

易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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 29 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	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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
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	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64

7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 备查文件目录	69
11.1 备查文件目录	69
11.2 存放地点	69
11.3 查阅方式	69

§ 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指数增强型证券投资基金	
基金简称	易方达上证科创板综合增强	
基金主代码	023998	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 4 月 29 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	365,477,483.39 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增强 A	易方达上证科创板综合增强 C
下属分级基金的交易代码	023998	023999
报告期末下属分级基金的份额总额	124,031,350.66 份	241,446,132.73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 4%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。股票投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型，在控制组合风险与交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优选股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。本基金通过采取多个定量投资模型，力争分散模型风险，提高投资组合表现。本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行。债券投资方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资管理。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，并可参与转融通证券出借业务、融资业务。
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	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市

	场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。
--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	潘琦
	联系电话	020-85102688	0755-22168257
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95511-3
传真		020-38798812	0755-82080387
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047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	广东省深圳市福田区益田路 5023号平安金融中心B座
邮政编码		510620; 519031	518001
法定代表人		吴欣荣	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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29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增强 A	易方达上证科创板综合增强 C
本期已实现收益	1,808,733.46	3,754,289.28
本期利润	5,882,217.63	12,997,006.41
加权平均基金份额本期利润	0.0399	0.0349
本期加权平均净值利润率	3.99%	3.49%
本期基金份额净值增长率	4.43%	4.35%
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增强 A	易方达上证科创板综合增强 C
期末可供分配利润	1,640,199.75	3,023,731.72
期末可供分配基金份额利润	0.0132	0.0125
期末基金资产净值	129,522,017.16	251,959,910.42
期末基金份额净值	1.0443	1.0435
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增强 A	易方达上证科创板综合增强 C
基金份额累计净值增长率	4.43%	4.35%

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 29 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增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.45%	1.01%	5.43%	0.96%	0.02%	0.05%
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	4.43%	0.77%	5.82%	0.96%	-1.39%	-0.19%

易方达上证科创板综合增强 C

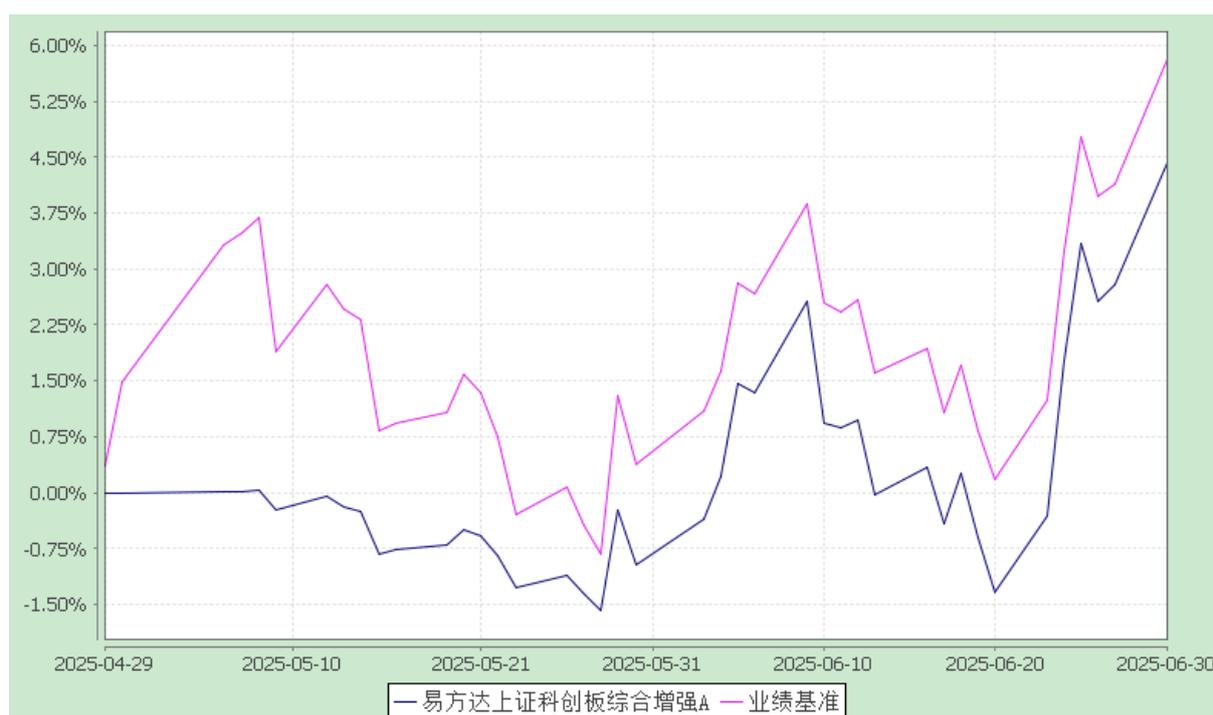
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.41%	1.01%	5.43%	0.96%	-0.02%	0.05%
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.35%	0.77%	5.82%	0.96%	-1.47%	-0.19%

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指数增强型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025 年 4 月 29 日至 2025 年 6 月 30 日)

易方达上证科创板综合增强 A



易方达上证科创板综合增强 C



注：1.本基金合同于 2025 年 4 月 29 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 4.43%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%；C 类基金份额净值增长率为 4.35%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%。

§ 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		

殷明	本基金的基金经理，易方达易百智能量化策略混合、易方达中证 1000 量化增强、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF 的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员	2025-04-29	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，国盛证券有限责任公司研究所金融工程分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员。
----	-------------------------------------------------------------------------------------------	------------	---	-----	----------------------------------------------------------------------------

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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 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

2025 年上半年，在经济基本面受到全球关税贸易冲突升级的冲击下，前期推出的增量经济政策持续发挥对冲作用，宏观经济整体稳定。虽然在某些结构性领域，经济压力依然很大，但重点领域

支出得到有力保障；适度宽松的货币政策和一系列金融支持举措相继落地，市场流动性维持合理充裕状态。期间，资本市场信心逐步提振，投资者参与度显著提升，市场交易活跃度处于较高水平，市场日均成交量维持在万亿以上。但我们仍需注意的是，在整体经济平稳运行的背景下，地产、消费等部分领域仍面临一定压力，价格指数依然低位震荡，当前宏观基本面依然需要持续关注。

本报告期内，科技领域亮点突出。创新药领域成果显著，多款原研新药成功获批上市，针对多种重大疾病的靶向药物在临床试验中显现出优异的治疗效果，为患者带来了新的治疗契机；同时，疫苗研发技术不断取得突破，在传染病的预防与治疗领域的应用范围持续扩大，推动创新药板块实现估值修复。人工智能领域发展势头迅猛，以 DeepSeek 为代表的大模型在后训练和模型蒸馏等方面的能力持续增强，应用场景不断拓展；机器人产业加速发展，工业机器人的精度与效率进一步优化，服务机器人在家庭、医疗等领域的渗透率逐步提升，人工智能产业链上下游企业均迎来发展机遇。新能源汽车领域，固态电池量产技术取得关键性进展，能量密度与续航能力大幅提高，充电效率也有显著改善，推动全球新能源汽车产业向更高质量的阶段迈进。在此背景下，科技板块整体表现强劲。

本基金于 4 月 29 日成立，目前已经顺利完成产品建仓。虽然建仓期间指数上涨幅度较大，但我们通过稳健建仓策略基本跟上了市场节奏。未来，我们依然会做好跟踪误差控制，使用多策略方式进行量化投资，追求稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0443 元，本报告期份额净值增长率为 4.43%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%；C 类基金份额净值为 1.0435 元，本报告期份额净值增长率为 4.35%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%。年化跟踪误差 7.58%，超过目标控制范围，因本报告期包含了建仓期，故跟踪误差等指标在调整之中。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们依然要从宏观和中观两重视角对经济运行进行跟踪与判断：宏观层面，继续关注在经济政策持续发力下，价格相关指标能否出现正反馈，同时继续关注地产风险控制和消费活力提升；中观层面，随着人工智能技术不断迭代，需关注除海外算力以外的其他板块的基本面业绩兑现情况。另外，从资金流维度，我们依然关注长线资金入市情况，这对市场结构也会有指引性意义。

我们在时刻保持对宏观经济基本面的关注的同时，更重要的是不断迭代优化量化模型，让更多低相关的量化模型为产品服务。因此，未来我们还是会继续拓宽观察市场的视角，通过量化模型紧密跟踪相关数据，快速准确地做出投资决策。同时，我们依然会坚持在大数据、机器学习、另类数

据中的深度研究，充分利用更多的信息源对选股模型进行增强，争取为投资者创造持续稳定的超额收益。

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增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达上证科创板综合增强 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，平安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。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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指数增强型证券投资基金

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	30,073,329.71
结算备付金		9,018,297.67
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	352,220,106.90
其中：股票投资		352,220,106.90
基金投资		-
债券投资		-
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		-
应收股利		-
应收申购款		1,410,013.77
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		392,721,748.05
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		0.15
应付赎回款		10,780,983.20
应付管理人报酬		302,102.59
应付托管费		37,762.83
应付销售服务费		104,809.66
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	6.4.7.6	14,162.04
负债合计		11,239,820.47
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	365,477,483.39
未分配利润	6.4.7.8	16,004,444.19
净资产合计		381,481,927.58
负债和净资产总计		392,721,748.05

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，2025 年半年度实际报告期间为 2025 年 4 月 29 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 1.0443 元，C 类基金份额净值 1.0435 元；基金份额总额 365,477,483.39 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 124,031,350.66 份，C 类基金份额总额 241,446,132.73 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 29 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 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		19,944,486.98
1.利息收入		165,132.87
其中：存款利息收入	6.4.7.9	165,132.87
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）		6,458,896.51
其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,201,045.15

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	1,257,851.36
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	13,316,201.30
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	4,256.30
减：二、营业总支出		1,065,262.94
1. 管理人报酬		708,374.16
2. 托管费		88,546.79
3. 销售服务费		253,865.97
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		-
8. 其他费用	6.4.7.18	14,476.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,879,224.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,879,224.04
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		18,879,224.04

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，2025 年半年度实际报告期间为 2025 年 4 月 29 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指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 29 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 29 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	582,243,421.05	-	582,243,421.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-216,765,937.66	16,004,444.19	-200,761,493.47
（一）、综合收益总额	-	18,879,224.04	18,879,224.04
（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）	-216,765,937.66	-2,874,779.85	-219,640,717.51
其中：1.基金申购款	38,724,387.14	384,923.88	39,109,311.02
2.基金赎回款	-255,490,324.80	-3,259,703.73	-258,750,028.53
（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	365,477,483.39	16,004,444.19	381,481,927.58

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，2025 年半年度实际报告期间为 2025 年 4 月 29 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：王永铿

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指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]710 号《关于准予易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 4 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 582,243,421.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 125,039.99

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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2025 年 4 月 14 日至 2025 年 4 月 25 日，募集金额总额为人民币 582,243,421.05 元，其中：有效净认购金额为人民币 582,118,381.06 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 125,039.99 元，经安永华明（2025）验字第 70013033_G13 号验资报告予以审验。

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、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 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 29 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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允

价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产

支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

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

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

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

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

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

(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征增值税试点的通知》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。

(5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	12,609,870.19
等于：本金	12,608,776.93
加：应计利息	1,093.26
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	17,463,459.52
等于：本金	17,462,032.36
加：应计利息	1,427.16
合计	30,073,329.71

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		338,903,905.60	-	352,220,106.90	13,316,201.30
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		338,903,905.60	-	352,220,106.90	13,316,201.30

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	133.83
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	14,028.21
合计	14,162.04

6.4.7.7 实收基金

易方达上证科创板综合增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年4月29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	154,987,518.31	154,987,518.31
本期申购	10,962,486.09	10,962,486.09
本期赎回（以“-”号填列）	-41,918,653.74	-41,918,653.74
本期末	124,031,350.66	124,031,350.66

易方达上证科创板综合增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年4月29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	427,255,902.74	427,255,902.74
本期申购	27,761,901.05	27,761,901.05
本期赎回（以“-”号填列）	-213,571,671.06	-213,571,671.06
本期末	241,446,132.73	241,446,132.73

注：1.本基金合同于 2025 年 4 月 29 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 582,243,421.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 125,039.99 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增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,808,733.46	4,073,484.17	5,882,217.63

本期基金份额交易产生的变动数	-168,533.71	-223,017.42	-391,551.13
其中：基金申购款	59,770.75	61,140.05	120,910.80
基金赎回款	-228,304.46	-284,157.47	-512,461.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,640,199.75	3,850,466.75	5,490,666.50

易方达上证科创板综合增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,754,289.28	9,242,717.13	12,997,006.41
本期基金份额交易产生的变动数	-730,557.56	-1,752,671.16	-2,483,228.72
其中：基金申购款	159,935.88	104,077.20	264,013.08
基金赎回款	-890,493.44	-1,856,748.36	-2,747,241.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,023,731.72	7,490,045.97	10,513,777.69

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,221.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	131,391.93
结算备付金利息收入	18,297.67
其他	221.72
合计	165,132.87

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 29 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	5,201,045.15
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	5,201,045.15

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29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出股票成交总额	225,185,458.32
减：卖出股票成本总额	219,744,950.10
减：交易费用	239,463.07
买卖股票差价收入	5,201,045.15

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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
	2025年4月29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	1,257,851.36
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,257,851.36

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
1.交易性金融资产	13,316,201.30
——股票投资	13,316,201.30
——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	13,316,201.30
----	---------------

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
基金赎回费收入	3,832.40
其他	423.90
合计	4,256.30

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
	2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
审计费用	14,028.21
信息披露费	-
证券出借违约金	-
存托服务费	46.42
港股通证券组合费	1.39
其他	400.00
合计	14,476.02

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
平安银行股份有限公司	基金托管人、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**

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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29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	708,374.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	296,481.37
应支付基金管理人的净管理费	411,892.79

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年4月29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	88,546.79

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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29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增强A	易方达上证科创板综合增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	614.41	614.41
平安银行	-	31,666.54	31,666.54
合计	-	32,280.95	32,280.95

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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增强 A

无。

易方达上证科创板综合增强 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29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
平安银行-活期存款	12,609,870.19	15,221.55

注：本基金的上述银行存款由基金托管人平安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

本基金本报告期未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

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达上证科创板综合增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达上证科创板综合增强 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
603400	华之杰	2025-06-12	6个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-

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	28,999	849,400.86	1,103,411.95	-

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。

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

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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	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。本基金可通过港股通投资香港市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。香港证券市场每日证券交易价格并无涨跌幅限制，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

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	30,073,329.71	-	-	-	30,073,329.71
结算备付金	9,018,297.67	-	-	-	9,018,297.67
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	352,220,106.90	352,220,106.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,410,013.77	1,410,013.77
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,091,627.38	-	-	353,630,120.67	392,721,748.05

					5
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	-	-	-	0.15	0.15
应付赎回款	-	-	-	10,780,983.20	10,780,983.20
应付管理人报酬	-	-	-	302,102.59	302,102.59
应付托管费	-	-	-	37,762.83	37,762.83
应付销售服务费	-	-	-	104,809.66	104,809.66
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	-	-	-	14,162.04	14,162.04
负债总计	-	-	-	11,239,820.47	11,239,820.47
					47
利率敏感度缺口	39,091,627.38	-	-	342,390,300.20	381,481,927.58

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

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	214,764.23	-	214,764.23
资产合计	-	214,764.23	-	214,764.23
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	214,764.23	-	214,764.23

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变	
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
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-10,738.21
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	10,738.21

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 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	352,220,106.90	92.33
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	352,220,106.90	92.33

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%	18,537,899.54
	2.业绩比较基准下降5%	-18,537,899.54

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	351,114,197.78
第二层次	1,103,411.95
第三层次	2,497.17
合计	352,220,106.90

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	352,220,106.90	89.69
	其中：股票	352,220,106.90	89.69
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	39,091,627.38	9.95
8	其他各项资产	1,410,013.77	0.36
9	合计	392,721,748.05	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 214,764.23 元，占净值比例 0.06%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	261,039,356.74	68.43
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	60,544,737.62	15.87
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	5,269,112.31	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	789,870.36	0.21
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	327,643,077.03	85.89

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	-	-
C	制造业	20,353,005.64	5.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,118.00	0.01
E	建筑业	155,319.00	0.04
F	批发和零售业	378,543.00	0.10

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	2,397,797.00	0.63
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	244,487.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	185,231.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	29,414.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	588,351.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	24,362,265.64	6.39

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	214,764.23	0.06
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	214,764.23	0.06

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	688041	海光信息	114,252	16,142,665.08	4.23
2	688256	寒武纪	21,274	12,796,311.00	3.35
3	688981	中芯国际	101,811	8,976,675.87	2.35
4	688111	金山办公	23,271	6,517,043.55	1.71
5	688012	中微公司	31,224	5,692,135.20	1.49
6	688506	百利天恒	17,531	5,191,279.72	1.36
7	688008	澜起科技	58,405	4,789,210.00	1.26
8	688271	联影医疗	35,843	4,578,584.82	1.20
9	688036	传音控股	48,445	3,861,066.50	1.01
10	688126	沪硅产业	136,507	2,555,411.04	0.67
11	688396	华润微	52,638	2,482,408.08	0.65
12	688120	华海清科	14,459	2,439,233.30	0.64
13	688082	盛美上海	21,336	2,431,023.84	0.64
14	688047	龙芯中科	17,671	2,357,134.69	0.62
15	688072	拓荆科技	15,253	2,344,538.63	0.61
16	688183	生益电子	44,294	2,267,852.80	0.59
17	688608	恒玄科技	6,437	2,239,947.26	0.59
18	688521	芯原股份	22,620	2,182,830.00	0.57
19	688249	晶合集成	107,650	2,182,065.50	0.57
20	688303	大全能源	99,115	2,113,131.80	0.55
21	688617	惠泰医疗	7,082	2,103,354.00	0.55
22	688728	格科微	135,384	2,084,913.60	0.55
23	688009	中国通号	402,970	2,071,265.80	0.54
24	688578	艾力斯	22,160	2,061,766.40	0.54
25	688220	翱捷科技	26,234	2,054,122.20	0.54
26	688223	晶科能源	393,685	2,043,225.15	0.54
27	688169	石头科技	12,456	1,949,986.80	0.51
28	688065	凯赛生物	37,966	1,788,198.60	0.47
29	688629	华丰科技	30,170	1,725,724.00	0.45
30	688188	柏楚电子	13,095	1,724,087.70	0.45
31	688777	中控技术	36,202	1,625,831.82	0.43
32	688582	芯动联科	24,117	1,620,662.40	0.42
33	688538	和辉光电	673,930	1,576,996.20	0.41
34	688099	晶晨股份	22,033	1,564,563.33	0.41
35	688192	迪哲医药	25,820	1,544,036.00	0.40
36	689009	九号公司	26,089	1,543,686.13	0.40
37	688122	西部超导	29,750	1,543,430.00	0.40
38	688469	芯联集成	314,635	1,500,808.95	0.39
39	688180	君实生物	43,570	1,480,508.60	0.39
40	688525	佰维存储	21,808	1,469,859.20	0.39
41	688819	天能股份	51,764	1,436,968.64	0.38
42	688002	睿创微纳	20,246	1,411,551.12	0.37
43	688278	特宝生物	19,448	1,402,395.28	0.37

44	688343	云天励飞	27,676	1,367,747.92	0.36
45	688019	安集科技	8,998	1,365,896.40	0.36
46	688692	达梦数据	6,093	1,358,068.77	0.36
47	688520	神州细胞	22,632	1,354,525.20	0.36
48	688318	财富趋势	11,709	1,345,598.28	0.35
49	688322	奥比中光	22,446	1,324,538.46	0.35
50	688375	国博电子	21,760	1,305,817.60	0.34
51	688018	乐鑫科技	8,908	1,301,458.80	0.34
52	688200	华峰测控	9,017	1,300,251.40	0.34
53	688475	萤石网络	39,946	1,259,097.92	0.33
54	688385	复旦微电	25,505	1,256,631.35	0.33
55	688037	芯源微	11,709	1,255,204.80	0.33
56	688599	天合光能	86,255	1,253,285.15	0.33
57	688568	中科星图	34,754	1,251,491.54	0.33
58	688297	中无人机	23,117	1,234,447.80	0.32
59	688027	国盾量子	4,481	1,232,319.81	0.32
60	688141	杰华特	36,485	1,188,681.30	0.31
61	688563	航材股份	20,917	1,184,529.71	0.31
62	688114	华大智造	18,217	1,181,008.11	0.31
63	688208	道通科技	38,383	1,174,519.80	0.31
64	688347	华虹公司	20,892	1,147,179.72	0.30
65	688349	三一重能	45,855	1,143,623.70	0.30
66	688235	百济神州	4,864	1,136,424.96	0.30
67	688336	三生国健	20,744	1,125,154.56	0.29
68	688172	燕东微	57,168	1,123,922.88	0.29
69	688702	盛科通信	18,206	1,112,022.48	0.29
70	688522	纳睿雷达	21,688	1,110,859.36	0.29
71	688313	仕佳光子	28,999	1,103,411.95	0.29
72	688088	虹软科技	22,548	1,087,941.00	0.29
73	688327	云从科技	78,744	1,085,879.76	0.28
74	688778	厦钨新能	18,841	1,053,588.72	0.28
75	688116	天奈科技	22,341	1,022,547.57	0.27
76	688561	奇安信	30,001	1,019,433.98	0.27
77	688567	孚能科技	70,095	1,016,377.50	0.27
78	688361	中科飞测	11,947	1,005,817.93	0.26
79	688147	微导纳米	33,248	1,003,424.64	0.26
80	688076	诺泰生物	26,890	1,000,845.80	0.26
81	688052	纳芯微	5,728	999,478.72	0.26
82	688166	博瑞医药	18,553	996,481.63	0.26
83	688387	信科移动	175,088	989,247.20	0.26
84	688187	时代电气	23,086	984,617.90	0.26
85	688536	思瑞浦	6,885	955,087.20	0.25
86	688772	珠海冠宇	65,660	938,281.40	0.25

87	688709	成都华微	28,411	930,176.14	0.24
88	688472	阿特斯	100,156	916,427.40	0.24
89	688363	华熙生物	17,677	907,713.95	0.24
90	688676	金盘科技	27,121	907,197.45	0.24
91	688017	绿的谐波	7,228	902,704.92	0.24
92	688095	福昕软件	13,291	902,591.81	0.24
93	688498	源杰科技	4,601	897,195.00	0.24
94	688234	天岳先进	15,114	884,924.70	0.23
95	688400	凌云光	32,072	884,225.04	0.23
96	688031	星环科技	18,892	880,933.96	0.23
97	688306	均普智能	88,697	872,778.48	0.23
98	688690	纳微科技	37,297	851,490.51	0.22
99	688300	联瑞新材	18,258	849,909.90	0.22
100	688100	威胜信息	22,691	840,701.55	0.22
101	688443	智翔金泰	30,294	840,355.56	0.22
102	688233	神工股份	26,233	833,422.41	0.22
103	688248	南网科技	26,112	821,483.52	0.22
104	688301	奕瑞科技	9,301	814,860.61	0.21
105	688550	瑞联新材	18,799	808,544.99	0.21
106	688281	华秦科技	13,223	800,123.73	0.21
107	688289	圣湘生物	38,637	791,285.76	0.21
108	688063	派能科技	17,247	777,494.76	0.20
109	688484	南芯科技	19,558	773,518.90	0.20
110	688097	博众精工	27,690	772,827.90	0.20
111	688252	天德钰	31,697	772,772.86	0.20
112	688660	电气风电	87,943	763,345.24	0.20
113	688232	新点软件	25,384	762,535.36	0.20
114	688433	华曙高科	20,747	762,452.25	0.20
115	688333	铂力特	12,742	758,913.52	0.20
116	688698	伟创电气	16,041	757,135.20	0.20
117	688005	容百科技	33,782	754,014.24	0.20
118	688123	聚辰股份	9,261	750,048.39	0.20
119	688331	荣昌生物	12,270	742,335.00	0.19
120	688403	汇成股份	70,869	736,328.91	0.19
121	688182	灿勤科技	26,523	730,973.88	0.19
122	688584	上海合晶	40,714	727,966.32	0.19
123	688279	峰昭科技	3,923	727,716.50	0.19
124	688508	芯朋微	12,951	722,924.82	0.19
125	688425	铁建重工	176,793	721,315.44	0.19
126	688001	华兴源创	28,211	712,891.97	0.19
127	688717	艾罗能源	12,973	698,336.59	0.18
128	688258	卓易信息	14,417	698,215.31	0.18
129	688110	东芯股份	22,659	694,724.94	0.18

130	688380	中微半导	25,625	694,437.50	0.18
131	688627	精智达	7,882	693,694.82	0.18
132	688003	天准科技	15,098	692,998.20	0.18
133	688165	埃夫特	26,575	678,194.00	0.18
134	688535	华海诚科	7,773	668,400.27	0.18
135	688146	中船特气	23,053	666,462.23	0.17
136	688209	英集芯	35,819	661,576.93	0.17
137	688668	鼎通科技	10,560	659,577.60	0.17
138	688789	宏华数科	8,930	652,247.20	0.17
139	688150	莱特光电	26,306	650,284.32	0.17
140	688262	国芯科技	24,372	650,001.24	0.17
141	688161	威高骨科	24,029	643,736.91	0.17
142	688177	百奥泰	25,534	639,882.04	0.17
143	688302	海创药业	13,623	637,556.40	0.17
144	688502	茂莱光学	2,188	629,400.08	0.16
145	688127	蓝特光学	24,295	624,624.45	0.16
146	688630	芯碁微装	7,846	622,737.02	0.16
147	688678	福立旺	32,599	620,684.96	0.16
148	688029	南微医学	9,116	615,785.80	0.16
149	688800	瑞可达	12,476	613,819.20	0.16
150	688591	泰凌微	12,799	613,072.10	0.16
151	688352	颀中科技	54,560	612,708.80	0.16
152	688722	同益中	28,768	611,895.36	0.16
153	688153	唯捷创芯	19,718	611,455.18	0.16
154	688696	极米科技	5,321	608,509.56	0.16
155	688409	富创精密	10,904	599,829.04	0.16
156	688685	迈信林	10,707	597,985.95	0.16
157	688158	优刻得	26,301	594,928.62	0.16
158	688388	嘉元科技	29,492	592,199.36	0.16
159	688373	盟科药业	93,814	588,213.78	0.15
160	688519	南亚新材	13,126	588,044.80	0.15
161	688107	安路科技	20,713	584,935.12	0.15
162	688295	中复神鹰	27,212	566,009.60	0.15
163	688131	皓元医药	11,529	557,427.15	0.15
164	688206	概伦电子	19,151	556,911.08	0.15
165	688362	甬矽电子	18,537	552,031.86	0.14
166	688311	盟升电子	12,822	551,987.10	0.14
167	688277	天智航	39,114	543,684.60	0.14
168	688016	心脉医疗	6,101	539,450.42	0.14
169	688160	步科股份	6,287	538,795.90	0.14
170	688700	东威科技	13,567	535,218.15	0.14
171	688006	杭可科技	27,326	532,857.00	0.14
172	688298	东方生物	19,471	532,531.85	0.14

173	688432	有研硅	48,231	532,470.24	0.14
174	688686	奥普特	5,525	528,300.50	0.14
175	688798	艾为电子	7,681	523,844.20	0.14
176	688661	和林微纳	13,107	521,265.39	0.14
177	688390	固德威	11,974	520,270.30	0.14
178	688195	腾景科技	11,510	517,950.00	0.14
179	688549	中巨芯	66,035	511,110.90	0.13
180	688518	联赢激光	24,850	506,691.50	0.13
181	688112	鼎阳科技	13,512	499,538.64	0.13
182	688312	燕麦科技	20,561	494,080.83	0.13
183	688523	航天环宇	22,803	490,492.53	0.13
184	688328	深科达	21,519	487,405.35	0.13
185	688048	长光华芯	8,382	483,976.68	0.13
186	688108	赛诺医疗	43,124	483,851.28	0.13
187	688408	中信博	10,347	482,997.96	0.13
188	688512	慧智微	43,581	475,468.71	0.12
189	688139	海尔生物	15,126	467,242.14	0.12
190	688766	普冉股份	7,321	462,687.20	0.12
191	688091	上海谊众	9,845	460,549.10	0.12
192	688458	美芯晟	9,681	456,555.96	0.12
193	688261	东微半导	11,044	455,565.00	0.12
194	688381	帝奥微	20,886	452,390.76	0.12
195	688270	臻镭科技	9,683	450,840.48	0.12
196	688697	纽威数控	33,758	450,331.72	0.12
197	688652	京仪装备	7,832	448,930.24	0.12
198	688588	凌志软件	30,788	448,581.16	0.12
199	688595	芯海科技	11,948	446,735.72	0.12
200	688081	兴图新科	21,446	446,291.26	0.12
201	688590	新致软件	21,647	444,629.38	0.12
202	688173	希荻微	32,518	444,195.88	0.12
203	688503	聚和材料	10,673	441,755.47	0.12
204	688677	海泰新光	11,231	438,121.31	0.11
205	688663	新风光	16,228	437,344.60	0.11
206	688039	当虹科技	13,322	437,228.04	0.11
207	688787	海天瑞声	4,091	434,382.38	0.11
208	688372	伟测科技	7,182	433,792.80	0.11
209	688181	八亿时空	13,854	431,136.48	0.11
210	688317	之江生物	23,875	430,227.50	0.11
211	688609	九联科技	40,842	427,615.74	0.11
212	688558	国盛智科	16,806	424,183.44	0.11
213	688321	微芯生物	17,832	424,044.96	0.11
214	688128	中国电研	17,140	419,930.00	0.11
215	688084	晶品特装	4,763	419,144.00	0.11

216	688238	和元生物	67,211	416,708.20	0.11
217	688179	阿拉丁	32,632	415,079.04	0.11
218	688198	佰仁医疗	4,018	412,608.42	0.11
219	688596	正帆科技	12,125	411,280.00	0.11
220	688552	航天南湖	10,280	410,274.80	0.11
221	688231	隆达股份	22,197	400,655.85	0.11
222	688339	亿华通	18,441	393,715.35	0.10
223	688456	有研粉材	10,892	391,567.40	0.10
224	688257	新锐股份	26,657	390,525.05	0.10
225	688133	泰坦科技	16,928	389,682.56	0.10
226	688015	交控科技	18,555	386,686.20	0.10
227	688559	海目星	11,680	384,272.00	0.10
228	688225	亚信安全	18,816	383,658.24	0.10
229	688631	莱斯信息	4,290	382,668.00	0.10
230	688068	热景生物	2,716	380,620.24	0.10
231	688575	亚辉龙	26,054	380,127.86	0.10
232	688093	世华科技	12,121	376,357.05	0.10
233	688507	索辰科技	5,118	375,302.94	0.10
234	688138	清溢光电	13,788	374,895.72	0.10
235	688358	祥生医疗	12,572	372,759.80	0.10
236	688332	中科蓝讯	3,597	370,778.76	0.10
237	688639	华恒生物	11,674	370,065.80	0.10
238	688515	裕太微	3,993	365,758.80	0.10
239	688658	悦康药业	19,183	365,244.32	0.10
240	688788	科思科技	7,967	363,852.89	0.10
241	688293	奥浦迈	8,083	363,815.83	0.10
242	688273	麦澜德	12,028	363,365.88	0.10
243	688589	力合微	16,947	362,496.33	0.10
244	688716	中研股份	10,168	361,980.80	0.09
245	688365	光云科技	23,766	361,718.52	0.09
246	688435	英方软件	10,950	360,693.00	0.09
247	688659	元琛科技	41,234	359,972.82	0.09
248	688032	禾迈股份	3,601	359,595.86	0.09
249	688600	皖仪科技	15,261	358,633.50	0.09
250	688286	敏芯股份	5,056	357,408.64	0.09
251	688401	路维光电	10,266	356,230.20	0.09
252	688025	杰普特	4,954	354,211.00	0.09
253	688255	凯尔达	10,484	353,205.96	0.09
254	688059	华锐精密	7,532	352,196.32	0.09
255	688526	科前生物	22,589	351,936.62	0.09
256	688776	国光电气	3,323	350,510.04	0.09
257	688488	艾迪药业	25,275	350,058.75	0.09
258	688185	康希诺	5,857	349,252.91	0.09

259	688050	爱博医疗	5,057	348,174.45	0.09
260	688392	骄成超声	5,026	342,421.38	0.09
261	688285	高铁电气	41,640	341,448.00	0.09
262	688118	普元信息	15,259	341,038.65	0.09
263	688056	莱伯泰科	10,198	340,409.24	0.09
264	688369	致远互联	12,747	336,393.33	0.09
265	688239	航宇科技	9,598	335,738.04	0.09
266	688010	福光股份	10,808	335,480.32	0.09
267	688290	景业智能	6,431	335,183.72	0.09
268	688611	杭州柯林	10,210	333,152.30	0.09
269	688348	昱能科技	7,749	332,974.53	0.09
270	688314	康拓医疗	10,744	331,774.72	0.09
271	688626	翔宇医疗	7,492	329,797.84	0.09
272	688551	科威尔	11,146	327,580.94	0.09
273	688517	金冠电气	22,662	325,879.56	0.09
274	688593	新相微	19,883	324,689.39	0.09
275	688499	利元亨	7,784	323,892.24	0.08
276	688606	奥泰生物	4,812	323,366.40	0.08
277	688622	禾信仪器	4,109	323,255.03	0.08
278	688553	汇宇制药	19,771	322,069.59	0.08
279	688707	振华新材	23,406	317,151.30	0.08
280	688543	国科军工	5,267	317,020.73	0.08
281	688439	振华风光	5,426	316,064.50	0.08
282	688046	药康生物	20,952	315,118.08	0.08
283	688598	金博股份	12,357	314,114.94	0.08
284	688085	三友医疗	16,324	313,910.52	0.08
285	688155	先惠技术	6,081	313,901.22	0.08
286	688103	国力股份	5,137	312,535.08	0.08
287	688176	亚虹医药	35,214	312,348.18	0.08
288	688428	诺诚健华	12,558	306,791.94	0.08
289	688083	中望软件	4,745	305,625.45	0.08
290	688621	阳光诺和	6,092	303,929.88	0.08
291	688062	迈威生物	10,714	302,991.92	0.08
292	688320	禾川科技	6,403	302,797.87	0.08
293	688186	广大特材	10,567	302,321.87	0.08
294	688190	云路股份	3,250	300,820.00	0.08
295	688319	欧林生物	19,105	299,184.30	0.08
296	688023	安恒信息	5,184	294,140.16	0.08
297	688280	精进电动	40,266	292,733.82	0.08
298	688090	瑞松科技	8,509	292,624.51	0.08
299	688602	康鹏科技	34,827	291,850.26	0.08
300	688004	博汇科技	14,555	289,644.50	0.08
301	688168	安博通	4,052	287,165.24	0.08

302	688486	龙迅股份	4,250	284,240.00	0.07
303	688259	创耀科技	7,166	284,131.90	0.07
304	688410	山外山	19,983	283,758.60	0.07
305	688205	德科立	4,519	283,296.11	0.07
306	688711	宏微科技	16,017	281,739.03	0.07
307	688548	广钢气体	28,094	281,501.88	0.07
308	688510	航亚科技	11,639	281,431.02	0.07
309	688035	德邦科技	6,892	279,953.04	0.07
310	688386	泛亚微透	5,133	278,773.23	0.07
311	688669	聚石化学	14,745	278,238.15	0.07
312	688625	呈和科技	9,089	277,941.62	0.07
313	688020	方邦股份	7,274	275,466.38	0.07
314	688038	中科通达	17,341	275,201.67	0.07
315	688577	浙海德曼	5,831	273,415.59	0.07
316	688395	正弦电气	11,976	271,615.68	0.07
317	688612	威迈斯	10,116	270,501.84	0.07
318	688505	复旦张江	31,017	268,607.22	0.07
319	688719	爱科赛博	6,319	268,557.50	0.07
320	688565	力源科技	28,911	267,426.75	0.07
321	688636	智明达	7,891	266,636.89	0.07
322	688651	盛邦安全	7,778	265,463.14	0.07
323	688202	美迪西	7,371	264,840.03	0.07
324	688334	西高院	15,366	263,987.88	0.07
325	688022	瀚川智能	17,743	262,951.26	0.07
326	688288	鸿泉物联	8,957	259,842.57	0.07
327	688117	圣诺生物	7,675	258,263.75	0.07
328	688371	菲沃泰	15,520	257,011.20	0.07
329	688368	晶丰明源	2,894	254,180.02	0.07
330	688087	英科再生	9,869	253,633.30	0.07
331	688556	高测股份	35,321	253,604.78	0.07
332	688275	万润新能	6,253	253,559.15	0.07
333	688026	洁特生物	15,448	253,347.20	0.07
334	688218	江苏北人	11,621	252,175.70	0.07
335	688228	开普云	4,246	252,127.48	0.07
336	688779	五矿新能	46,048	250,501.12	0.07
337	688557	兰剑智能	8,336	249,496.48	0.07
338	688222	成都先导	15,448	248,403.84	0.07
339	688573	信宇人	7,151	247,424.60	0.06
340	688096	京源环保	16,034	244,037.48	0.06
341	688305	科德数控	4,355	243,052.55	0.06
342	688075	安旭生物	6,317	242,383.29	0.06
343	688236	春立医疗	12,851	238,900.09	0.06
344	688376	美埃科技	6,353	236,776.31	0.06

345	688226	威腾电气	9,019	235,756.66	0.06
346	688399	硕世生物	4,656	235,128.00	0.06
347	688653	康希通信	19,116	234,171.00	0.06
348	688665	四方光电	5,231	233,930.32	0.06
349	688143	长盈通	5,809	226,551.00	0.06
350	688378	奥来德	13,371	225,301.35	0.06
351	688276	百克生物	10,641	223,461.00	0.06
352	688247	宣泰医药	21,522	222,322.26	0.06
353	688620	安凯微	17,713	221,589.63	0.06
354	688326	经纬恒润	2,467	220,155.08	0.06
355	688570	天玛智控	10,686	218,849.28	0.06
356	688167	炬光科技	2,704	218,348.00	0.06
357	688580	伟思医疗	4,678	217,480.22	0.06
358	688569	铁科轨道	10,377	213,766.20	0.06
359	688687	凯因科技	7,975	212,055.25	0.06
360	688366	昊海生科	4,122	211,211.28	0.06
361	688089	嘉必优	8,394	211,109.10	0.06
362	688720	艾森股份	4,918	210,441.22	0.06
363	688623	二元科技	3,332	209,149.64	0.05
364	688102	斯瑞新材	15,440	208,131.20	0.05
365	688079	美迪凯	20,665	207,476.60	0.05
366	688119	中钢洛耐	49,599	207,323.82	0.05
367	688579	山大地纬	18,391	205,795.29	0.05
368	688135	利扬芯片	9,676	200,389.96	0.05
369	688628	优利德	5,872	197,005.60	0.05
370	688337	普源精电	5,497	196,077.99	0.05
371	688162	巨一科技	7,143	194,575.32	0.05
372	688244	永信至诚	7,325	192,794.00	0.05
373	688246	嘉和美康	6,539	192,181.21	0.05
374	688586	江航装备	16,777	188,741.25	0.05
375	688077	大地熊	5,878	187,802.10	0.05
376	688049	炬芯科技	3,098	187,429.00	0.05
377	688227	品高股份	5,879	184,835.76	0.05
378	688733	壹石通	9,744	184,551.36	0.05
379	688106	金宏气体	10,232	183,050.48	0.05
380	688207	格灵深瞳	12,058	182,075.80	0.05
381	688330	宏力达	7,067	181,480.56	0.05
382	688786	悦安新材	7,722	179,922.60	0.05
383	688212	澳华内镜	3,594	176,106.00	0.05
384	688581	安杰思	2,712	175,818.96	0.05
385	688196	卓越新能	3,655	175,695.85	0.05
386	688391	钜泉科技	5,865	174,131.85	0.05
387	688073	毕得医药	2,963	171,913.26	0.05

388	688667	菱电电控	3,229	171,815.09	0.05
389	688221	前沿生物	17,110	171,784.40	0.05
390	688210	统联精密	7,504	171,091.20	0.04
391	688229	博睿数据	3,346	170,478.70	0.04
392	688585	上纬新材	21,793	169,549.54	0.04
393	688283	坤恒顺维	6,153	168,899.85	0.04
394	688662	富信科技	4,598	167,597.10	0.04
395	688132	邦彦技术	8,229	167,048.70	0.04
396	688356	键凯科技	2,298	162,238.80	0.04
397	688513	苑东生物	3,940	161,776.40	0.04
398	688682	霍莱沃	5,165	161,664.50	0.04
399	688033	天宜新材	25,142	161,160.22	0.04
400	688357	建龙微纳	5,514	158,748.06	0.04
401	688657	浩辰软件	3,718	157,903.46	0.04
402	688057	金达莱	12,887	157,221.40	0.04
403	688359	三孚新科	2,940	155,055.60	0.04
404	688689	银河微电	6,498	149,908.86	0.04
405	688571	杭华股份	19,363	149,288.73	0.04
406	688323	瑞华泰	10,242	148,611.42	0.04
407	688699	明微电子	4,579	148,268.02	0.04
408	688601	力芯微	3,702	147,894.90	0.04
409	688529	豪森智能	8,117	145,618.98	0.04
410	688152	麒麟信安	3,081	144,375.66	0.04
411	688448	磁谷科技	4,918	144,048.22	0.04
412	688560	明冠新材	9,478	143,781.26	0.04
413	688420	美腾科技	6,018	143,469.12	0.04
414	688429	时创能源	9,843	143,117.22	0.04
415	688007	光峰科技	9,790	141,563.40	0.04
416	688308	欧科亿	7,632	140,810.40	0.04
417	688353	华盛锂电	4,244	140,391.52	0.04
418	688265	南模生物	4,349	140,081.29	0.04
419	688468	科美诊断	18,990	139,766.40	0.04
420	688157	松井股份	3,467	138,263.96	0.04
421	688466	金科环境	7,820	138,257.60	0.04
422	688268	华特气体	2,730	137,510.10	0.04
423	688078	龙软科技	4,312	136,690.40	0.04
424	688393	安必平	4,754	136,629.96	0.04
425	688345	博力威	4,911	135,298.05	0.04
426	688121	卓然股份	11,113	134,245.04	0.04
427	688030	山石网科	8,348	133,484.52	0.03
428	688325	赛微微电	2,771	133,008.00	0.03
429	688768	容知日新	2,985	132,504.15	0.03
430	688450	光格科技	5,009	132,337.78	0.03

431	688693	锆威特	3,994	131,841.94	0.03
432	688092	爱科科技	5,905	131,681.50	0.03
433	688695	中创股份	4,358	129,432.60	0.03
434	688070	纵横股份	2,679	129,395.70	0.03
435	688539	高华科技	4,852	129,063.20	0.03
436	688597	煜邦电力	16,345	127,981.35	0.03
437	688799	华纳药厂	3,086	127,451.80	0.03
438	688148	芳源股份	23,355	126,350.55	0.03
439	688251	井松智能	5,823	125,543.88	0.03
440	688603	天承科技	2,834	125,262.80	0.03
441	688115	思林杰	2,328	119,659.20	0.03
442	688607	康众医疗	6,325	118,593.75	0.03
443	688389	普门科技	9,107	117,662.44	0.03
444	688253	英诺特	3,749	115,694.14	0.03
445	688080	映翰通	2,257	114,858.73	0.03
446	688459	哈铁科技	11,934	114,566.40	0.03
447	688197	首药控股	3,155	114,211.00	0.03
448	688058	宝兰德	3,944	113,074.48	0.03
449	688576	西山科技	1,764	112,190.40	0.03
450	688633	星球石墨	4,091	111,397.93	0.03
451	688061	灿瑞科技	3,379	110,831.20	0.03
452	688045	必易微	3,218	110,699.20	0.03
453	688478	晶升股份	3,615	110,619.00	0.03
454	688360	德马科技	5,961	110,576.55	0.03
455	688066	航天宏图	5,642	110,470.36	0.03
456	688383	新益昌	2,171	110,417.06	0.03
457	688616	西力科技	8,545	108,692.40	0.03
458	688267	中触媒	3,744	107,752.32	0.03
459	688355	明志科技	6,105	107,264.85	0.03
460	688592	司南导航	2,303	106,605.87	0.03
461	688416	恒烁股份	2,614	105,239.64	0.03
462	688533	上声电子	3,791	102,091.63	0.03
463	688101	三达膜	7,047	98,235.18	0.03
464	688316	青云科技	1,535	97,272.95	0.03
465	688398	赛特新材	4,514	93,484.94	0.02
466	688137	近岸蛋白	2,420	92,686.00	0.02
467	688419	耐科装备	2,479	92,417.12	0.02
468	688269	凯立新材	2,764	91,764.80	0.02
469	688610	埃科光电	2,306	91,455.96	0.02
470	688193	仁度生物	2,121	89,145.63	0.02
471	688201	信安世纪	6,785	87,865.75	0.02
472	688125	安达智能	2,354	86,391.80	0.02
473	688501	青达环保	3,065	85,360.25	0.02

474	688683	莱尔科技	3,271	82,494.62	0.02
475	688718	唯赛勃	6,419	79,467.22	0.02
476	688069	德林海	4,057	78,908.65	0.02
477	688292	浩瀚深度	4,077	78,441.48	0.02
478	688618	三旺通信	3,200	78,080.00	0.02
479	688485	九州一轨	7,054	76,818.06	0.02
480	688170	德龙激光	3,041	76,633.20	0.02
481	688163	赛伦生物	3,894	75,738.30	0.02
482	688528	秦川物联	7,257	75,182.52	0.02
483	688189	南新制药	10,028	74,608.32	0.02
484	688060	云涌科技	2,039	74,607.01	0.02
485	688338	赛科希德	2,960	74,532.80	0.02
486	688379	华光新材	2,126	73,687.16	0.02
487	688350	富淼科技	4,603	73,371.82	0.02
488	688679	通源环境	4,890	73,203.30	0.02
489	688260	昀冢科技	4,422	72,874.56	0.02
490	688178	万德斯	3,105	71,477.10	0.02
491	688479	友车科技	3,779	71,423.10	0.02
492	688509	正元地信	16,355	70,162.95	0.02
493	688335	复洁环保	5,749	70,137.80	0.02
494	688370	丛麟科技	3,633	69,426.63	0.02
495	688670	金迪克	4,906	68,438.70	0.02
496	688216	气派科技	2,964	67,964.52	0.02
497	688156	路德环境	3,990	67,470.90	0.02
498	688291	金橙子	2,164	65,590.84	0.02
499	688067	爱威科技	3,034	65,261.34	0.02
500	688329	艾隆科技	3,329	64,049.96	0.02
501	688681	科汇股份	4,498	62,972.00	0.02
502	688310	迈得医疗	4,229	62,335.46	0.02
503	688098	申联生物	10,154	62,040.94	0.02
504	688307	中润光学	2,181	62,027.64	0.02
505	688655	迅捷兴	2,904	61,535.76	0.02
506	688113	联测科技	1,642	59,423.98	0.02
507	688021	奥福科技	3,881	59,340.49	0.02
508	688701	卓锦股份	6,928	57,086.72	0.01
509	688175	高凌信息	2,799	56,903.67	0.01
510	688613	奥精医疗	2,897	55,390.64	0.01
511	688109	品茗科技	1,779	55,380.27	0.01
512	688237	超卓航科	1,882	55,010.86	0.01
513	688737	中自科技	2,550	54,825.00	0.01
514	688671	碧兴物联	1,846	39,412.10	0.01
515	688215	瑞晟智能	821	31,214.42	0.01
516	688367	工大高科	1,766	31,169.90	0.01

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	300454	深信服	3,100	291,958.00	0.08
2	300170	汉得信息	16,000	275,360.00	0.07
3	300850	新强联	7,500	268,650.00	0.07
4	002837	英维克	9,000	267,390.00	0.07
5	300378	鼎捷数智	6,200	226,920.00	0.06
6	603228	景旺电子	5,300	221,752.00	0.06
7	00013	和黄医药	10,000	214,764.23	0.06
8	603893	瑞芯微	1,400	212,604.00	0.06
9	002916	深南电路	1,930	208,073.30	0.05
10	001309	德明利	1,700	201,178.00	0.05
11	002851	麦格米特	4,000	200,560.00	0.05
12	603985	恒润股份	12,800	199,424.00	0.05
13	000581	威孚高科	10,500	198,870.00	0.05
14	603920	世运电路	6,500	198,315.00	0.05
15	603319	美湖股份	5,500	194,810.00	0.05
16	300738	奥飞数据	9,300	194,649.00	0.05
17	600710	苏美达	20,200	194,122.00	0.05
18	301397	溯联股份	5,500	193,490.00	0.05
19	002463	沪电股份	4,500	191,610.00	0.05
20	603236	移远通信	2,200	188,760.00	0.05
21	001389	广合科技	3,200	188,064.00	0.05
22	002487	大金重工	5,700	187,530.00	0.05
23	600183	生益科技	6,200	186,930.00	0.05
24	600640	国脉文化	15,300	185,436.00	0.05
25	603881	数据港	7,220	184,471.00	0.05
26	603083	剑桥科技	3,900	184,470.00	0.05
27	300654	世纪天鸿	17,400	182,352.00	0.05
28	301155	海力风电	2,500	179,750.00	0.05
29	000977	浪潮信息	3,500	178,080.00	0.05
30	601858	中国科传	9,000	175,050.00	0.05
31	002189	中光学	5,500	169,400.00	0.04
32	300491	通合科技	8,400	160,440.00	0.04
33	002518	科士达	7,000	158,130.00	0.04
34	002733	雄韬股份	9,500	156,465.00	0.04
35	601127	赛力斯	1,000	134,320.00	0.04
36	002371	北方华创	300	132,663.00	0.03
37	600967	内蒙一机	6,600	127,710.00	0.03

38	301596	瑞迪智驱	1,440	125,884.80	0.03
39	688583	思看科技	1,533	125,200.11	0.03
40	301205	联特科技	1,300	124,618.00	0.03
41	300476	胜宏科技	900	120,942.00	0.03
42	300570	太辰光	1,200	115,656.00	0.03
43	603501	豪威集团	900	114,885.00	0.03
44	603986	兆易创新	900	113,877.00	0.03
45	301308	江波龙	1,300	113,737.00	0.03
46	002850	科达利	1,000	113,170.00	0.03
47	301325	曼恩斯特	1,800	112,140.00	0.03
48	301196	唯科科技	1,600	108,272.00	0.03
49	003021	兆威机电	1,000	108,150.00	0.03
50	601100	恒立液压	1,500	108,000.00	0.03
51	600184	光电股份	6,100	107,116.00	0.03
52	002896	中大力德	1,820	105,396.20	0.03
53	002402	和而泰	4,500	104,265.00	0.03
54	300394	天孚通信	1,300	103,792.00	0.03
55	300857	协创数据	1,200	103,272.00	0.03
56	002048	宁波华翔	5,600	103,096.00	0.03
57	605133	嵘泰股份	2,300	101,384.00	0.03
58	605277	新亚电子	5,600	100,576.00	0.03
59	300648	星云股份	2,900	100,224.00	0.03
60	300548	博创科技	1,500	100,155.00	0.03
61	603596	伯特利	1,900	100,111.00	0.03
62	300990	同飞股份	2,000	99,800.00	0.03
63	002922	伊戈尔	6,300	99,099.00	0.03
64	001306	夏厦精密	1,300	98,722.00	0.03
65	600536	中国软件	2,100	98,217.00	0.03
66	000700	模塑科技	12,500	98,125.00	0.03
67	003019	宸展光电	2,800	98,084.00	0.03
68	603855	华荣股份	4,400	97,372.00	0.03
69	300984	金沃股份	1,700	97,325.00	0.03
70	300718	长盛轴承	1,400	97,286.00	0.03
71	603119	浙江荣泰	2,100	97,104.00	0.03
72	300395	菲利华	1,900	97,090.00	0.03
73	300124	汇川技术	1,500	96,855.00	0.03
74	300863	卡倍亿	2,500	96,350.00	0.03
75	300820	英杰电气	2,100	96,285.00	0.03
76	002645	华宏科技	10,600	96,248.00	0.03
77	301160	翔楼新材	1,200	96,096.00	0.03
78	300693	盛弘股份	3,200	95,872.00	0.03
79	300602	飞荣达	4,500	95,445.00	0.03
80	301268	铭利达	5,100	94,605.00	0.02

81	300095	华伍股份	9,100	94,276.00	0.02
82	300465	高伟达	5,700	94,221.00	0.02
83	603179	新泉股份	2,000	93,940.00	0.02
84	002829	星网宇达	4,300	93,826.00	0.02
85	300926	博俊科技	3,500	92,645.00	0.02
86	300660	江苏雷利	2,080	92,019.20	0.02
87	001339	智微智能	1,900	91,827.00	0.02
88	600764	中国海防	2,700	91,800.00	0.02
89	301128	强瑞技术	1,800	91,476.00	0.02
90	002913	奥士康	3,100	91,171.00	0.02
91	300024	机器人	5,300	91,054.00	0.02
92	603738	泰晶科技	6,200	91,016.00	0.02
93	301000	肇民科技	1,900	90,516.00	0.02
94	301536	星辰科技	1,500	90,450.00	0.02
95	300696	爱乐达	4,000	90,320.00	0.02
96	603305	旭升集团	6,900	90,045.00	0.02
97	300223	北京君正	1,300	89,960.00	0.02
98	300275	梅安森	6,800	89,896.00	0.02
99	601689	拓普集团	1,900	89,775.00	0.02
100	600571	信雅达	5,200	89,752.00	0.02
101	002156	通富微电	3,500	89,670.00	0.02
102	600933	爱柯迪	5,600	89,656.00	0.02
103	000988	华工科技	1,900	89,319.00	0.02
104	000917	电广传媒	11,800	89,208.00	0.02
105	605208	永茂泰	6,700	89,110.00	0.02
106	300475	香农芯创	2,500	89,075.00	0.02
107	002747	埃斯顿	4,400	89,056.00	0.02
108	605319	无锡振华	2,600	88,816.00	0.02
109	300133	华策影视	11,800	88,618.00	0.02
110	002979	雷赛智能	2,000	88,560.00	0.02
111	603130	云中马	3,000	88,530.00	0.02
112	002139	拓邦股份	6,400	88,384.00	0.02
113	605555	德昌股份	5,330	88,318.10	0.02
114	002881	美格智能	1,900	88,160.00	0.02
115	002130	沃尔核材	3,700	88,134.00	0.02
116	002484	江海股份	4,300	88,107.00	0.02
117	605128	上海沿浦	2,900	87,754.00	0.02
118	603348	文灿股份	4,200	87,696.00	0.02
119	300456	赛微电子	5,100	87,669.00	0.02
120	603112	华翔股份	5,300	87,662.00	0.02
121	001288	运机集团	4,200	87,486.00	0.02
122	300590	移为通信	6,700	87,167.00	0.02
123	300852	四会富仕	2,700	87,129.00	0.02

124	600835	上海机电	4,100	87,125.00	0.02
125	002050	三花智控	3,300	87,054.00	0.02
126	002698	博实股份	5,600	87,024.00	0.02
127	603000	人民网	4,300	86,903.00	0.02
128	002600	领益智造	10,100	86,759.00	0.02
129	300946	恒而达	1,840	86,590.40	0.02
130	603081	大丰实业	8,000	86,560.00	0.02
131	001282	三联锻造	4,240	86,326.40	0.02
132	000887	中鼎股份	4,900	86,191.00	0.02
133	301255	通力科技	2,800	86,128.00	0.02
134	300549	优德精密	4,700	85,963.00	0.02
135	300115	长盈精密	4,000	85,600.00	0.02
136	002380	科远智慧	3,500	85,575.00	0.02
137	600588	用友网络	6,400	85,568.00	0.02
138	002892	科力尔	6,140	85,530.20	0.02
139	300083	创世纪	10,400	85,488.00	0.02
140	600699	均胜电子	4,900	85,456.00	0.02
141	300031	宝通科技	3,400	85,102.00	0.02
142	301313	凡拓数创	3,500	85,050.00	0.02
143	300433	蓝思科技	3,800	84,740.00	0.02
144	002009	天奇股份	5,500	84,645.00	0.02
145	002283	天润工业	14,200	84,632.00	0.02
146	301328	维峰电子	2,000	84,300.00	0.02
147	600580	卧龙电驱	4,260	84,220.20	0.02
148	600480	凌云股份	6,920	84,216.40	0.02
149	603730	岱美股份	14,800	84,212.00	0.02
150	300432	富临精工	6,440	84,170.80	0.02
151	603344	星德胜	3,300	83,952.00	0.02
152	300611	美力科技	3,600	83,844.00	0.02
153	600143	金发科技	8,100	83,511.00	0.02
154	300217	东方电热	15,800	83,266.00	0.02
155	300258	精锻科技	6,000	82,920.00	0.02
156	000936	华西股份	12,000	82,560.00	0.02
157	300819	聚杰微纤	3,500	82,530.00	0.02
158	605333	沪光股份	3,000	82,350.00	0.02
159	002276	万马股份	5,700	82,308.00	0.02
160	603666	亿嘉和	2,400	82,176.00	0.02
161	300382	斯莱克	5,400	82,134.00	0.02
162	603166	福达股份	5,300	81,991.00	0.02
163	603375	盛景微	2,200	81,730.00	0.02
164	002527	新时达	5,600	81,704.00	0.02
165	301052	果麦文化	2,000	81,600.00	0.02
166	301013	利和兴	4,800	81,360.00	0.02

167	300580	贝斯特	3,300	81,081.00	0.02
168	002997	瑞鹄模具	2,200	81,070.00	0.02
169	301459	丰茂股份	1,900	80,560.00	0.02
170	605589	圣泉集团	2,900	80,475.00	0.02
171	002915	中欣氟材	4,500	80,460.00	0.02
172	002472	双环传动	2,400	80,376.00	0.02
173	002126	银轮股份	3,300	80,124.00	0.02
174	603901	永创智能	7,600	80,104.00	0.02
175	002520	日发精机	12,500	79,875.00	0.02
176	002031	巨轮智能	9,800	79,576.00	0.02
177	603278	大业股份	8,700	79,170.00	0.02
178	002599	盛通股份	9,500	79,135.00	0.02
179	605228	神通科技	7,200	79,128.00	0.02
180	300593	新雷能	5,900	79,060.00	0.02
181	600633	浙数文化	5,700	78,888.00	0.02
182	301280	珠城科技	2,000	78,360.00	0.02
183	300354	东华测试	2,000	77,760.00	0.02
184	002801	微光股份	2,400	77,688.00	0.02
185	300980	祥源新材	3,300	77,286.00	0.02
186	301310	鑫宏业	2,100	77,154.00	0.02
187	003033	征和工业	1,800	76,302.00	0.02
188	600577	精达股份	10,200	75,888.00	0.02
189	300607	拓斯达	2,200	74,998.00	0.02
190	300952	恒辉安防	2,600	74,048.00	0.02
191	603489	八方股份	2,700	73,278.00	0.02
192	300353	东土科技	3,400	72,590.00	0.02
193	605488	福莱新材	2,160	70,696.80	0.02
194	300418	昆仑万维	2,100	70,623.00	0.02
195	301210	金杨股份	1,700	70,618.00	0.02
196	301076	新瀚新材	2,000	69,560.00	0.02
197	603286	日盈电子	2,300	68,494.00	0.02
198	300680	隆盛科技	1,800	68,238.00	0.02
199	301291	明阳电气	1,500	61,725.00	0.02
200	301125	腾亚精工	2,400	42,312.00	0.01
201	300971	博亚精工	1,700	36,584.00	0.01
202	000632	三木集团	8,000	32,960.00	0.01
203	605567	春雪食品	3,200	32,736.00	0.01
204	300665	飞鹿股份	3,900	32,604.00	0.01
205	600137	浪莎股份	1,700	32,198.00	0.01
206	002780	三夫户外	2,400	32,136.00	0.01
207	300931	通用电梯	4,200	32,046.00	0.01
208	301167	建研设计	2,000	31,920.00	0.01
209	603400	华之杰	569	31,875.73	0.01

210	002963	豪尔赛	2,500	31,725.00	0.01
211	300958	建工修复	2,400	31,608.00	0.01
212	300500	启迪设计	2,600	31,590.00	0.01
213	301098	金埔园林	3,500	31,570.00	0.01
214	002494	华斯股份	6,200	31,558.00	0.01
215	300640	德艺文创	4,700	31,443.00	0.01
216	002486	嘉麟杰	12,000	31,440.00	0.01
217	002295	精艺股份	3,700	31,376.00	0.01
217	603183	建研院	7,400	31,376.00	0.01
219	301113	雅艺科技	1,500	31,365.00	0.01
220	301198	喜悦智行	2,800	31,332.00	0.01
221	603937	丽岛新材	3,200	31,296.00	0.01
222	301237	和顺科技	1,100	31,251.00	0.01
223	603903	中持股份	4,000	31,240.00	0.01
224	301057	汇隆新材	1,900	31,236.00	0.01
225	003011	海象新材	1,700	31,229.00	0.01
226	300126	锐奇股份	4,300	31,218.00	0.01
227	003003	天元股份	2,700	31,212.00	0.01
228	300626	华瑞股份	2,900	31,204.00	0.01
229	300955	嘉亨家化	1,600	31,200.00	0.01
230	600493	凤竹纺织	4,900	31,164.00	0.01
231	603331	百达精工	3,000	31,140.00	0.01
232	603860	中公高科	1,000	31,120.00	0.01
233	300749	顶固集创	3,700	31,117.00	0.01
234	300621	维业股份	3,500	31,115.00	0.01
235	300883	龙利得	5,000	31,100.00	0.01
236	002836	新宏泽	3,300	31,086.00	0.01
236	002910	庄园牧场	3,300	31,086.00	0.01
238	301006	迈拓股份	2,000	31,080.00	0.01
239	300658	延江股份	4,800	31,056.00	0.01
240	001278	一彬科技	1,800	31,050.00	0.01
241	301037	保立佳	2,400	30,888.00	0.01
242	301081	严牌股份	3,200	30,880.00	0.01
243	600768	宁波富邦	2,700	30,861.00	0.01
244	603041	美思德	2,600	30,836.00	0.01
245	300717	华信新材	1,700	30,821.00	0.01
246	301010	晶雪节能	1,800	30,816.00	0.01
247	301043	绿岛风	1,000	30,760.00	0.01
248	603272	联翔股份	1,800	30,672.00	0.01
249	300877	金春股份	1,900	30,666.00	0.01
250	300854	中兰环保	1,800	30,654.00	0.01
251	001259	利仁科技	1,200	30,648.00	0.01
252	002858	力盛体育	2,300	30,636.00	0.01

253	300929	华骐环保	2,900	30,624.00	0.01
254	600883	博闻科技	3,900	30,615.00	0.01
255	300614	百川畅银	2,300	30,613.00	0.01
256	003017	大洋生物	1,200	30,600.00	0.01
257	300838	浙江力诺	2,100	30,534.00	0.01
258	001366	播恩集团	2,500	30,525.00	0.01
259	605122	四方新材	2,600	30,524.00	0.01
260	301515	港通医疗	1,500	30,495.00	0.01
261	300948	冠中生态	2,800	30,492.00	0.01
262	002830	名雕股份	2,000	30,480.00	0.01
263	603029	天鹅股份	1,700	30,464.00	0.01
264	002883	中设股份	2,700	30,456.00	0.01
265	605287	德才股份	2,100	30,429.00	0.01
266	003023	彩虹集团	1,500	30,420.00	0.01
267	002144	宏达高科	2,600	30,394.00	0.01
268	603073	彩蝶实业	1,800	30,330.00	0.01
269	603172	万丰股份	1,900	30,267.00	0.01
270	600697	欧亚集团	2,500	30,250.00	0.01
271	001231	农心科技	1,500	30,180.00	0.01
272	001260	坤泰股份	1,600	30,128.00	0.01
273	001210	金房能源	2,200	30,118.00	0.01
274	002718	友邦吊顶	1,900	30,096.00	0.01
275	301231	荣信文化	1,300	30,095.00	0.01
276	001373	翔腾新材	1,000	30,040.00	0.01
277	603709	中源家居	2,300	30,038.00	0.01
278	301163	宏德股份	1,200	30,000.00	0.01
279	301234	五洲医疗	1,000	29,910.00	0.01
280	300923	研奥股份	1,200	29,880.00	0.01
281	300823	建科智能	2,000	29,780.00	0.01
282	001336	楚环科技	1,400	29,778.00	0.01
283	300675	建科院	2,000	29,600.00	0.01
284	605177	东亚药业	1,600	29,552.00	0.01
285	300668	杰恩设计	1,700	29,529.00	0.01
286	600455	博通股份	1,100	29,414.00	0.01
287	301429	森泰股份	1,600	29,408.00	0.01
288	301273	瑞晨环保	1,200	29,280.00	0.01
289	301390	经纬股份	800	28,896.00	0.01
290	301272	英华特	800	28,720.00	0.01
291	001226	拓山重工	1,000	27,840.00	0.01
292	301131	聚赛龙	600	27,000.00	0.01

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	688256	寒武纪	20,464,343.98	5.36
2	688041	海光信息	20,462,079.59	5.36
3	688981	中芯国际	12,549,273.05	3.29
4	688111	金山办公	10,174,492.26	2.67
5	688012	中微公司	8,264,601.67	2.17
6	688506	百利天恒	7,985,508.38	2.09
7	688271	联影医疗	7,670,207.40	2.01
8	688036	传音控股	6,721,921.41	1.76
9	688008	澜起科技	6,588,389.45	1.73
10	688396	华润微	4,772,781.63	1.25
11	688223	晶科能源	3,957,942.09	1.04
12	688126	沪硅产业	3,794,234.15	0.99
13	688608	恒玄科技	3,430,745.57	0.90
14	688082	盛美上海	3,384,519.35	0.89
15	688249	晶合集成	3,372,591.09	0.88
16	688072	拓荆科技	3,298,478.68	0.86
17	688538	和辉光电	3,291,248.79	0.86
18	688047	龙芯中科	3,248,784.00	0.85
19	688187	时代电气	3,231,721.90	0.85
20	689009	九号公司	3,227,269.84	0.85

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	688256	寒武纪	6,219,360.12	1.63
2	688041	海光信息	3,945,138.51	1.03
3	688981	中芯国际	3,926,364.41	1.03
4	688506	百利天恒	3,538,122.89	0.93
5	688111	金山办公	3,313,819.38	0.87
6	688036	传音控股	3,074,557.02	0.81
7	688271	联影医疗	2,639,316.88	0.69
8	688012	中微公司	2,607,139.79	0.68
9	688396	华润微	2,200,734.95	0.58
10	688008	澜起科技	2,168,569.38	0.57
11	688187	时代电气	2,086,426.16	0.55
12	688538	和辉光电	1,767,477.36	0.46
13	688223	晶科能源	1,691,845.33	0.44
14	689009	九号公司	1,468,405.63	0.38

15	603005	晶方科技	1,345,553.00	0.35
16	688321	微芯生物	1,339,930.56	0.35
17	688126	沪硅产业	1,302,443.75	0.34
18	688599	天合光能	1,242,995.34	0.33
19	688336	三生国健	1,242,423.71	0.33
20	688082	盛美上海	1,227,799.79	0.32

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	558,648,855.70
卖出股票收入（成交）总额	225,185,458.32

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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，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。

7.12.2 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,410,013.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,410,013.77

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

份额级别	持有人户	户均持有的	持有人结构
------	------	-------	-------

	数(户)	基金份额	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 板综合增强 A	15,154	8,184.73	396,122.93	0.32%	123,635,227.73	99.68%
易方达上证科创 板综合增强 C	16,945	14,248.81	3,490,885.00	1.45%	237,955,247.73	98.55%
合计	32,099	11,385.95	3,887,007.93	1.06%	361,590,475.46	98.94%

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 增强 A	12,095.00	0.0098%
	易方达上证科创板综合 增强 C	238,315.10	0.0987%
	合计	250,410.10	0.0685%

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 增强 A	0
	易方达上证科创板综合 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	易方达上证科创板综合 增强 A	0~10
	易方达上证科创板综合 增强 C	0
	合计	0~10

§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增强 A	易方达上证科创板综合增强 C
基金合同生效日（2025 年 4 月 29 日）基金份额总额	154,987,518.31	427,255,902.74
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,962,486.09	27,761,901.05
减：基金合同生效日起至报告期期	41,918,653.74	213,571,671.06

末基金总赎回份额		
基金合同生效日起至报告期期末 基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	124,031,350.66	241,446,132.73

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 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	
平安证券	3	783,823,002.30	100.00%	76,402.76	100.00%	-

注：a) 本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》中关于交易佣金分仓的规定。

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

c) 上交所 A 股普通交易佣金率为 0.015%（包含经手费、证管费），深交所 A 股普通交易佣金率为 0.016%（包含经手费、证管费和过户费），北交所股票交易佣金率为 0.022%（包含经手费），基金交易佣金率为 0.015%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，债券、回购交易佣金率为 0，可转债佣金率为 0.004%。

d) 本基金管理人负责选择证券经营机构，本报告期内选择标准有调整，调整后的标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，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。

e) 本报告期内基金的证券经营机构的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订经纪服务协议。

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
平安证券	-	-	-	-	-	-

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	易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-30
2	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-17
3	易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-27
4	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-06
5	关于易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-16
6	关于旗下部分基金 2025 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-26

§ 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指数增强型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照。

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