

易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2025 年中期报告

2025 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年八月三十日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 4 月 8 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末投资目标基金明细	44
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.4 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	45
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.7 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	60
7.8 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	60
7.9 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	60
7.10 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	60
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61

7.13 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 备查文件目录	67
11.1 备查文件目录	67
11.2 存放地点	67
11.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	易方达上证科创板综合 ETF 联接	
基金主代码	023729	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 4 月 8 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,267,134,312.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达上证科创板综合 ETF 联接 A	易方达上证科创板综合 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	023729	023730
报告期末下属分级基金的份额总额	447,483,573.58 份	819,650,738.77 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	589800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 2 月 25 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 3 月 4 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达上证科创板综合 ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达上证科创板综合 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内，主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、股票（含存托凭证）投资策略、债券和货币市场工具投资策略、衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资业务策略等。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。
--------	--

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人可根据基金运作及指数情况决定本基金采用完全复制投资策略或抽样复制投资策略。本基金目前采用完全复制投资策略。本基金采用完全复制投资策略时，将完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金采用抽样复制投资策略时，基金管理人将依托指数投资平台，综合考虑指数成份股构成、代表性、相关性、流动性等因素，构建指数化投资组合，追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55 号

办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼； 广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510620；519031	100140
法定代表人	吴欣荣	廖林

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(2025 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日)	
	易方达上证科创板综合 ETF 联接 A	易方达上证科创板综合 ETF 联接 C
本期已实现收益	14,668,787.37	30,373,790.96
本期利润	35,805,130.26	73,419,772.76
加权平均基金份额本期利润	0.0492	0.0444
本期加权平均净值利润率	4.89%	4.42%
本期基金份额净值增长率	5.02%	4.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	易方达上证科创板综合 ETF 联接 A	易方达上证科创板综合 ETF 联接 C
期末可供分配利润	9,845,122.55	17,438,790.86
期末可供分配基金份额利润	0.0220	0.0213
期末基金资产净值	469,961,597.71	860,211,804.21
期末基金份额净值	1.0502	1.0495
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	易方达上证科创板综合	易方达上证科创板综合

	ETF 联接 A	ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	5.02%	4.95%

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 2025 年 4 月 8 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

易方达上证科创板综合 ETF 联接 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
过去一个月	5.25%	0.96%	5.43%	0.96%	-0.18%	0.00%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	5.02%	0.83%	17.14%	1.10%	-12.12%	-0.27%

易方达上证科创板综合 ETF 联接 C

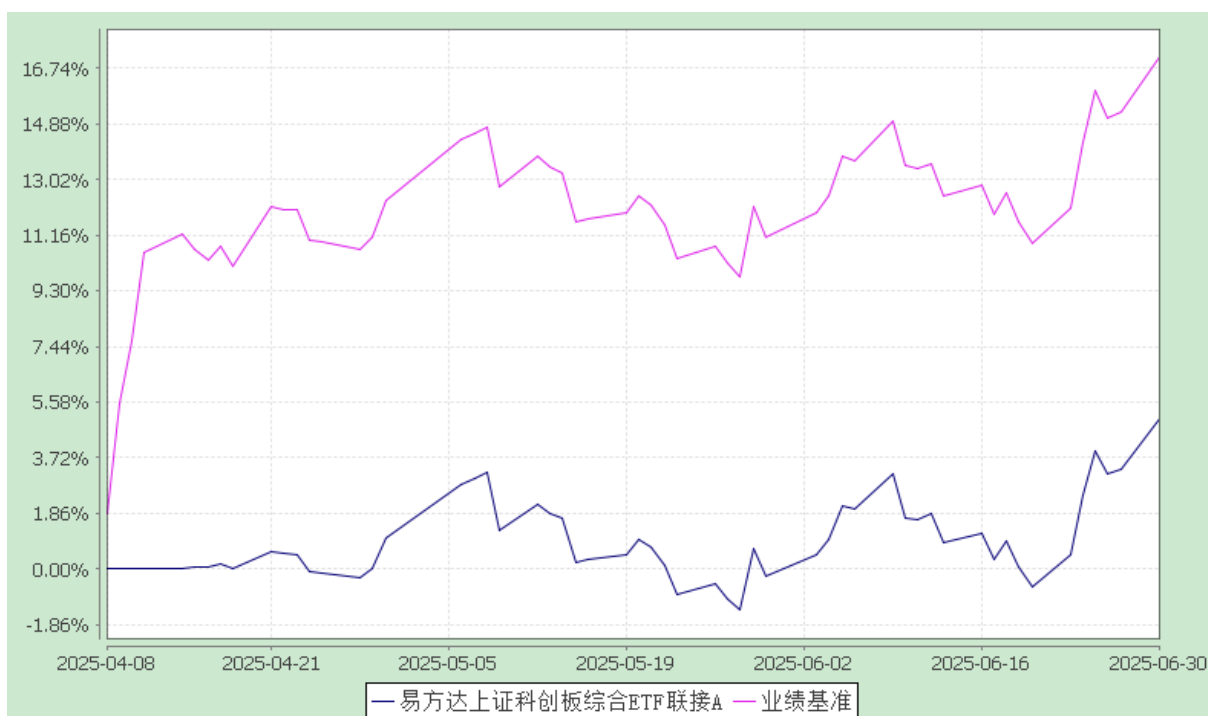
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.23%	0.96%	5.43%	0.96%	-0.20%	0.00%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.95%	0.83%	17.14%	1.10%	-12.19%	-0.27%

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

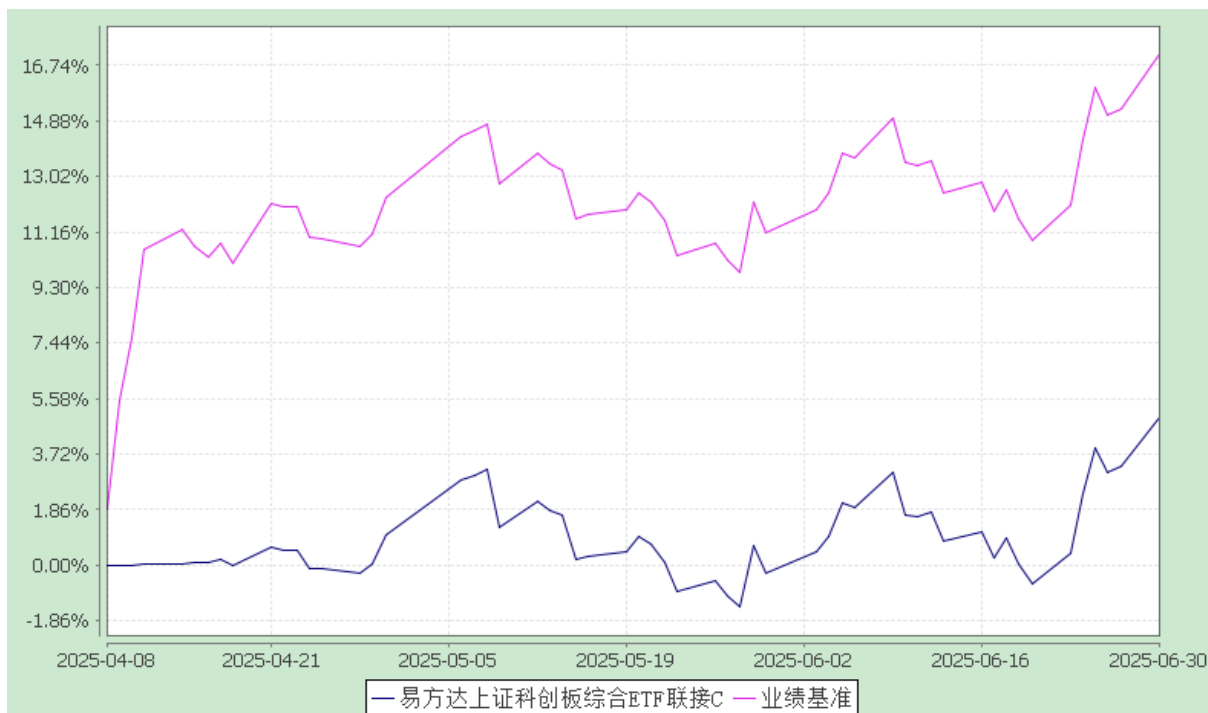
易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2025 年 4 月 8 日至 2025 年 6 月 30 日）

易方达上证科创板综合 ETF 联接 A



易方达上证科创板综合 ETF 联接 C



注：1.本基金合同于 2025 年 4 月 8 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，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

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 5.02%，同期业绩比较基准收益率为

17.14%；C 类基金份额净值增长率为 4.95%，同期业绩比较基准收益率为 17.14%。

§ 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		
庞亚平	本基金的基金经理，易方达沪深 300ETF 联接、易方达沪深 300ETF、易方达中证 500ETF 联接、易方达中证 500ETF、易方达北证 50 成份指数、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证 1000ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证 A100ETF、易方达上证科创板成长 ETF、易方达中证家电龙头 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 100ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达中证 A500ETF 联接、易方达中证 A500ETF 的基金经理，指数研究部总经理、指数投资决策委员会委员	2025-04-08	-	16 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中证指数有限公司研发部研究员、市场部主管，华夏基金管理有限公司研究员、投资经理、基金经理、数量投资部总监，易方达基金管理有限公司易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达中证光伏产业指数发起式、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式的基金经理。
李博扬	本基金的基金经理助理，易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证龙头企业指数、易方达上证 180ETF、易方达上证 180ETF 联接、易方达上证科创板综合 ETF、易方达上证科创板人工智能 ETF 联接、易方达上证科创板 200ETF、易方达中证消费电子主题 ETF 联接发起式的基金经理，易方达恒生 ETF	2025-05-08	-	5 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任南方基金管理股份有限公司量化交易员、量化及指数研究员，易方达基金管理有限公司研究员。

	(QDII)、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证沪深港黄金产业股票指数发起式、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证消费电子主题 ETF 联接发起式（自 2024 年 12 月 14 日至 2025 年 04 月 28 日）、易方达中证生物科技主题 ETF（自 2024 年 12 月 14 日至 2025 年 04 月 28 日）的基金经理助理				
--	---	--	--	--	--

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。

4.2 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 38 次，其中 31 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，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。

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

本基金为易方达上证科创板综合 ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资易方达上证科创板综合 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达上证科创板综合 ETF 跟踪上证科创板综合指数，该指数由上海证券交易所符合条件的科创板上市公司证券组成指数样本，并将样本分红计入指数收益，反映上海证券交易所科创板上市公司证券在计入分红收益后的整体表现。

2025 年上半年，在更加积极有为的宏观政策支持下，中国经济运行呈现出总体平稳、稳中向好的态势。上半年 GDP 同比增长 5.3%，高于去年同期及全年增速 0.3 个百分点，政策效果逐步显现。消费方面，上半年社会消费品零售总额同比增长 5.0%，比一季度加快 0.4 个百分点。其中，服务零售额同比增长 5.3%，比一季度加快 0.3 个百分点，表现亮眼。投资方面，上半年房地产投资拖累明显，但高技术产业投资表现亮眼。上半年全国固定资产投资同比增长 2.8%，扣除房地产开发投资后，全国固定资产投资增长 6.6%。高技术产业中，航空、航天器及设备制造业，计算机及办公设备制造业投资同比分别增长 26.3%、21.5%。外贸方面，上半年货物进出口总额同比增长 2.9%，其中出口增长 7.2%，韧性凸显。在出口产品结构中，机电产品出口增长 9.5%，占出口总额的比重为 60.0%，高新技术产品竞争优势持续显现。总体来看，2025 年上半年我国新质生产力加速形成，高质量发展扎实推进，宏观经济展现出强大韧性与活力。但也要看到，外部不稳定因素较多，国内有效需求不足，经济回升向好基础仍需加力巩固。

资本市场方面，上半年 A 股市场在震荡中走强，整体呈现指数稳步抬升、主题快速轮动、资金持续活跃的特征。一季度，受人工智能技术突破催化，市场震荡上行。二季度，虽然初期受海外关税政策冲击，市场快速见底，但随着关税冲击放缓、相应政策迅速出台，在银行、创新药等板块带动下，市场重新回到稳步上涨的态势。受益于 AI 技术突破催化、创新药出海等成长板块利好影响，2025 年上半年，上证科创板综合指数上涨 9.93%。

本报告期内本基金仍处于建仓期，建仓期间内本基金采取相对灵活以及审慎的建仓策略，在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下进行建仓工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0502 元，本报告期份额净值增长率为 5.02%，同期业绩比较基准收益率为 17.14%；C 类基金份额净值为 1.0495 元，本报告期份额净值增长率为 4.95%，

同期业绩比较基准收益率为 17.14%。受建仓期影响，年化跟踪误差 11.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中国经济增长基础稳固，政策空间充足，有望延续内需托底、政策护航、结构优化的发展路径，经济增长目标有望维持稳定。2025 年上半年，内需对经济增长贡献显著，物价与就业温和改善。6 月 CPI 同比由负转正至 0.1%，政策端已部署反内卷措施，推动价格低位温和回升，通缩压力有望边际缓解。同时，财政和货币政策余量充足，有望进一步拉动内需、降低实体融资成本。投资方面，超长期特别国债将重点支持“两重两新”战略部署，制造业投资增速有望保持较高水平。消费方面，服务消费持续活跃，下半年有望迎来以旧换新补贴、文旅免签等政策。出口方面，多元化市场战略成效显著，对美贸易依赖度有望进一步降低。但也要看到，内外部环境的不确定将带来一定挑战。比如，房地产风险化解需增量政策协同，通缩压力缓解需持续改善企业盈利预期，地缘政治风险需妥善处置。

资本市场方面，受益于反内卷供给侧改革、服务业支持政策、资本市场制度改革等利好，A 股市场有望迎来新机遇。在财政增量政策、货币宽松和中长期资金入市背景下，A 股资金面有望迎来进一步改善。在 AI 与机器人产业升级、新消费崛起的进程中，产业趋势有望引领市场进一步走强。科创板上市公司受益于 AI 技术发展、芯片国产替代、创新药出海等利好催化，有望延续良好表现。

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程序和技术，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

易方达上证科创板综合 ETF 联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达上证科创板综合 ETF 联接 C: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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	68,363,156.09
结算备付金		30,443.34
存出保证金		548,757.75
交易性金融资产	6.4.7.2	1,262,736,809.50
其中：股票投资		64,140,527.76
基金投资		1,198,578,281.03

债券投资		18,000.71
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		25,718,838.78
应收股利		-
应收申购款		1,287,594.90
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		1,358,685,600.36
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
负债：		
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		-
应付赎回款		27,551,959.89
应付管理人报酬		19,116.01
应付托管费		6,372.00
应付销售服务费		256,499.54
应付投资顾问费		-
应交税费		373,383.93
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	304,867.07
负债合计		28,512,198.44
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	1,267,134,312.35
未分配利润	6.4.7.8	63,039,089.57
净资产合计		1,330,173,401.92
负债和净资产总计		1,358,685,600.36

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 4 月 8 日，2025 年半年度实际报告期间为 2025 年 4 月 8 日至 2025 年 6 月 30 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 2025 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0502 元，C 类基金份额净值 1.0495 元；基金份额总额 1,267,134,312.35 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额

447,483,573.58 份，C 类基金份额总额 819,650,738.77 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		110,820,120.83
1.利息收入		1,696,991.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	466,744.64
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		1,230,247.24
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		44,914,258.42
其中：股票投资收益	6.4.7.10	13,040,963.91
基金投资收益	6.4.7.11	31,654,270.09
债券投资收益	6.4.7.12	2,697.55
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	216,326.87
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	64,182,324.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	26,545.84
减：二、营业总支出		1,595,217.81
1. 管理人报酬		310,692.63
2. 托管费		103,564.19
3. 销售服务费		1,106,150.94
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	6.4.7.18	-
7. 税金及附加		60,057.55
8. 其他费用	6.4.7.19	14,752.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		109,224,903.02
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		109,224,903.02
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		109,224,903.02

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 8 日，2025 年半年度实际报告期间为 2025 年 4 月 8 日至 2025 年 6 月 30 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。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2025 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 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	-	-	-
二、本期期初净资产	4,362,490,455.33	-	4,362,490,455.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,095,356,142.98	63,039,089.57	-3,032,317,053.41
（一）、综合收益总额	-	109,224,903.02	109,224,903.02
（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）	-3,095,356,142.98	-46,185,813.45	-3,141,541,956.43
其中：1.基金申购款	165,614,005.43	2,221,674.44	167,835,679.87
2.基金赎回款	-3,260,970,148.41	-48,407,487.89	-3,309,377,636.30
（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	1,267,134,312.35	63,039,089.57	1,330,173,401.92

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 8 日，2025 年半年度实际报告期间为 2025 年 4 月 8 日至

2025 年 6 月 30 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 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：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铨

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2025]459 号《关于准予易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》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《易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2025 年 4 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,362,490,455.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,183,491.51 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2025 年 3 月 17 日至 2025 年 4 月 3 日，募集金额总额为人民币 4,362,490,455.33 元，其中：有效净认购金额为人民币 4,360,306,963.82 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 2,183,491.51 元，经安永华明（2025）验字第 70013033_G10 号验资报告予以审验。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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 2025 年 4 月 8 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)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；

(2)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；

(3)本基金可对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，并可根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(4)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人履行适当程序后，可调整基金收益的分配原则和支付方式；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	68,363,156.09
等于：本金	68,356,500.09
加：应计利息	6,656.00
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	68,363,156.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		61,985,057.45	-	64,140,527.76	2,155,470.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,999.92	0.79	18,000.71	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,999.92	0.79	18,000.71	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,136,551,426.65	-	1,198,578,281.03	62,026,854.38
其他		-	-	-	-
合计		1,198,554,484.02	0.79	1,262,736,809.50	64,182,324.69

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.60
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	297,029.95
其中：交易所市场	297,029.95
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	7,835.52
合计	304,867.07

6.4.7.7 实收基金

易方达上证科创板综合 ETF 联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,139,474,669.57	1,139,474,669.57
本期申购	35,451,024.46	35,451,024.46
本期赎回（以“-”号填列）	-727,442,120.45	-727,442,120.45
本期末	447,483,573.58	447,483,573.58

易方达上证科创板综合 ETF 联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,223,015,785.76	3,223,015,785.76
本期申购	130,162,980.97	130,162,980.97
本期赎回（以“-”号填列）	-2,533,528,027.96	-2,533,528,027.96
本期末	819,650,738.77	819,650,738.77

注：1.本基金合同于 2025 年 4 月 8 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,362,490,455.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,183,491.51 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。

6.4.7.8 未分配利润

易方达上证科创板综合 ETF 联接 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	14,668,787.37	21,136,342.89	35,805,130.26
本期基金份额交易产生的变动数	-4,823,664.82	-8,503,441.31	-13,327,106.13
其中：基金申购款	349,819.85	194,026.16	543,846.01
基金赎回款	-5,173,484.67	-8,697,467.47	-13,870,952.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,845,122.55	12,632,901.58	22,478,024.13

易方达上证科创板综合 ETF 联接 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	30,373,790.96	43,045,981.80	73,419,772.76
本期基金份额交易产生的变动数	-12,935,000.10	-19,923,707.22	-32,858,707.32
其中：基金申购款	1,383,549.94	294,278.49	1,677,828.43
基金赎回款	-14,318,550.04	-20,217,985.71	-34,536,535.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,438,790.86	23,122,274.58	40,561,065.44

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	456,561.78
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	9,342.29
其他	840.57
合计	466,744.64

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 2025 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	540,944.50
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	12,500,019.41
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	13,040,963.91

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 2025 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	641,825,995.56
减：卖出股票成本总额	640,476,940.78
减：交易费用	808,110.28
买卖股票差价收入	540,944.50

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	2,257,188,400.00
减：现金支付申购款总额	5,914,144.14
减：申购股票成本总额	2,238,774,236.45
减：交易费用	-
申购差价收入	12,500,019.41

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,316,083,939.67
减：卖出/赎回基金成本总额	1,283,869,751.70
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	500,479.54
减：交易费用	59,438.34
基金投资收益	31,654,270.09

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,696.84
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	2,697.55

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	122,892.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	119,692.30
减：应计利息总额	498.48
减：交易费用	4.79
买卖债券差价收入	2,696.84

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	216,326.87
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	216,326.87

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日
1.交易性金融资产	64,182,324.69
——股票投资	2,155,470.31
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	62,026,854.38
——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	64,182,324.69

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日
基金赎回费收入	25,853.38
其他	692.46
合计	26,545.84

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日
审计费用	7,835.52
信息披露费	-
证券出借违约金	-
存托服务费	33.21
银行汇划费	6,483.77
其他	400.00
合计	14,752.50

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

中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东
易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

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	
	2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,305,729,723.10	43.96%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	3,500,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
广发证券	87.70	0.00%

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025年4月8日（基金合同生效日）至2025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	130,572.95	43.96%	130,572.95	43.96%

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

2.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

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

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 2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	310,692.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	392,154.52
应支付基金管理人的净管理费	-81,461.89

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为调整后的前一日的基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值=前一日基金资产净值—前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

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，自动在次月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2.对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	103,564.19

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为调整后的前一日的基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

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，自动在次月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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		
	2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达上证科创板综合ETF联接A	易方达上证科创板综合ETF联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	3,526.15	3,526.15
中国工商银行	-	999,386.12	999,386.12
合计	-	1,002,912.27	1,002,912.27

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

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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，自动在次月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

易方达上证科创板综合 ETF 联接 A

无。

易方达上证科创板综合 ETF 联接 C

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	
	2025年4月8日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	68,363,156.09	456,561.78

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

6.4.10.7 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。

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

于本报告期末，本基金持有 1,230,699,539 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 49.71%。

6.4.11 利润分配情况

易方达上证科创板综合 ETF 联接 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达上证科创板综合 ETF 联接 C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2025 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
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
6.4.12.1.2 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
118056	路维转债	2025-06-12	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.01	60	6,000.00	6,000.50	-
118057	甬矽转债	2025-06-27	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	120	12,000.00	12,000.21	-

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

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
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	4,374	145,391.58	166,430.70	-

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 2025 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 2025 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。

本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。

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 2025 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%。

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 2025年6月30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企业发行的债券。

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 2025年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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 2025年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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 2025年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	18,000.71
未评级	0.00
合计	18,000.71

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

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
--------	-----

	2025年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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 2025年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	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 2025 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约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 2025 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	68,363,156.09	-	-	-	68,363,156.09
结算备付金	30,443.34	-	-	-	30,443.34
存出保证金	548,757.75	-	-	-	548,757.75
交易性金融资产	-	-	18,000.71	1,262,718,808.79	1,262,736,809.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	25,718,838.78	25,718,838.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,287,594.90	1,287,594.90
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	68,942,357.18	-	18,000.71	1,289,725,242.47	1,358,685,600.36

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	-	-	-	27,551,959.89	27,551,959.89
应付管理人报酬	-	-	-	19,116.01	19,116.01
应付托管费	-	-	-	6,372.00	6,372.00
应付销售服务费	-	-	-	256,499.54	256,499.54
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	373,383.93	373,383.93
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	304,867.07	304,867.07
负债总计	-	-	-	28,512,198.44	28,512,198.44
					44
利率敏感度缺口	68,942,357.18	-	18,000.71	1,261,213,044.03	1,330,173,401.92

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。本基金主要投资于跟踪的目标 ETF、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 2025 年 6 月 30 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	64,140,527.76	4.82
交易性金融资产—基金投资	1,198,578,281.03	90.11
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	1,262,718,808.79	94.93

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 2025 年 6 月 30 日
	1.业绩比较基准上升 5%	14,472,014.66
	2.业绩比较基准下降 5%	-14,472,014.66

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	1,262,478,883.46
第二层次	184,431.41
第三层次	73,494.63

合计	1,262,736,809.50
----	------------------

6.4.14.2.2 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。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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

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。

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	64,140,527.76	4.72
	其中：股票	64,140,527.76	4.72
2	基金投资	1,198,578,281.03	88.22
3	固定收益投资	18,000.71	0.00
	其中：债券	18,000.71	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	68,393,599.43	5.03
8	其他各项资产	27,555,191.43	2.03
9	合计	1,358,685,600.36	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	1,198,578,281.03	90.11

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	51,426,102.59	3.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,401,480.64	0.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,091,724.93	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	221,219.60	0.02

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	-	-
S	综合	-	-
	合计	64,140,527.76	4.82

7.4 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

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	688041	海光信息	20,987	2,965,253.23	0.22
2	688256	寒武纪	3,770	2,267,655.00	0.17
3	688981	中芯国际	17,953	1,582,916.01	0.12
4	688111	金山办公	4,182	1,171,169.10	0.09
5	688506	百利天恒	3,621	1,072,250.52	0.08
6	688012	中微公司	5,747	1,047,678.10	0.08
7	688271	联影医疗	7,578	968,013.72	0.07
8	688008	澜起科技	10,526	863,132.00	0.06
9	688036	传音控股	10,486	835,734.20	0.06
10	688396	华润微	11,987	565,306.92	0.04
11	688047	龙芯中科	3,621	483,005.19	0.04
12	688223	晶科能源	90,336	468,843.84	0.04
13	688126	沪硅产业	24,804	464,330.88	0.03
14	688082	盛美上海	3,985	454,050.90	0.03
15	688608	恒玄科技	1,262	439,150.76	0.03
16	688521	芯原股份	4,523	436,469.50	0.03
17	688303	大全能源	19,369	412,947.08	0.03
18	688072	拓荆科技	2,667	409,944.57	0.03
19	688009	中国通号	77,839	400,092.46	0.03
20	688183	生益电子	7,649	391,628.80	0.03
21	689009	九号公司	6,596	390,285.32	0.03
22	688169	石头科技	2,467	386,208.85	0.03
23	688617	惠泰医疗	1,297	385,209.00	0.03
24	688120	华海清科	2,257	380,755.90	0.03
25	688578	艾力斯	4,063	378,021.52	0.03
26	688213	思特威	3,629	370,956.38	0.03
27	688249	晶合集成	18,114	367,170.78	0.03
28	688188	柏楚电子	2,750	362,065.00	0.03
29	688728	格科微	23,481	361,607.40	0.03

30	688187	时代电气	7,990	340,773.50	0.03
31	688297	中无人机	6,207	331,453.80	0.02
32	688375	国博电子	5,481	328,914.81	0.02
33	688777	中控技术	7,270	326,495.70	0.02
34	688065	凯赛生物	6,632	312,367.20	0.02
35	688122	西部超导	5,974	309,931.12	0.02
36	688336	三生国健	5,672	307,649.28	0.02
37	688472	阿特斯	33,301	304,704.15	0.02
38	688469	芯联集成	63,826	304,450.02	0.02
39	688027	国盾量子	1,101	302,786.01	0.02
40	688220	翱捷科技	3,777	295,739.10	0.02
41	688538	和辉光电	124,888	292,237.92	0.02
42	688002	睿创微纳	4,117	287,037.24	0.02
43	688599	天合光能	19,678	285,921.34	0.02
44	688235	百济神州	1,209	282,470.76	0.02
45	688525	佰维存储	4,165	280,721.00	0.02
46	688318	财富趋势	2,442	280,634.64	0.02
47	688349	三一重能	11,074	276,185.56	0.02
48	688266	泽璟制药	2,524	271,355.24	0.02
49	688099	晶晨股份	3,803	270,051.03	0.02
50	688568	中科星图	7,444	268,058.44	0.02
51	688278	特宝生物	3,673	264,860.03	0.02
52	688361	中科飞测	3,051	256,863.69	0.02
53	688819	天能股份	8,939	248,146.64	0.02
54	688192	迪哲医药	4,148	248,050.40	0.02
55	688114	华大智造	3,761	243,825.63	0.02
56	688582	芯动联科	3,619	243,196.80	0.02
57	688692	达梦数据	1,080	240,721.20	0.02
58	688520	神州细胞	4,021	240,656.85	0.02
59	688180	君实生物	7,047	239,457.06	0.02
60	688385	复旦微电	4,850	238,959.50	0.02
61	688629	华丰科技	4,163	238,123.60	0.02
62	688019	安集科技	1,545	234,531.00	0.02
63	688563	航材股份	4,063	230,087.69	0.02
64	688475	萤石网络	7,241	228,236.32	0.02
65	688234	天岳先进	3,880	227,174.00	0.02
66	688702	盛科通信	3,702	226,118.16	0.02
67	688052	纳芯微	1,287	224,568.63	0.02
68	688363	华熙生物	4,350	223,372.50	0.02
69	688561	奇安信	6,300	214,074.00	0.02
70	688172	燕东微	10,861	213,527.26	0.02
71	688322	奥比中光	3,612	213,144.12	0.02
72	688778	厦钨新能	3,800	212,496.00	0.02

73	688018	乐鑫科技	1,441	210,530.10	0.02
74	688017	绿的谐波	1,685	210,439.65	0.02
75	688166	博瑞医药	3,818	205,064.78	0.02
76	688331	荣昌生物	3,385	204,792.50	0.02
77	688347	华虹公司	3,682	202,178.62	0.02
78	688037	芯源微	1,850	198,320.00	0.01
79	688425	铁建重工	48,156	196,476.48	0.01
80	688536	思瑞浦	1,394	193,375.68	0.01
81	688709	成都华微	5,856	191,725.44	0.01
82	688502	茂莱光学	663	190,718.58	0.01
83	688208	道通科技	6,163	188,587.80	0.01
84	688279	峰岬科技	1,010	187,355.00	0.01
85	688498	源杰科技	949	185,055.00	0.01
86	688200	华峰测控	1,223	176,356.60	0.01
87	688088	虹软科技	3,623	174,809.75	0.01
88	688387	信科移动	30,868	174,404.20	0.01
89	688295	中复神鹰	8,276	172,140.80	0.01
90	688382	益方生物	5,222	171,386.04	0.01
91	688343	云天励飞	3,386	167,336.12	0.01
92	688313	仕佳光子	4,374	166,430.70	0.01
93	688100	威胜信息	4,440	164,502.00	0.01
94	688301	奕瑞科技	1,841	161,290.01	0.01
95	688409	富创精密	2,920	160,629.20	0.01
96	688248	南网科技	5,099	160,414.54	0.01
97	688567	孚能科技	11,035	160,007.50	0.01
98	688116	天奈科技	3,494	159,920.38	0.01
99	688281	华秦科技	2,599	157,265.49	0.01
100	688333	铂力特	2,591	154,319.96	0.01
101	688484	南芯科技	3,842	151,951.10	0.01
102	688798	艾为电子	2,219	151,335.80	0.01
103	688772	珠海冠宇	10,409	148,744.61	0.01
104	688522	纳睿雷达	2,889	147,974.58	0.01
105	688005	容百科技	6,572	146,687.04	0.01
106	688068	热景生物	1,011	141,681.54	0.01
107	688676	金盘科技	4,147	138,717.15	0.01
108	688146	中船特气	4,780	138,189.80	0.01
109	688433	华曙高科	3,740	137,445.00	0.01
110	688198	佰仁医疗	1,310	134,523.90	0.01
111	688327	云从科技	9,550	131,694.50	0.01
112	688631	莱斯信息	1,476	131,659.20	0.01
113	688141	杰华特	4,035	131,460.30	0.01
114	688332	中科蓝讯	1,264	130,293.12	0.01
115	688032	禾迈股份	1,301	129,917.86	0.01

116	688552	航天南湖	3,215	128,310.65	0.01
117	688147	微导纳米	4,164	125,669.52	0.01
118	688432	有研硅	11,265	124,365.60	0.01
119	688686	奥普特	1,285	122,871.70	0.01
120	688352	硕中科技	10,933	122,777.59	0.01
121	688110	东芯股份	3,994	122,456.04	0.01
122	688776	国光电气	1,150	121,302.00	0.01
123	688789	宏华数科	1,650	120,516.00	0.01
124	688153	唯捷创芯	3,886	120,504.86	0.01
125	688165	埃夫特	4,712	120,250.24	0.01
126	688050	爱博医疗	1,744	120,074.40	0.01
127	688548	广钢气体	11,913	119,368.26	0.01
128	688123	聚辰股份	1,454	117,759.46	0.01
129	688029	南微医学	1,728	116,726.40	0.01
130	688190	云路股份	1,261	116,718.16	0.01
131	688543	国科军工	1,936	116,527.84	0.01
132	688400	凌云光	4,163	114,773.91	0.01
133	688016	心脉医疗	1,295	114,503.90	0.01
134	688206	概伦电子	3,930	114,284.40	0.01
135	688097	博众精工	4,033	112,561.03	0.01
136	688326	经纬恒润	1,261	112,531.64	0.01
137	688700	东威科技	2,845	112,235.25	0.01
138	688055	龙腾光电	30,097	111,358.90	0.01
139	688591	泰凌微	2,296	109,978.40	0.01
140	688630	芯碁微装	1,385	109,927.45	0.01
141	688362	甬矽电子	3,688	109,828.64	0.01
142	688584	上海合晶	6,119	109,407.72	0.01
143	688306	均普智能	11,090	109,125.60	0.01
144	688006	杭可科技	5,551	108,244.50	0.01
145	688076	诺泰生物	2,895	107,751.90	0.01
146	688300	联瑞新材	2,302	107,158.10	0.01
147	688289	圣湘生物	5,232	107,151.36	0.01
148	688439	振华风光	1,839	107,121.75	0.01
149	688063	派能科技	2,340	105,487.20	0.01
150	688660	电气风电	12,039	104,498.52	0.01
151	688549	中巨芯	13,339	103,243.86	0.01
152	688656	浩欧博	753	102,257.40	0.01
153	688107	安路科技	3,620	102,228.80	0.01
154	688062	迈威生物	3,608	102,034.24	0.01
155	688519	南亚新材	2,274	101,875.20	0.01
156	688612	威迈斯	3,801	101,638.74	0.01
157	688001	华兴源创	4,022	101,635.94	0.01
158	688390	固德威	2,313	100,499.85	0.01

159	688083	中望软件	1,560	100,479.60	0.01
160	688516	奥特维	3,009	100,019.16	0.01
161	688182	灿勤科技	3,612	99,546.72	0.01
162	688739	成大生物	3,761	99,290.40	0.01
163	688380	中微半导	3,615	97,966.50	0.01
164	688443	智翔金泰	3,496	96,979.04	0.01
165	688161	威高骨科	3,612	96,765.48	0.01
166	688503	聚和材料	2,308	95,528.12	0.01
167	688779	五矿新能	17,419	94,759.36	0.01
168	688232	新点软件	3,146	94,505.84	0.01
169	688596	正帆科技	2,785	94,467.20	0.01
170	688408	中信博	2,015	94,060.20	0.01
171	688131	皓元医药	1,940	93,799.00	0.01
172	688177	百奥泰	3,739	93,699.34	0.01
173	688139	海尔生物	3,032	93,658.48	0.01
174	688127	蓝特光学	3,641	93,610.11	0.01
175	688048	长光华芯	1,621	93,596.54	0.01
176	688486	龙迅股份	1,395	93,297.60	0.01
177	688158	优刻得	4,120	93,194.40	0.01
178	688696	极米科技	814	93,089.04	0.01
179	688800	瑞可达	1,892	93,086.40	0.01
180	688151	华强科技	3,285	92,604.15	0.01
181	688698	伟创电气	1,944	91,756.80	0.01
182	688270	臻镭科技	1,969	91,676.64	0.01
183	688366	昊海生科	1,785	91,463.40	0.01
184	688205	德科立	1,446	90,649.74	0.01
185	688102	斯瑞新材	6,688	90,154.24	0.01
186	688627	精智达	1,024	90,122.24	0.01
187	688252	天德钰	3,693	90,035.34	0.01
188	688150	莱特光电	3,634	89,832.48	0.01
189	688128	中国电研	3,653	89,498.50	0.01
190	688091	上海谊众	1,901	88,928.78	0.01
191	688652	京仪装备	1,545	88,559.40	0.01
192	688321	微芯生物	3,682	87,557.96	0.01
193	688531	日联科技	1,203	86,134.80	0.01
194	688262	国芯科技	3,204	85,450.68	0.01
195	688368	晶丰明源	970	85,195.10	0.01
196	688766	普冉股份	1,334	84,308.80	0.01
197	688351	微电生理	4,249	83,705.30	0.01
198	688690	纳微科技	3,646	83,238.18	0.01
199	688515	裕太微	901	82,531.60	0.01
200	688392	骄成超声	1,207	82,232.91	0.01
201	688586	江航装备	7,277	81,866.25	0.01

202	688003	天准科技	1,781	81,747.90	0.01
203	688138	清溢光电	3,001	81,597.19	0.01
204	688105	诺唯赞	3,592	81,286.96	0.01
205	688372	伟测科技	1,340	80,936.00	0.01
206	688160	步科股份	936	80,215.20	0.01
207	688167	炬光科技	992	80,104.00	0.01
208	688570	天玛智控	3,910	80,076.80	0.01
209	688403	汇成股份	7,705	80,054.95	0.01
210	688049	炬芯科技	1,320	79,860.00	0.01
211	688523	航天环宇	3,674	79,027.74	0.01
212	688276	百克生物	3,735	78,435.00	0.01
213	688668	鼎通科技	1,253	78,262.38	0.01
214	688691	灿芯股份	1,261	78,005.46	0.01
215	688535	华海诚科	907	77,992.93	0.01
216	688305	科德数控	1,397	77,966.57	0.01
217	688106	金宏气体	4,352	77,857.28	0.01
218	688717	艾罗能源	1,445	77,784.35	0.01
219	688093	世华科技	2,504	77,749.20	0.01
220	688787	海天瑞声	729	77,405.22	0.01
221	688658	悦康药业	4,063	77,359.52	0.01
222	688559	海目星	2,351	77,347.90	0.01
223	688388	嘉元科技	3,849	77,287.92	0.01
224	688508	芯朋微	1,380	77,031.60	0.01
225	688084	晶品特装	863	75,944.00	0.01
226	688639	华恒生物	2,381	75,477.70	0.01
227	688575	亚辉龙	5,151	75,153.09	0.01
228	688225	亚信安全	3,612	73,648.68	0.01
229	688685	迈信林	1,314	73,386.90	0.01
230	688159	有方科技	1,006	72,100.02	0.01
231	688507	索辰科技	981	71,936.73	0.01
232	688185	康希诺	1,206	71,913.78	0.01
233	688209	英集芯	3,877	71,608.19	0.01
234	688025	杰普特	999	71,428.50	0.01
235	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
236	688136	科兴制药	1,836	70,171.92	0.01
237	688212	澳华内镜	1,414	69,286.00	0.01
238	688230	芯导科技	1,236	68,511.48	0.01
239	688550	瑞联新材	1,583	68,084.83	0.01
240	688095	福昕软件	1,001	67,977.91	0.01
241	688155	先惠技术	1,314	67,828.68	0.01
242	688593	新相微	4,150	67,769.50	0.01
243	688562	航天软件	3,612	67,688.88	0.01
244	688513	苑东生物	1,624	66,681.44	0.01

245	688311	盟升电子	1,544	66,469.20	0.00
246	688518	联赢激光	3,254	66,349.06	0.00
247	688788	科思科技	1,445	65,993.15	0.00
248	688526	科前生物	4,209	65,576.22	0.00
249	688320	禾川科技	1,364	64,503.56	0.00
250	688622	禾信仪器	814	64,037.38	0.00
251	688268	华特气体	1,265	63,718.05	0.00
252	688337	普源精电	1,785	63,670.95	0.00
253	688626	翔宇医疗	1,445	63,608.90	0.00
254	688499	利元亨	1,524	63,413.64	0.00
255	688103	国力股份	1,035	62,969.40	0.00
256	688553	汇宇制药	3,825	62,309.25	0.00
257	688707	振华新材	4,594	62,248.70	0.00
258	688023	安恒信息	1,096	62,187.04	0.00
259	688428	诺诚健华	2,539	62,027.77	0.00
260	688348	昱能科技	1,437	61,747.89	0.00
261	688239	航宇科技	1,765	61,739.70	0.00
262	688401	路维光电	1,778	61,696.60	0.00
263	688258	卓易信息	1,273	61,651.39	0.00
264	688168	安博通	865	61,302.55	0.00
265	688195	腾景科技	1,359	61,155.00	0.00
266	688196	卓越新能	1,261	60,616.27	0.00
267	688606	奥泰生物	895	60,144.00	0.00
268	688007	光峰科技	4,147	59,965.62	0.00
269	688510	航亚科技	2,464	59,579.52	0.00
270	688031	星环科技	1,270	59,220.10	0.00
271	688581	安杰思	910	58,995.30	0.00
272	688621	阳光诺和	1,177	58,720.53	0.00
273	688365	光云科技	3,845	58,520.90	0.00
274	688222	成都先导	3,618	58,177.44	0.00
275	688648	中邮科技	1,228	57,924.76	0.00
276	688073	毕得医药	997	57,845.94	0.00
277	688319	欧林生物	3,666	57,409.56	0.00
278	688290	景业智能	1,096	57,123.52	0.00
279	688799	华纳药厂	1,380	56,994.00	0.00
280	688277	天智航	4,088	56,823.20	0.00
281	688505	复旦张江	6,534	56,584.44	0.00
282	688601	力芯微	1,405	56,129.75	0.00
283	688383	新益昌	1,095	55,691.70	0.00
284	688046	药康生物	3,702	55,678.08	0.00
285	688186	广大特材	1,943	55,589.23	0.00
286	688458	美芯晟	1,177	55,507.32	0.00
287	688577	浙海德曼	1,176	55,142.64	0.00

288	688697	纽威数控	4,130	55,094.20	0.00
289	688661	和林微纳	1,372	54,564.44	0.00
290	688293	奥浦迈	1,206	54,282.06	0.00
291	688386	泛亚微透	998	54,201.38	0.00
292	688299	长阳科技	2,740	54,169.80	0.00
293	688219	会通股份	4,314	54,140.70	0.00
294	688275	万润新能	1,325	53,728.75	0.00
295	688359	三孚新科	1,015	53,531.10	0.00
296	688112	鼎阳科技	1,438	53,162.86	0.00
297	688261	东微半导	1,288	53,130.00	0.00
298	688315	诺禾致源	3,758	53,062.96	0.00
299	688371	菲沃泰	3,199	52,975.44	0.00
300	688625	呈和科技	1,732	52,964.56	0.00
301	688488	艾迪药业	3,800	52,630.00	0.00
302	688588	凌志软件	3,612	52,626.84	0.00
303	688376	美埃科技	1,412	52,625.24	0.00
304	688603	天承科技	1,190	52,598.00	0.00
305	688429	时创能源	3,612	52,518.48	0.00
306	688035	德邦科技	1,285	52,196.70	0.00
307	688636	智明达	1,543	52,137.97	0.00
308	688334	西高院	3,018	51,849.24	0.00
309	688356	键凯科技	732	51,679.20	0.00
310	688719	爱科赛博	1,213	51,552.50	0.00
311	688590	新致软件	2,507	51,493.78	0.00
312	688075	安旭生物	1,336	51,262.32	0.00
313	688236	春立医疗	2,750	51,122.50	0.00
314	688381	帝奥微	2,360	51,117.60	0.00
315	688202	美迪西	1,415	50,840.95	0.00
316	688298	东方生物	1,854	50,706.90	0.00
317	688191	智洋创新	2,130	50,651.40	0.00
318	688173	希荻微	3,705	50,610.30	0.00
319	688556	高测股份	7,039	50,540.02	0.00
320	688143	长盈通	1,286	50,154.00	0.00
321	688389	普门科技	3,869	49,987.48	0.00
322	688302	海创药业	1,068	49,982.40	0.00
323	688566	吉贝尔	1,834	49,866.46	0.00
324	688233	神工股份	1,566	49,751.82	0.00
325	688677	海泰新光	1,268	49,464.68	0.00
326	688489	三未信安	1,202	48,897.36	0.00
327	688286	敏芯股份	691	48,846.79	0.00
328	688066	航天宏图	2,491	48,773.78	0.00
329	688117	圣诺生物	1,448	48,725.20	0.00
330	688197	首药控股	1,343	48,616.60	0.00

331	688580	伟思医疗	1,039	48,303.11	0.00
332	688767	博拓生物	1,349	48,294.20	0.00
333	688085	三友医疗	2,509	48,248.07	0.00
334	688665	四方光电	1,077	48,163.44	0.00
335	688595	芯海科技	1,286	48,083.54	0.00
336	688598	金博股份	1,878	47,738.76	0.00
337	688353	华盛锂电	1,441	47,668.28	0.00
338	688609	九联科技	4,515	47,272.05	0.00
339	688678	福立旺	2,472	47,066.88	0.00
340	688228	开普云	792	47,028.96	0.00
341	688157	松井股份	1,179	47,018.52	0.00
342	688653	康希通信	3,833	46,954.25	0.00
343	688418	震有科技	1,771	46,860.66	0.00
344	688070	纵横股份	968	46,754.40	0.00
345	688620	安凯微	3,737	46,749.87	0.00
346	688259	创耀科技	1,179	46,747.35	0.00
347	688360	德马科技	2,515	46,653.25	0.00
348	688267	中触媒	1,621	46,652.38	0.00
349	688611	杭州柯林	1,411	46,040.93	0.00
350	688176	亚虹医药	5,147	45,653.89	0.00
351	688269	凯立新材	1,374	45,616.80	0.00
352	688716	中研股份	1,279	45,532.40	0.00
353	688399	硕世生物	901	45,500.50	0.00
354	688539	高华科技	1,710	45,486.00	0.00
355	688512	慧智微	4,161	45,396.51	0.00
356	688325	赛微微电	945	45,360.00	0.00
357	688623	二元科技	719	45,131.63	0.00
358	688226	威腾电气	1,726	45,117.64	0.00
359	688010	福光股份	1,450	45,008.00	0.00
360	688087	英科再生	1,722	44,255.40	0.00
361	688101	三达膜	3,166	44,134.04	0.00
362	688152	麒麟信安	939	44,001.54	0.00
363	688181	八亿时空	1,413	43,972.56	0.00
364	688722	同益中	2,066	43,943.82	0.00
365	688410	山外山	3,064	43,508.80	0.00
366	688119	中钢洛耐	10,344	43,237.92	0.00
367	688080	映翰通	847	43,103.83	0.00
368	688768	容知日新	966	42,880.74	0.00
369	688377	迪威尔	1,790	42,727.30	0.00
370	688231	隆达股份	2,354	42,489.70	0.00
371	688247	宣泰医药	4,094	42,291.02	0.00
372	688108	赛诺医疗	3,734	41,895.48	0.00
373	688687	凯因科技	1,572	41,799.48	0.00

374	688459	哈铁科技	4,334	41,606.40	0.00
375	688720	艾森股份	972	41,591.88	0.00
376	688680	海优新材	936	41,371.20	0.00
377	688579	山大地纬	3,612	40,418.28	0.00
378	688179	阿拉丁	3,171	40,335.12	0.00
379	688115	思林杰	784	40,297.60	0.00
380	688378	奥来德	2,377	40,052.45	0.00
381	688282	理工导航	839	39,969.96	0.00
382	688569	铁科轨道	1,938	39,922.80	0.00
383	688456	有研粉材	1,108	39,832.60	0.00
384	688211	中科微至	1,255	39,720.75	0.00
385	688061	灿瑞科技	1,208	39,622.40	0.00
386	688533	上声电子	1,471	39,614.03	0.00
387	688280	精进电动	5,427	39,454.29	0.00
388	688628	优利德	1,175	39,421.25	0.00
389	688602	康鹏科技	4,690	39,302.20	0.00
390	688255	凯尔达	1,163	39,181.47	0.00
391	688201	信安世纪	3,024	39,160.80	0.00
392	688089	嘉必优	1,548	38,932.20	0.00
393	688059	华锐精密	831	38,857.56	0.00
394	688039	当虹科技	1,181	38,760.42	0.00
395	688090	瑞松科技	1,126	38,723.14	0.00
396	688576	西山科技	608	38,668.80	0.00
397	688339	亿华通	1,801	38,451.35	0.00
398	688077	大地熊	1,203	38,435.85	0.00
399	688135	利扬芯片	1,851	38,334.21	0.00
400	688478	晶升股份	1,250	38,250.00	0.00
401	688253	英诺特	1,233	38,050.38	0.00
402	688373	盟科药业	6,029	37,801.83	0.00
403	688496	清越科技	4,063	37,785.90	0.00
404	688699	明微电子	1,165	37,722.70	0.00
405	688227	品高股份	1,188	37,350.72	0.00
406	688207	格灵深瞳	2,469	37,281.90	0.00
407	688416	恒烁股份	924	37,200.24	0.00
408	688500	慧辰股份	851	37,188.70	0.00
409	688238	和元生物	5,968	37,001.60	0.00
410	688079	美迪凯	3,673	36,876.92	0.00
411	688573	信宇人	1,057	36,572.20	0.00
412	688244	永信至诚	1,389	36,558.48	0.00
413	688246	嘉和美康	1,243	36,531.77	0.00
414	688015	交控科技	1,735	36,157.40	0.00
415	688501	青达环保	1,293	36,010.05	0.00
416	688683	莱尔科技	1,427	35,988.94	0.00

417	688221	前沿生物	3,571	35,852.84	0.00
418	688391	钜泉科技	1,204	35,746.76	0.00
419	688633	星球石墨	1,310	35,671.30	0.00
420	688662	富信科技	973	35,465.85	0.00
421	688257	新锐股份	2,407	35,262.55	0.00
422	688283	坤恒顺维	1,280	35,136.00	0.00
423	688358	祥生医疗	1,183	35,075.95	0.00
424	688558	国盛智科	1,387	35,007.88	0.00
425	688733	壹石通	1,837	34,792.78	0.00
426	688592	司南导航	745	34,486.05	0.00
427	688711	宏微科技	1,958	34,441.22	0.00
428	688129	东来技术	1,266	34,435.20	0.00
429	688071	华依科技	943	34,372.35	0.00
430	688199	久日新材	1,456	34,361.60	0.00
431	688020	方邦股份	907	34,348.09	0.00
432	688419	耐科装备	919	34,260.32	0.00
433	688663	新风光	1,270	34,226.50	0.00
434	688682	霍莱沃	1,093	34,210.90	0.00
435	688133	泰坦科技	1,485	34,184.70	0.00
436	688379	华光新材	984	34,105.44	0.00
437	688162	巨一科技	1,239	33,750.36	0.00
438	688291	金橙子	1,100	33,341.00	0.00
439	688053	思科瑞	1,076	33,280.68	0.00
440	688600	皖仪科技	1,416	33,276.00	0.00
441	688210	统联精密	1,447	32,991.60	0.00
442	688657	浩辰软件	774	32,871.78	0.00
443	688033	天宜新材	5,077	32,543.57	0.00
444	688273	麦澜德	1,076	32,505.96	0.00
445	688330	宏力达	1,265	32,485.20	0.00
446	688480	赛恩斯	1,002	32,214.30	0.00
447	688557	兰剑智能	1,074	32,144.82	0.00
448	688057	金达莱	2,632	32,110.40	0.00
449	688398	赛特新材	1,543	31,955.53	0.00
450	688369	致远互联	1,210	31,931.90	0.00
451	688317	之江生物	1,767	31,841.34	0.00
452	688793	倍轻松	953	31,725.37	0.00
453	688312	燕麦科技	1,315	31,599.45	0.00
454	688610	埃科光电	796	31,569.36	0.00
455	688125	安达智能	857	31,451.90	0.00
456	688689	银河微电	1,355	31,259.85	0.00
457	688137	近岸蛋白	815	31,214.50	0.00
458	688357	建龙微纳	1,077	31,006.83	0.00
459	688435	英方软件	932	30,700.08	0.00

460	688288	鸿泉物联	1,058	30,692.58	0.00
461	688509	正元地信	7,080	30,373.20	0.00
462	688786	悦安新材	1,299	30,266.70	0.00
463	688229	博睿数据	589	30,009.55	0.00
464	688028	沃尔德	1,373	29,794.10	0.00
465	688655	迅捷兴	1,402	29,708.38	0.00
466	688345	博力威	1,076	29,643.80	0.00
467	688285	高铁电气	3,588	29,421.60	0.00
468	688393	安必平	1,020	29,314.80	0.00
469	688571	杭华股份	3,794	29,251.74	0.00
470	688316	青云科技	456	28,896.72	0.00
471	688237	超卓航科	985	28,791.55	0.00
472	688171	纬德信息	934	28,729.84	0.00
473	688618	三旺通信	1,167	28,474.80	0.00
474	688338	赛科希德	1,130	28,453.40	0.00
475	688265	南模生物	883	28,441.43	0.00
476	688132	邦彦技术	1,400	28,420.00	0.00
477	688585	上纬新材	3,642	28,334.76	0.00
478	688314	康拓医疗	912	28,162.56	0.00
479	688011	新光光电	1,076	28,137.40	0.00
480	688589	力合微	1,313	28,085.07	0.00
481	688560	明冠新材	1,851	28,079.67	0.00
482	688695	中创股份	945	28,066.50	0.00
483	688693	锆威特	846	27,926.46	0.00
484	688170	德龙激光	1,106	27,871.20	0.00
485	688175	高凌信息	1,367	27,791.11	0.00
486	688109	品茗科技	891	27,736.83	0.00
487	688045	必易微	805	27,692.00	0.00
488	688113	联测科技	765	27,685.35	0.00
489	688307	中润光学	971	27,615.24	0.00
490	688292	浩瀚深度	1,430	27,513.20	0.00
491	688551	科威尔	936	27,509.04	0.00
492	688529	豪森智能	1,519	27,250.86	0.00
493	688613	奥精医疗	1,425	27,246.00	0.00
494	688651	盛邦安全	793	27,065.09	0.00
495	688218	江苏北人	1,246	27,038.20	0.00
496	688737	中自科技	1,257	27,025.50	0.00
497	688121	卓然股份	2,228	26,914.24	0.00
498	688638	誉辰智能	691	26,852.26	0.00
499	688468	科美诊断	3,622	26,657.92	0.00
500	688013	天臣医疗	911	26,628.53	0.00
501	688078	龙软科技	839	26,596.30	0.00
502	688030	山石网科	1,658	26,511.42	0.00

503	688308	欧科亿	1,434	26,457.30	0.00
504	688056	莱伯泰科	791	26,403.58	0.00
505	688426	康为世纪	1,186	26,293.62	0.00
506	688667	菱电电控	494	26,285.74	0.00
507	688216	气派科技	1,139	26,117.27	0.00
508	688058	宝兰德	881	25,258.27	0.00
509	688597	煜邦电力	3,204	25,087.32	0.00
510	688215	瑞晟智能	656	24,941.12	0.00
511	688148	芳源股份	4,607	24,923.87	0.00
512	688479	友车科技	1,304	24,645.60	0.00
513	688130	晶华微	1,112	24,575.20	0.00
514	688448	磁谷科技	828	24,252.12	0.00
515	688669	聚石化学	1,275	24,059.25	0.00
516	688323	瑞华泰	1,656	24,028.56	0.00
517	688022	瀚川智能	1,618	23,978.76	0.00
518	688530	欧莱新材	1,446	23,815.62	0.00
519	688370	丛麟科技	1,238	23,658.18	0.00
520	688203	海正生材	1,864	23,598.24	0.00
521	688272	富吉瑞	866	23,425.30	0.00
522	688455	科捷智能	1,663	23,398.41	0.00
523	688328	深科达	1,028	23,284.20	0.00
524	688420	美腾科技	975	23,244.00	0.00
525	688193	仁度生物	551	23,158.53	0.00
526	688069	德林海	1,190	23,145.50	0.00
527	688081	兴图新科	1,103	22,953.43	0.00
528	688355	明志科技	1,303	22,893.71	0.00
529	688118	普元信息	1,024	22,886.40	0.00
530	688466	金科环境	1,294	22,877.92	0.00
531	688619	罗普特	1,706	22,689.80	0.00
532	688098	申联生物	3,708	22,655.88	0.00
533	688096	京源环保	1,483	22,571.26	0.00
534	688310	迈得医疗	1,529	22,537.46	0.00
535	688163	赛伦生物	1,148	22,328.60	0.00
536	688051	佳华科技	878	21,853.42	0.00
537	688178	万德斯	946	21,776.92	0.00
538	688395	正弦电气	959	21,750.12	0.00
539	688060	云涌科技	574	21,002.66	0.00
540	688616	西力科技	1,650	20,988.00	0.00
541	688026	洁特生物	1,268	20,795.20	0.00
542	688260	昀冢科技	1,261	20,781.28	0.00
543	688251	井松智能	961	20,719.16	0.00
544	688679	通源环境	1,384	20,718.48	0.00
545	688092	爱科科技	925	20,627.50	0.00

546	688450	光格科技	779	20,581.18	0.00
547	688350	富淼科技	1,284	20,466.96	0.00
548	688718	唯赛勃	1,598	19,783.24	0.00
549	688189	南新制药	2,616	19,463.04	0.00
550	688038	中科通达	1,223	19,409.01	0.00
551	688671	碧兴物联	888	18,958.80	0.00
552	688156	路德环境	1,083	18,313.53	0.00
553	688607	康众医疗	972	18,225.00	0.00
554	688670	金迪克	1,295	18,065.25	0.00
555	688004	博汇科技	902	17,949.80	0.00
556	688517	金冠电气	1,234	17,744.92	0.00
557	688367	工大高科	966	17,049.90	0.00
558	688329	艾隆科技	877	16,873.48	0.00
559	688335	复洁环保	1,337	16,311.40	0.00
560	688528	秦川物联	1,545	16,006.20	0.00
561	688681	科汇股份	1,117	15,638.00	0.00
562	688067	爱威科技	715	15,379.65	0.00
563	688296	和达科技	1,149	15,086.37	0.00
564	688309	恒誉环保	841	15,062.31	0.00
565	688485	九州一轨	1,357	14,777.73	0.00
566	688217	睿昂基因	533	13,484.90	0.00
567	688021	奥福科技	870	13,302.30	0.00
568	688565	力源科技	1,372	12,691.00	0.00
569	688659	元琛科技	1,445	12,614.85	0.00
570	688701	卓锦股份	1,411	11,626.64	0.00
571	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	688041	海光信息	141,261,026.48	10.62
2	688256	寒武纪	125,106,212.94	9.41
3	688981	中芯国际	74,048,824.95	5.57
4	688111	金山办公	56,479,502.54	4.25
5	688506	百利天恒	50,259,967.05	3.78
6	688012	中微公司	47,697,045.81	3.59
7	688271	联影医疗	40,986,050.67	3.08
8	688036	传音控股	36,488,541.73	2.74
9	688008	澜起科技	32,646,313.11	2.45
10	688047	龙芯中科	25,719,849.79	1.93
11	688396	华润微	23,627,045.36	1.78

12	688169	石头科技	23,248,624.91	1.75
13	688223	晶科能源	23,201,785.69	1.74
14	688188	柏楚电子	22,538,747.98	1.69
15	688120	华海清科	21,051,870.37	1.58
16	688072	拓荆科技	19,894,753.07	1.50
17	688126	沪硅产业	19,409,064.87	1.46
18	688082	盛美上海	19,342,414.16	1.45
19	688009	中国通号	18,551,283.51	1.39
20	688521	芯原股份	18,464,559.98	1.39

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。

7.5.2 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	688041	海光信息	36,187,425.18	2.72
2	688256	寒武纪	35,182,445.21	2.64
3	688981	中芯国际	19,324,928.73	1.45
4	688111	金山办公	15,268,927.06	1.15
5	688506	百利天恒	14,664,745.11	1.10
6	688012	中微公司	12,480,021.13	0.94
7	688271	联影医疗	11,418,387.60	0.86
8	688008	澜起科技	9,318,485.13	0.70
9	688036	传音控股	9,220,679.42	0.69
10	688169	石头科技	6,852,220.42	0.52
11	688047	龙芯中科	6,583,351.38	0.49
12	688396	华润微	6,422,280.54	0.48
13	688188	柏楚电子	6,204,724.31	0.47
14	688223	晶科能源	6,024,420.94	0.45
15	688120	华海清科	5,398,764.32	0.41
16	688082	盛美上海	5,377,359.89	0.40
17	689009	九号公司	5,347,354.16	0.40
18	688072	拓荆科技	5,253,810.74	0.39
19	688126	沪硅产业	5,248,760.22	0.39
20	688213	思特威	4,860,653.13	0.37

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。

7.5.3 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	2,328,878,361.68
卖出股票收入（成交）总额	641,825,995.56

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。

7.6 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）	18,000.71	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,000.71	0.00

7.7 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	118057	甬矽转债	120	12,000.21	0.00
2	118056	路维转债	60	6,000.50	0.00

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，深圳传音控股股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到广东省深圳市住房和建设局的处罚。

本基金为目标 ETF 的联接基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，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目标 ETF 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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，深圳传音控股股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到广东省深圳市住房和建设局的处罚。

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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	548,757.75
2	应收清算款	25,718,838.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,287,594.90
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,555,191.43

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十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

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
易方达上证科创板综合 ETF 联接 A	4,601	97,257.89	0.00	0.00%	447,483,573.58	100.00%
易方达上证科创板综合 ETF 联接 C	23,529	34,835.77	180,132.08	0.02%	819,470,606.69	99.98%
合计	28,130	45,045.66	180,132.08	0.01%	1,266,954,180.27	99.99%

8.2 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	易方达上证科创板综合 ETF 联接 A	11,214.94	0.0025%
	易方达上证科创板综合 ETF 联接 C	199,109.84	0.0243%
	合计	210,324.78	0.0166%

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	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	易方达上证科创板综合 ETF 联接 A	0
	易方达上证科创板综合 ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达上证科创板综合 ETF 联接 A	0
	易方达上证科创板综合 ETF 联接 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达上证科创板综合 ETF 联接 A	易方达上证科创板综合 ETF 联接 C
基金合同生效日（2025 年 4 月 8 日）基金份额总额	1,139,474,669.57	3,223,015,785.76
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	35,451,024.46	130,162,980.97
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	727,442,120.45	2,533,528,027.96
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	447,483,573.58	819,650,738.77

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 8 日。

§ 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

本基金管理人于 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，

管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	1,305,729,723.10	43.96%	130,572.95	43.96%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	1,664,569,116.04	56.04%	166,457.00	56.04%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、高盛（中国）证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰海通证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华金证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

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。本报告期内基金证券经营机构的选择标准有调整，调整后的标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	3,500,000,000.00	100.00 %	-	-	87.70	0.00%
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	120,190.78	100.00 %	-	-	-	-	865,779,337.91	100.00 %

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	易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效公告	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	2025-04-09
2	易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	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	2025-04-16
3	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	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	2025-05-08
4	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2025-05-17
5	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	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	2025-06-06

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的文件；
- 2.《易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3.《易方达上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 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。

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
二〇二五年八月三十日