65
二、本期期初净资产	360,331,899.04	440,796,338.61	801,128,237.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,443,629.63	19,417,275.78	25,860,905.41
（一）、综合收益总额	-	12,572,818.91	12,572,818.91
（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）	6,443,629.63	6,844,456.87	13,288,086.50
其中：1.基金申购款	40,661,728.59	50,167,284.09	90,829,012.68
2.基金赎回款	-34,218,098.96	-43,322,827.22	-77,540,926.18
（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	366,775,528.67	460,213,614.39	826,989,143.06
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	337,384,760.08	538,944,970.23	876,329,730.31
二、本期期初净资产	337,384,760.08	538,944,970.23	876,329,730.31

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,468,814.33	-29,220,926.07	-21,752,111.74
（一）、综合收益总额	-	-41,931,188.90	-41,931,188.90
（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）	7,468,814.33	12,710,262.83	20,179,077.16
其中：1.基金申购款	49,602,164.67	81,653,590.32	131,255,754.99
2.基金赎回款	-42,133,350.34	-68,943,327.49	-111,076,677.83
（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	344,853,574.41	509,724,044.16	854,577,618.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达沪深 300 量化增强证券投资基金（原名易方达量化衍伸股票型证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]627 号《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金募集的批复》核准，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《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 248,871,987.37 份基金份额，其中认购资金利息折合 6,407.02 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据中国证监会 2013 年 6 月 7 日下发的《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份

额持有人大会决议的批复》（证监许可[2013]742 号），易方达量化衍伸股票型证券投资基金自 2013 年 6 月 7 日起变更为易方达沪深 300 量化增强证券投资基金，修改基金合同中基金的名称、投资目标、投资范围、投资策略、业绩比较基准、基金的费用、基金份额持有人大会、基金的信息披露等条款。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 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。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### （1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### （2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、

债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资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，股权的股息、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。

#### (4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	54,296,806.65
等于：本金	54,291,879.03
加：应计利息	4,927.62
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	54,296,806.65

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	808,533,387.54	-	771,462,722.45	-37,070,665.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券				
交易所				
市场	-	-	-	-

	银行间		-		
	市场	-		-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		808,533,387.54	-	771,462,722.45	-37,070,665.09

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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。

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	617.26
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	376,316.13
其中：交易所市场	376,316.13
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	97,464.64
其他应付款	50,000.00
合计	524,398.03

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	360,331,899.04	360,331,899.04
本期申购	40,661,728.59	40,661,728.59
本期赎回（以“-”号填列）	-34,218,098.96	-34,218,098.96
本期末	366,775,528.67	366,775,528.67

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	483,118,461.15	-42,322,122.54	440,796,338.61
本期期初	483,118,461.15	-42,322,122.54	440,796,338.61
本期利润	-85,284,062.05	97,856,880.96	12,572,818.91
本期基金份额交易产生的变动数	8,315,760.03	-1,471,303.16	6,844,456.87
其中：基金申购款	46,626,734.39	3,540,549.70	50,167,284.09
基金赎回款	-38,310,974.36	-5,011,852.86	-43,322,827.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	406,150,159.13	54,063,455.26	460,213,614.39

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	90,906.89
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	16,965.34	
其他	829.05	
合计	108,701.28	

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	-90,632,676.26
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	-90,632,676.26	

## 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,681,309,567.10
减：卖出股票成本总额	1,770,087,493.92
减：交易费用	1,854,749.44
买卖股票差价收入	-90,632,676.26

## 6.4.7.11 债券投资收益

## 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	21.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,039.63
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	10,060.74

## 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	43,065.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	32,999.35
减：应计利息总额	24.30
减：交易费用	1.72
买卖债券差价收入	10,039.63

## 6.4.7.12 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。

## 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

## 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,286,986.88
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	9,286,986.88

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	97,856,880.96
——股票投资	97,856,880.96
——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	97,856,880.96

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	54,541.81
合计	54,541.81

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	37,792.30
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,021.71
指数使用费	100,000.00
合计	198,486.35

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,348,921,842.98	39.97%	177,499,197.18	44.92%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	326,393.23	40.92%	160,015.29	42.52%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	41,055.65	46.01%	17,731.16	51.30%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。本报告期及上年度可比期间该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,295,317.91	3,556,995.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	952,413.90	1,037,026.33
应支付基金管理人的净管理费	2,342,904.01	2,519,969.36

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日

日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	617,872.11	666,936.59

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，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	54,296,806.65	90,906.89	57,849,677.82	103,397.65

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
00135	平安	2024-0	6个月	新股	17.39	20.60	184	3,199.	3,790.	-

9	电工	3-19		流通受限				76	40	
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	1,132	18,338.40	18,066.72	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月以内	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月以内	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股流通	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-

				受限						
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 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。

#### 6.4.12.4 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

本基金属股票型基金中的指数增强型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型

基金与货币市场基金。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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2023 年 12 月 31 日：0.00%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	33,001.52
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	33,001.52

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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带

来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2024 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13.3.1 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	54,296,806.65	-	-	-	54,296,806.65
结算备付金	1,984,190.87	-	-	-	1,984,190.87
存出保证金	119,787.18	-	-	-	119,787.18
交易性金融资产	-	-	-	771,462,722.45	771,462,722.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	4,569,047.45	4,569,047.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	529,731.08	529,731.08
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	56,400,784.70	-	-	776,561,500.98	832,962,285.68
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	-	-	-	4,487,129.97	4,487,129.97
应付赎回款	-	-	-	306,525.12	306,525.12
应付管理人报酬	-	-	-	551,654.31	551,654.31
应付托管费	-	-	-	103,435.19	103,435.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	524,398.03	524,398.03
负债总计	-	-	-	5,973,142.62	5,973,142.62
利率敏感度缺口	56,400,784.70	-	-	770,588,358.36	826,989,143.06
上年度末 2023 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	51,359,102.90	-	-	-	51,359,102.90
结算备付金	1,487,272.33	-	-	-	1,487,272.33
存出保证金	67,690.75	-	-	-	67,690.75
交易性金融资产	-	33,001.52	-	748,183,766.21	748,216,767.73
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,563,198.33	2,563,198.33
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,443,193.95	1,443,193.95
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,914,065.98	33,001.52	-	752,190,158.49	805,137,225.99
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	-	-	-	2,673,780.73	2,673,780.73
应付赎回款	-	-	-	388,009.19	388,009.19
应付管理人报酬	-	-	-	533,640.12	533,640.12
应付托管费	-	-	-	100,057.51	100,057.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.07	0.07
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	313,500.72	313,500.72
负债总计	-	-	-	4,008,988.34	4,008,988.34
利率敏感度缺口	52,914,065.98	33,001.52	-	748,181,170.15	801,128,237.65

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	771,462,722.45	93.29	748,183,766.21	93.39
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	771,462,722.45	93.29	748,183,766.21	93.39

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	42,180,325.39	39,122,512.15
	2.业绩比较基准下降 5%	-42,180,325.39	-39,122,512.15

#### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日
第一层次	770,923,045.47
第二层次	45,611.11
第三层次	494,065.87
合计	771,462,722.45

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	771,462,722.45	92.62
	其中：股票	771,462,722.45	92.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	56,280,997.52	6.76
8	其他各项资产	5,218,565.71	0.63
9	合计	832,962,285.68	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 7.2.1.1 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	14,420,189.20	1.74
B	采矿业	37,218,772.18	4.50
C	制造业	367,339,268.17	44.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,216,816.00	1.96
E	建筑业	14,244,033.00	1.72
F	批发和零售业	3,512,058.00	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	14,069,568.00	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,262,522.18	2.09
J	金融业	147,043,730.64	17.78
K	房地产业	13,726,929.00	1.66

L	租赁和商务服务业	971,418.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	1,960,558.13	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,193,900.16	0.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	649,179,762.66	78.50

#### 7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,254,232.00	0.27
C	制造业	76,743,166.96	9.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,456,556.00	0.42
E	建筑业	1,069,722.00	0.13
F	批发和零售业	2,091,317.60	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	7,550,849.40	0.91
H	住宿和餐饮业	1,479,940.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,467,582.11	0.54
J	金融业	14,593,185.00	1.76
K	房地产业	2,267,958.00	0.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,123,185.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	1,082,052.72	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,103,213.00	0.50

S	综合	-	-
	合计	122,282,959.79	14.79

### 7.3 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

#### 7.3.1 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	600519	贵州茅台	23,818	34,950,295.02	4.23
2	600036	招商银行	675,447	23,093,532.93	2.79
3	601318	中国平安	524,888	21,709,367.68	2.63
4	300750	宁德时代	119,507	21,514,845.21	2.60
5	601166	兴业银行	989,300	17,431,466.00	2.11
6	000333	美的集团	243,312	15,693,624.00	1.90
7	600919	江苏银行	1,910,700	14,196,501.00	1.72
8	000858	五粮液	102,200	13,085,688.00	1.58
9	601899	紫金矿业	734,374	12,902,951.18	1.56
10	601398	工商银行	1,843,100	10,505,670.00	1.27
11	600309	万华化学	119,700	9,678,942.00	1.17
12	002475	立讯精密	241,700	9,501,227.00	1.15
13	002714	牧原股份	212,682	9,272,935.20	1.12
14	000651	格力电器	226,087	8,867,132.14	1.07
15	002594	比亚迪	33,900	8,483,475.00	1.03
16	002142	宁波银行	382,100	8,429,126.00	1.02
17	002371	北方华创	24,590	7,866,095.10	0.95
18	601838	成都银行	511,000	7,762,090.00	0.94
19	000725	京东方 A	1,897,000	7,758,730.00	0.94
20	600809	山西汾酒	35,520	7,490,457.60	0.91
21	000568	泸州老窖	51,140	7,338,078.60	0.89
22	600276	恒瑞医药	183,259	7,048,141.14	0.85
23	000001	平安银行	678,174	6,883,466.10	0.83
24	600150	中国船舶	155,700	6,338,547.00	0.77
25	601600	中国铝业	824,800	6,293,224.00	0.76
26	300760	迈瑞医疗	21,304	6,197,546.64	0.75
27	601668	中国建筑	1,160,300	6,161,193.00	0.75
28	600048	保利发展	702,200	6,151,272.00	0.74
29	601138	工业富联	212,500	5,822,500.00	0.70
30	600600	青岛啤酒	78,400	5,705,168.00	0.69
31	600030	中信证券	305,215	5,564,069.45	0.67
32	300274	阳光电源	88,900	5,514,467.00	0.67

33	603501	韦尔股份	55,460	5,511,060.20	0.67
34	688008	澜起科技	95,382	5,452,035.12	0.66
35	600031	三一重工	329,700	5,440,050.00	0.66
36	300308	中际旭创	38,780	5,346,986.40	0.65
37	603993	洛阳钼业	625,300	5,315,050.00	0.64
38	600938	中国海油	157,200	5,187,600.00	0.63
39	300498	温氏股份	259,700	5,147,254.00	0.62
40	300059	东方财富	468,133	4,943,484.48	0.60
41	001979	招商蛇口	555,400	4,881,966.00	0.59
42	600893	航发动力	123,200	4,502,960.00	0.54
43	600089	特变电工	314,300	4,359,341.00	0.53
44	600941	中国移动	37,400	4,020,500.00	0.49
45	600660	福耀玻璃	82,700	3,961,330.00	0.48
46	002001	新和成	201,100	3,861,120.00	0.47
47	601989	中国重工	776,000	3,825,680.00	0.46
48	300979	华利集团	62,700	3,815,295.00	0.46
49	600346	恒力石化	270,900	3,779,055.00	0.46
50	600690	海尔智家	132,553	3,761,854.14	0.45
51	601328	交通银行	500,000	3,735,000.00	0.45
52	601985	中国核电	334,600	3,566,836.00	0.43
53	002415	海康威视	109,800	3,393,918.00	0.41
54	601390	中国中铁	512,200	3,339,544.00	0.40
55	000786	北新建材	111,700	3,313,022.00	0.40
56	601872	招商轮船	391,100	3,304,795.00	0.40
57	688111	金山办公	14,089	3,205,247.50	0.39
58	688041	海光信息	45,241	3,181,347.12	0.38
59	600905	三峡能源	727,100	3,170,156.00	0.38
60	601799	星宇股份	28,000	3,137,120.00	0.38
61	600900	长江电力	107,200	3,100,224.00	0.37
62	000938	紫光股份	136,500	3,050,775.00	0.37
63	600989	宝丰能源	175,700	3,044,881.00	0.37
64	603369	今世缘	65,100	3,007,620.00	0.36
65	601816	京沪高铁	559,300	3,003,441.00	0.36
66	000792	盐湖股份	170,000	2,966,500.00	0.36
67	601688	华泰证券	227,800	2,822,442.00	0.34
68	600028	中国石化	444,600	2,809,872.00	0.34
69	000338	潍柴动力	167,900	2,726,696.00	0.33
70	000002	万科 A	388,700	2,693,691.00	0.33
71	601857	中国石油	260,400	2,687,328.00	0.32
72	601633	长城汽车	105,900	2,679,270.00	0.32
73	600183	生益科技	127,200	2,678,832.00	0.32
74	601766	中国中车	340,000	2,553,400.00	0.31
75	601669	中国电建	455,200	2,544,568.00	0.31
76	000063	中兴通讯	88,900	2,486,533.00	0.30

77	601607	上海医药	129,500	2,474,745.00	0.30
78	000983	山西焦煤	238,200	2,455,842.00	0.30
79	300408	三环集团	80,400	2,346,876.00	0.28
80	601881	中国银河	213,400	2,317,524.00	0.28
81	600845	宝信软件	72,360	2,310,454.80	0.28
82	600760	中航沈飞	57,500	2,305,750.00	0.28
83	600926	杭州银行	173,400	2,262,870.00	0.27
84	600019	宝钢股份	339,100	2,255,015.00	0.27
85	605117	德业股份	29,960	2,227,226.40	0.27
86	601916	浙商银行	789,800	2,179,848.00	0.26
87	002252	上海莱士	278,000	2,173,960.00	0.26
88	688187	时代电气	43,142	2,130,351.96	0.26
89	601901	方正证券	273,500	2,114,155.00	0.26
90	601728	中国电信	342,500	2,106,375.00	0.25
91	601601	中国太保	75,300	2,097,858.00	0.25
92	002601	龙佰集团	111,000	2,061,270.00	0.25
93	600023	浙能电力	286,400	2,036,304.00	0.25
94	605499	东鹏饮料	9,400	2,028,050.00	0.25
95	603259	药明康德	50,027	1,960,558.13	0.24
96	603986	兆易创新	20,200	1,931,524.00	0.23
97	002271	东方雨虹	152,800	1,885,552.00	0.23
98	600406	国电南瑞	74,900	1,869,504.00	0.23
99	601988	中国银行	400,000	1,848,000.00	0.22
100	300832	新产业	27,100	1,827,624.00	0.22
101	000157	中联重科	237,000	1,820,160.00	0.22
102	601006	大秦铁路	250,000	1,790,000.00	0.22
103	600111	北方稀土	103,700	1,783,640.00	0.22
104	000100	TCL 科技	411,400	1,777,248.00	0.21
105	600887	伊利股份	68,200	1,762,288.00	0.21
106	601211	国泰君安	127,800	1,731,690.00	0.21
107	600426	华鲁恒升	65,000	1,731,600.00	0.21
108	688036	传音控股	22,477	1,720,389.58	0.21
109	600219	南山铝业	443,400	1,689,354.00	0.20
110	688981	中芯国际	36,517	1,683,433.70	0.20
111	000977	浪潮信息	45,800	1,665,746.00	0.20
112	300661	圣邦股份	20,000	1,655,600.00	0.20
113	002352	顺丰控股	46,300	1,652,447.00	0.20
114	600585	海螺水泥	70,000	1,651,300.00	0.20
115	600875	东方电气	85,200	1,571,940.00	0.19
116	601689	拓普集团	29,300	1,570,773.00	0.19
117	002241	歌尔股份	80,000	1,560,800.00	0.19
118	601066	中信建投	80,800	1,554,592.00	0.19
119	300124	汇川技术	29,900	1,533,870.00	0.19
120	300782	卓胜微	18,800	1,461,512.00	0.18

121	601117	中国化学	175,700	1,447,768.00	0.18
122	601236	红塔证券	224,300	1,440,006.00	0.17
123	688012	中微公司	10,000	1,412,600.00	0.17
124	002236	大华股份	88,500	1,368,210.00	0.17
125	300628	亿联网络	36,000	1,323,720.00	0.16
126	600011	华能国际	135,900	1,307,358.00	0.16
127	600161	天坛生物	53,100	1,295,640.00	0.16
128	600489	中金黄金	85,200	1,260,960.00	0.15
129	002648	卫星化学	70,000	1,258,600.00	0.15
130	601225	陕西煤业	48,600	1,252,422.00	0.15
131	000768	中航西飞	50,000	1,201,500.00	0.15
132	300014	亿纬锂能	30,000	1,197,600.00	0.14
133	300015	爱尔眼科	115,688	1,193,900.16	0.14
134	601919	中远海控	77,000	1,192,730.00	0.14
135	600886	国投电力	65,100	1,187,424.00	0.14
136	600050	中国联通	246,100	1,156,670.00	0.14
137	601865	福莱特	57,500	1,155,750.00	0.14
138	600436	片仔癀	5,400	1,118,718.00	0.14
139	002920	德赛西威	12,800	1,114,752.00	0.13
140	600233	圆通速递	70,700	1,106,455.00	0.13
141	600674	川投能源	59,004	1,106,325.00	0.13
142	601998	中信银行	164,100	1,099,470.00	0.13
143	601898	中煤能源	84,900	1,059,552.00	0.13
144	000661	长春高新	11,400	1,046,178.00	0.13
145	600547	山东黄金	38,000	1,040,440.00	0.13
146	600132	重庆啤酒	17,100	1,037,970.00	0.13
147	000963	华东医药	37,300	1,037,313.00	0.13
148	000538	云南白药	20,200	1,033,230.00	0.12
149	600188	兖矿能源	44,700	1,016,031.00	0.12
150	000708	中信特钢	72,500	983,825.00	0.12
151	002027	分众传媒	160,300	971,418.00	0.12
152	002311	海大集团	20,000	941,000.00	0.11
153	601100	恒立液压	20,000	931,600.00	0.11
154	688256	寒武纪	4,664	926,596.88	0.11
155	600176	中国巨石	80,000	884,000.00	0.11
156	600018	上港集团	150,000	867,000.00	0.10
157	300413	芒果超媒	41,300	863,170.00	0.10
158	603195	公牛集团	11,185	862,587.20	0.10
159	688009	中国通号	143,694	862,164.00	0.10
160	000733	振华科技	20,000	830,600.00	0.10
161	001965	招商公路	70,000	830,200.00	0.10
162	300433	蓝思科技	45,000	821,250.00	0.10
163	603833	欧派家居	15,000	803,400.00	0.10
164	603899	晨光股份	25,200	788,256.00	0.10

165	688126	沪硅产业	55,000	759,550.00	0.09
166	002493	荣盛石化	78,400	757,344.00	0.09
167	601800	中国交建	84,000	750,960.00	0.09
168	003816	中国广核	160,300	742,189.00	0.09
169	002709	天赐材料	42,000	737,520.00	0.09
170	002230	科大讯飞	15,300	657,135.00	0.08
171	300122	智飞生物	22,500	630,675.00	0.08
172	601628	中国人寿	20,000	621,000.00	0.08
173	000425	徐工机械	84,400	603,460.00	0.07
174	002938	鹏鼎控股	15,000	596,400.00	0.07
175	600196	复星医药	22,400	495,936.00	0.06
176	603019	中科曙光	11,600	481,400.00	0.06
177	600837	海通证券	54,700	468,232.00	0.06
178	688271	联影医疗	4,021	441,103.70	0.05
179	600009	上海机场	10,000	322,500.00	0.04
180	300450	先导智能	16,600	276,058.00	0.03
181	000999	华润三九	5,980	254,628.40	0.03
182	601088	中国神华	5,200	230,724.00	0.03
183	300919	中伟股份	7,220	223,747.80	0.03
184	601009	南京银行	17,000	176,630.00	0.02
185	300418	昆仑万维	3,000	96,720.00	0.01
186	600999	招商证券	4,000	55,640.00	0.01
187	300496	中科创达	1,100	50,149.00	0.01
188	002916	深南电路	100	10,577.00	0.00

## 7.3.2 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	占基金资产净值 比例（%）
1	603323	苏农银行	1,539,400	7,404,514.00	0.90
2	601156	东航物流	159,400	3,243,790.00	0.39
3	000039	中集集团	301,800	2,794,668.00	0.34
4	300251	光线传媒	266,900	2,244,629.00	0.27
5	002432	九安医疗	53,500	2,168,890.00	0.26
6	601665	齐鲁银行	441,600	2,168,256.00	0.26
7	600761	安徽合力	94,800	2,051,472.00	0.25
8	603893	瑞芯微	34,100	2,017,697.00	0.24
9	000960	锡业股份	124,900	1,934,701.00	0.23
10	000560	我爱我家	831,600	1,846,152.00	0.22
11	300856	科思股份	57,100	1,827,771.00	0.22
12	601555	东吴证券	308,000	1,817,200.00	0.22
13	600038	中直股份	42,900	1,763,619.00	0.21
14	600521	华海药业	101,700	1,733,985.00	0.21

15	600933	爱柯迪	115,800	1,712,682.00	0.21
16	300677	英科医疗	57,000	1,528,170.00	0.18
17	003020	立方制药	82,820	1,513,949.60	0.18
18	688208	道通科技	62,394	1,506,191.16	0.18
19	603606	东方电缆	30,800	1,503,348.00	0.18
20	600988	赤峰黄金	90,000	1,470,600.00	0.18
21	601198	东兴证券	166,300	1,323,748.00	0.16
22	002847	盐津铺子	30,100	1,287,377.00	0.16
23	301236	软通动力	35,200	1,239,392.00	0.15
24	601233	桐昆股份	77,000	1,228,920.00	0.15
25	002928	华夏航空	192,700	1,221,718.00	0.15
26	603338	浙江鼎力	20,000	1,208,400.00	0.15
27	603713	密尔克卫	22,000	1,177,440.00	0.14
28	688408	中信博	12,671	1,166,745.68	0.14
29	603583	捷昌驱动	56,500	1,151,470.00	0.14
30	603160	汇顶科技	16,500	1,134,375.00	0.14
31	601965	中国汽研	66,500	1,123,185.00	0.14
32	600801	华新水泥	80,000	1,100,000.00	0.13
33	603730	岱美股份	109,720	1,090,616.80	0.13
34	603871	嘉友国际	61,460	1,087,227.40	0.13
35	688625	呈和科技	29,821	1,084,291.56	0.13
36	002608	江苏国信	138,500	1,073,375.00	0.13
37	002126	银轮股份	61,600	1,072,456.00	0.13
38	600970	中材国际	88,700	1,069,722.00	0.13
39	603568	伟明环保	51,700	1,063,986.00	0.13
40	688568	中科星图	22,255	1,061,563.50	0.13
41	600418	江淮汽车	65,500	1,037,520.00	0.13
42	000690	宝新能源	200,000	1,020,000.00	0.12
42	600765	中航重机	50,000	1,020,000.00	0.12
44	688472	阿特斯	100,147	1,019,496.46	0.12
45	603589	口子窖	25,900	1,015,021.00	0.12
46	001286	陕西能源	87,700	1,011,181.00	0.12
47	600420	国药现代	94,600	1,010,328.00	0.12
48	688281	华秦科技	12,117	1,009,588.44	0.12
49	603225	新凤鸣	64,700	1,008,673.00	0.12
50	301073	君亭酒店	54,800	997,360.00	0.12
51	601677	明泰铝业	84,700	979,132.00	0.12
52	600062	华润双鹤	50,000	979,000.00	0.12
53	688150	莱特光电	50,306	975,936.40	0.12
54	300529	健帆生物	35,700	971,397.00	0.12
55	600096	云天化	50,000	971,000.00	0.12
56	002960	青鸟消防	76,600	968,224.00	0.12
57	002705	新宝股份	68,600	965,202.00	0.12
58	002150	通润装备	78,100	955,163.00	0.12

59	300487	蓝晓科技	21,900	914,544.00	0.11
60	000682	东方电子	82,100	906,384.00	0.11
61	603298	杭叉集团	45,860	900,690.40	0.11
62	601369	陕鼓动力	111,600	895,032.00	0.11
63	688789	宏华数科	8,000	862,400.00	0.10
64	002273	水晶光电	50,000	849,000.00	0.10
65	002353	杰瑞股份	24,000	841,920.00	0.10
66	002409	雅克科技	13,300	836,703.00	0.10
67	601975	招商南油	228,600	820,674.00	0.10
68	002532	天山铝业	100,000	811,000.00	0.10
69	688076	诺泰生物	10,288	805,344.64	0.10
70	002149	西部材料	57,100	797,116.00	0.10
71	603558	健盛集团	79,800	794,010.00	0.10
72	300144	宋城演艺	98,200	788,546.00	0.10
73	600546	山煤国际	53,600	783,632.00	0.09
74	301323	新莱福	24,300	767,394.00	0.09
75	600529	山东药玻	30,000	760,200.00	0.09
76	000957	中通客车	71,200	749,024.00	0.09
77	300003	乐普医疗	50,000	742,000.00	0.09
78	002444	巨星科技	30,000	741,000.00	0.09
79	601717	郑煤机	50,000	740,000.00	0.09
80	603707	健友股份	60,000	712,800.00	0.09
81	603086	先达股份	185,400	704,520.00	0.09
82	688526	科前生物	47,735	701,227.15	0.08
83	688116	天奈科技	30,000	692,400.00	0.08
84	000683	远兴能源	100,000	691,000.00	0.08
85	300049	福瑞股份	13,400	674,556.00	0.08
86	605116	奥锐特	26,900	673,307.00	0.08
87	688253	英诺特	16,705	636,627.55	0.08
88	002945	华林证券	62,700	625,746.00	0.08
89	600906	财达证券	108,700	622,851.00	0.08
90	000400	许继电气	17,900	615,939.00	0.07
91	300373	扬杰科技	15,600	606,840.00	0.07
92	000729	燕京啤酒	66,200	584,546.00	0.07
93	300783	三只松鼠	26,400	577,368.00	0.07
94	603605	珀莱雅	5,200	577,148.00	0.07
95	603198	迎驾贡酒	9,900	569,250.00	0.07
96	600549	厦门钨业	30,000	517,500.00	0.06
97	600373	中文传媒	34,100	506,044.00	0.06
98	002517	恺英网络	52,500	501,375.00	0.06
99	001301	尚太科技	11,600	501,352.00	0.06
100	301358	湖南裕能	15,800	497,068.00	0.06
101	600754	锦江酒店	21,000	482,580.00	0.06
102	300017	网宿科技	59,900	473,210.00	0.06

103	603786	科博达	6,900	442,635.00	0.05
104	002244	滨江集团	58,100	421,806.00	0.05
105	301004	嘉益股份	4,600	418,600.00	0.05
106	002790	瑞尔特	45,800	413,574.00	0.05
107	002831	裕同科技	16,100	411,999.00	0.05
108	601098	中南传媒	32,800	407,376.00	0.05
109	603105	芯能科技	40,000	352,000.00	0.04
110	601375	中原证券	97,000	330,770.00	0.04
111	300482	万孚生物	12,800	312,320.00	0.04
112	000848	承德露露	37,900	297,894.00	0.04
113	601696	中银证券	32,600	296,008.00	0.04
114	603711	香飘飘	21,200	293,620.00	0.04
115	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.03
116	300001	特锐德	10,700	215,284.00	0.03
117	002152	广电运通	16,300	170,498.00	0.02
118	000066	中国长城	18,700	163,625.00	0.02
119	601900	南方传媒	12,600	156,618.00	0.02
120	300624	万兴科技	2,937	155,866.59	0.02
121	301021	英诺激光	5,800	90,944.00	0.01
122	300394	天孚通信	1,000	88,420.00	0.01
123	300383	光环新网	9,800	82,810.00	0.01
124	002653	海思科	2,500	76,750.00	0.01
125	688513	苑东生物	1,510	75,937.90	0.01
126	688321	微芯生物	4,168	73,356.80	0.01
127	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
128	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
129	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
130	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
131	601033	永兴股份	1,132	18,066.72	0.00
132	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
133	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
134	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
135	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
136	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
137	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
138	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
139	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
140	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
141	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
142	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
143	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
144	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
145	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
146	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00

147	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
148	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
149	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
150	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
151	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
152	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
153	601136	首创证券	200	4,092.00	0.00
154	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
155	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
156	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
157	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
158	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600919	江苏银行	18,243,285.00	2.28
2	601328	交通银行	13,961,151.00	1.74
3	002142	宁波银行	13,728,235.35	1.71
4	000858	五粮液	13,349,810.00	1.67
5	000333	美的集团	12,972,399.00	1.62
6	002475	立讯精密	11,843,218.00	1.48
7	002594	比亚迪	11,587,186.00	1.45
8	001979	招商蛇口	11,542,227.00	1.44
9	000725	京东方 A	11,087,832.00	1.38
10	603993	洛阳钼业	11,028,855.00	1.38
11	000651	格力电器	10,848,530.00	1.35
12	000001	平安银行	10,842,651.00	1.35
13	000568	泸州老窖	10,734,101.23	1.34
14	601668	中国建筑	10,648,159.00	1.33
15	002714	牧原股份	10,583,638.00	1.32
16	600276	恒瑞医药	10,468,592.60	1.31
17	300783	三只松鼠	10,320,057.00	1.29
18	601398	工商银行	9,870,195.00	1.23
19	601838	成都银行	9,566,213.58	1.19
20	601088	中国神华	9,507,093.94	1.19

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。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	18,858,651.00	2.35
2	600276	恒瑞医药	12,825,847.00	1.60
3	000338	潍柴动力	12,493,544.88	1.56
4	300122	智飞生物	11,836,710.06	1.48
5	002594	比亚迪	11,739,309.30	1.47
6	600887	伊利股份	11,713,845.00	1.46
7	000100	TCL 科技	11,123,457.00	1.39
8	000858	五粮液	10,956,135.72	1.37
9	002475	立讯精密	10,943,670.88	1.37
10	601658	邮储银行	10,901,605.00	1.36
11	600519	贵州茅台	10,790,188.00	1.35
12	600406	国电南瑞	10,629,878.04	1.33
13	000002	万科 A	10,555,899.34	1.32
14	000568	泸州老窖	10,389,468.00	1.30
15	002415	海康威视	10,251,830.75	1.28
16	601088	中国神华	10,248,416.00	1.28
17	601288	农业银行	10,100,670.00	1.26
18	600919	江苏银行	10,055,081.00	1.26
19	601318	中国平安	10,045,378.00	1.25
20	601009	南京银行	9,952,738.00	1.24

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。

#### 7.4.3 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	1,695,509,569.20
卖出股票收入（成交）总额	1,681,309,567.10

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

**7.12.2** 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。

### 7.12.3 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	119,787.18
2	应收清算款	4,569,047.45
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	529,731.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,218,565.71

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 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。

##### 7.12.5.2 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
39,854	9,202.98	4,262,879.71	1.16%	362,512,648.96	98.84%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	711,324.04	0.1939%

## 8.3 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年7月5日）基金份额总额	248,871,987.37
本报告期期初基金份额总额	360,331,899.04
本报告期基金总申购份额	40,661,728.59
减：本报告期基金总赎回份额	34,218,098.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	366,775,528.67

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 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。

## 10.2 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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	4	1,348,921,842.98	39.97%	326,393.23	40.92%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	2,025,915,499.07	60.03%	471,304.30	59.08%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为东北证券股份有限公司、申港证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、汇丰前海证券有限责任公司、万联证券股份有限公司。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面

的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

#### 10.7.2 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
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	43,065.00	100.00%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-13
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-01-19
3	易方达基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-20
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报	2024-03-29
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2024-04-20
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-23

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金募集的文件；
2. 中国证监会《关于核准易方达量化衍伸股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批

复》;

- 3.《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金基金合同》;
- 4.《易方达沪深 300 量化增强证券投资基金托管协议》;
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

## 11.2 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。

## 11.3 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

二〇二四年八月三十日