

易方达上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48

7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末上市基金前十名持有人	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.4 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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	53
§ 11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录	54
11.2 存放地点	54
11.3 查阅方式	54

§ 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 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达上证科创板 100 增强策略 ETF
场内简称	科创 100Z、科创 100 增强 ETF 易方达
基金主代码	588500
交易代码	588500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 6 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	94,647,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2024 年 7 月 19 日

2.2 基金产品说明

投资目标	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	本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，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 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 股票（含存托凭证）投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型预测股票超额回报，在力争有效控制风险及交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优先选择综合评估较高的股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。 此外，为更好地实现投资目标，本基金将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。同时，本基金可投资股指期货、国债期货和股票期权。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 100 指数收益率
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、债券型基金与货币市场基金。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，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的

	风险水平。
--	-------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼；广 东省珠海市横琴新区荣粤道188 号6层	北京市西城区闹市口大街1号院 1号楼
邮政编码		510620；519031	100033
法定代表人		吴欣荣	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	13,667,628.67
本期利润	29,234,920.50
加权平均基金份额本期利润	0.2433
本期加权平均净值利润率	18.02%
本期基金份额净值增长率	12.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	10,209,936.92
期末可供分配基金份额利润	0.1079
期末基金资产净值	135,196,017.59
期末基金份额净值	1.4284
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	42.84%

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

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

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

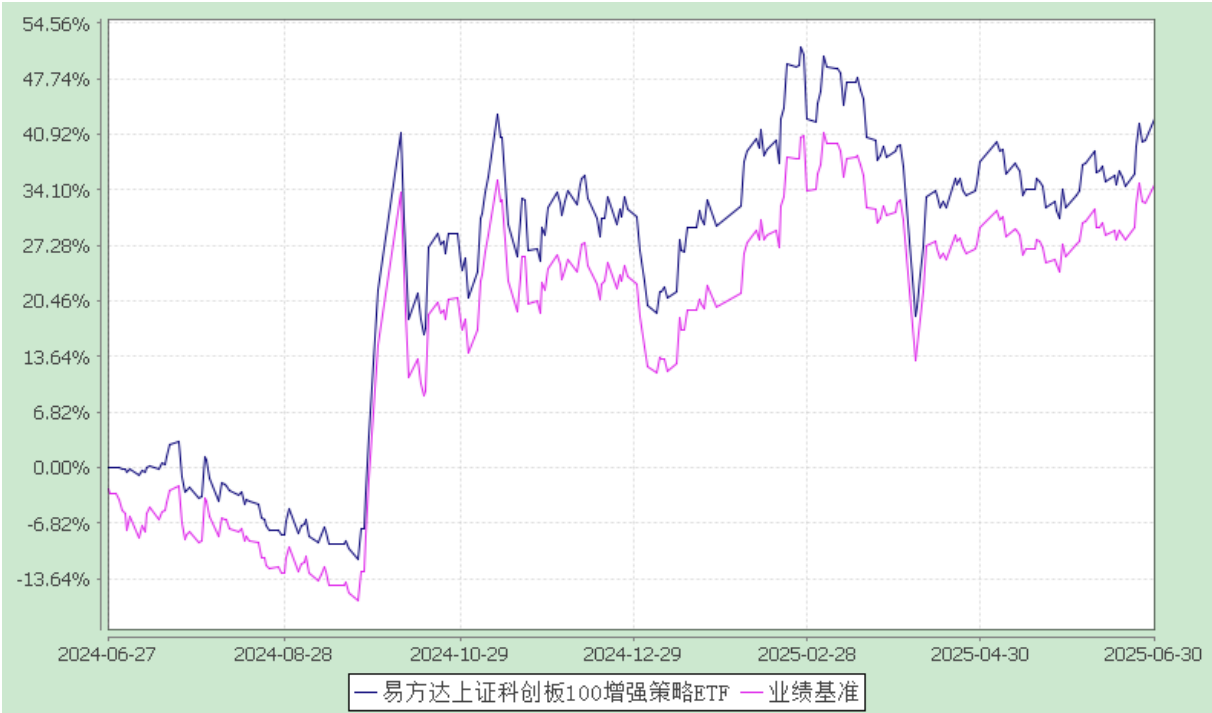
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	8.35%	1.31%	7.02%	1.19%	1.33%	0.12%
过去三个月	2.92%	2.29%	2.58%	2.19%	0.34%	0.10%
过去六个月	12.84%	2.11%	13.55%	2.01%	-0.71%	0.10%
过去一年	42.91%	2.68%	38.97%	2.68%	3.94%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	42.84%	2.66%	34.65%	2.67%	8.19%	-0.01%

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 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
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
(2024 年 6 月 27 日至 2025 年 6 月 30 日)



注：1.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

2.自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 42.84%，同期业绩比较基准收益率为 34.65%。

§ 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	本基金的基金经理，易方达易百智	2024-	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾

明	能量化策略混合、易方达中证 1000 量化增强、易方达上证科创板综合增强的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员	06-27			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。
王建军	本基金的基金经理，易方达沪深 300 量化增强、易方达量化策略精选混合、易方达 MSCI 中国 A50 互联互通量化增强、易方达高股息量化选股股票发起式的基金经理，量化投资部负责人、量化投资决策委员会委员、投资经理	2025-04-24	-	18 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任汇添富基金管理有限公司数量分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、指数与量化投资部总经理助理、指数与量化投资部副总经理、指数及增强投资部副总经理、量化投资部副总经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF 联接、易方达创业板 ETF、易方达中小板指数分级、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达重组分级的基金经理。
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（QDII）、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）、易方达上证科创板综合 ETF 联接的基金经理助理	2024-07-27	-	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。
徐德晖	本基金的基金经理助理，易方达中证 500 增强策略 ETF 的基金经理助理，量化研究员	2024-07-27	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司指数与量化研究员。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
王建军	公募基金	5	1,664,787,714.37	2021-09-04
	私募资产管理计划	1	15,696,760,496.79	2019-07-25
	其他组合	0	0.00	-
	合计	6	17,361,548,211.16	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

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。

在以上宏观背景和产业背景下，科创 100 指数作为先进生产力和科技创新前沿力量的代表，虽经历了大幅波动，但依然录得不错的收益。我们对本报告期内模型的表现进行归因，发现统计套利模型在市场波动加大的环境下，表现出较强的适应性，通过捕捉跨市场价差机会获取了丰厚的超额收益；而在此期间，基本面模型表现相对逊色，尤其分析师相关因子在关税冲突影响下波动明显放大，成为这个季度超额收益波动的主要贡献者。当然，正如我们此前报告所述，本基金严控跟踪误差，较好地平滑了关税带来的波动，超额收益整体并未受到显著影响。后续我们还会继续坚持这一策略，做好风险控制，持续迭代量化模型，提高超额收益稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.4284 元，本报告期份额净值增长率为 12.84%，同期业绩比较基准收益率为 13.55%。年化跟踪误差 4.03%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，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

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金

的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	869,531.66	2,408,535.40
结算备付金		163,775.72	600,320.46
存出保证金		13,696.56	118,015.88
交易性金融资产	6.4.7.2	134,276,826.55	249,719,649.64
其中：股票投资		134,276,826.55	249,719,649.64
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		384,829.74	235,613.84
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	75,616.24	68,418.21
资产总计		135,784,276.47	253,150,553.43
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 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		332,312.70	136,781.87
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		55,933.41	134,290.62
应付托管费		11,186.66	26,858.12
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	188,826.11	126,391.35
负债合计		588,258.88	424,321.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	94,647,000.00	199,647,000.00
未分配利润	6.4.7.8	40,549,017.59	53,079,231.47
净资产合计		135,196,017.59	252,726,231.47
负债和净资产总计		135,784,276.47	253,150,553.43

注：1.本基金合同生效日为 2024 年 6 月 27 日，2024 年度实际报告期间为 2024 年 6 月 27 日至 2024 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4284 元，基金份额总额 94,647,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 6 月 27 日（基 金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		29,891,970.30	-94,767.73
1.利息收入		2,792.19	5,967.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,792.19	5,967.19
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）		14,242,400.08	-1,882.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	13,823,231.59	-1,882.86

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	419,168.49	-
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	15,567,291.83	-124,672.43
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	79,486.20	25,820.37
减：二、营业总支出		657,049.80	13,475.39
1. 管理人报酬		407,345.30	8,384.63
2. 托管费		81,469.01	1,676.92
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	168,235.49	3,413.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,234,920.50	-108,243.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,234,920.50	-108,243.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		29,234,920.50	-108,243.12

注：本基金合同生效日为 2024 年 6 月 27 日，上年度可比期间为 2024 年 6 月 27 日至 2024 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 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	199,647,000.00	53,079,231.47	252,726,231.47
二、本期期初净资	199,647,000.00	53,079,231.47	252,726,231.47

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-105,000,000.00	-12,530,213.88	-117,530,213.88
（一）、综合收益总额	-	29,234,920.50	29,234,920.50
（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）	-105,000,000.00	-41,765,134.38	-146,765,134.38
其中：1.基金申购款	46,000,000.00	14,261,335.24	60,261,335.24
2.基金赎回款	-151,000,000.00	-56,026,469.62	-207,026,469.62
（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	94,647,000.00	40,549,017.59	135,196,017.59
项目	上年度可比期间 2024 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	204,647,000.00	-	204,647,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-108,243.12	-108,243.12
（一）、综合收益总额	-	-108,243.12	-108,243.12
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（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	204,647,000.00	-108,243.12	204,538,756.88

注：本基金合同生效日为 2024 年 6 月 27 日，上年度可比期间为 2024 年 6 月 27 日至 2024 年 6 月 30 日。

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 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(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[2024]700 号《关于准予易方达上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数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 100 增强策略交易型开放式指数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 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 6 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 204,647,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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。

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	869,531.66
等于：本金	869,457.59
加：应计利息	74.07

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	869,531.66

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		123,101,961.33	-	134,276,826.55	11,174,865.22
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		123,101,961.33	-	134,276,826.55	11,174,865.22

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,488.75
其中：交易所市场	12,488.75
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	92,731.73
应付替代款	83,605.63
合计	188,826.11

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	199,647,000.00	199,647,000.00
本期申购	46,000,000.00	46,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-151,000,000.00	-151,000,000.00
本期末	94,647,000.00	94,647,000.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,523,723.18	55,602,954.65	53,079,231.47
本期期初	-2,523,723.18	55,602,954.65	53,079,231.47

本期利润	13,667,628.67	15,567,291.83	29,234,920.50
本期基金份额交易产生的变动数	-933,968.57	-40,831,165.81	-41,765,134.38
其中：基金申购款	1,969,168.58	12,292,166.66	14,261,335.24
基金赎回款	-2,903,137.15	-53,123,332.47	-56,026,469.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,209,936.92	30,339,080.67	40,549,017.59

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,162.27
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	502.39
其他	127.53
合计	2,792.19

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	276,172.16
股票投资收益——赎回差价收入	13,547,059.43
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	13,823,231.59

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	143,035,168.79
减：卖出股票成本总额	142,641,684.93
减：交易费用	117,311.70
买卖股票差价收入	276,172.16

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

赎回基金份额对价总额	207,026,469.62
减：现金支付赎回款总额	14,870,927.62
减：赎回股票成本总额	178,608,482.57
减：交易费用	-
赎回差价收入	13,547,059.43

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1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	419,168.49
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	419,168.49

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1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	15,567,291.83
——股票投资	15,567,291.83
——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	15,567,291.83

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	79,486.20
合计	79,486.20

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

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1月1日至2025年6月30日
审计费用	23,307.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,120.00
其他	84,300.75
合计	168,235.49

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年6月27日（基金合同生效日） 至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	-	-	11,496,993.78	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	1,149.67	100.00%	1,149.67	100.00%

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。

2.2024 年 7 月 1 日前，本基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为基金提供的证券交易服务及研究服务。自 2024 年 7 月 1 日起，本基金佣金协议约定的服务仅包括证券交易服务，不包括研究服务。

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1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	407,345.30	8,384.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	53,917.04	-
应支付基金管理人的净管理费	353,428.26	8,384.63

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

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，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年6月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	81,469.01	1,676.92

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。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，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	662,401.00	0.6999%	2,304,401.00	1.1542%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

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	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年6月30日	2024年6月27日（基金合同生效

			日) 至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	869,531.66	2,162.27	204,565,780.20	5,967.19

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（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
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	74	1,961.00	2,418.32	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	21	1,963.50	1,903.86	-
60321	泰鸿	2025-0	6 个月	新股	8.60	15.61	235	2,021.	3,668.	-

0	万立	4-01		流通受限				00	35	
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	64	1,313.28	2,398.08	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	82	1,689.20	2,876.56	-
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	-
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	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	81	1,958.58	2,698.92	-
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	521	10,096.98	43,498.29	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	825	9,636.00	22,233.75	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股流通受限	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	189	4,303.53	7,433.37	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	124	5,861.48	15,395.84	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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、债券型基金与货币市场基金。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，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。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%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

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	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 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	869,531.66	-	-	-	869,531.66
结算备付金	163,775.72	-	-	-	163,775.72
存出保证金	13,696.56	-	-	-	13,696.56
交易性金融资产	-	-	-	134,276,826.55	134,276,826.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	384,829.74	384,829.74

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	1,047,003.94	-	-	134,737,272.53	135,784,276.47
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	-	-	-	332,312.70	332,312.70
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	55,933.41	55,933.41
应付托管费	-	-	-	11,186.66	11,186.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	188,826.11	188,826.11
负债总计	-	-	-	588,258.88	588,258.88
利率敏感度缺口	1,047,003.94	-	-	134,149,013.65	135,196,017.59
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,408,535.40	-	-	-	2,408,535.40
结算备付金	600,320.46	-	-	-	600,320.46
存出保证金	118,015.88	-	-	-	118,015.88
交易性金融资产	-	-	-	249,719,649.64	249,719,649.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	235,613.84	235,613.84

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	68,418.21	68,418.21
资产总计	3,126,871.74	-	-	250,023,681.69	253,150,553.43
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	-	-	-	136,781.87	136,781.87
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	134,290.62	134,290.62
应付托管费	-	-	-	26,858.12	26,858.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	126,391.35	126,391.35
负债总计	-	-	-	424,321.96	424,321.96
利率敏感度缺口	3,126,871.74	-	-	249,599,359.73	252,726,231.47

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，

也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	134,276,826.55	99.32	249,719,649.64	98.81
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	134,276,826.55	99.32	249,719,649.64	98.81

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	6,834,833.36	12,752,501.73
	2.业绩比较基准下降 5%	-6,834,833.36	-12,752,501.73

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	134,117,626.11
第二层次	-
第三层次	159,200.44
合计	134,276,826.55

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	134,276,826.55	98.89
	其中：股票	134,276,826.55	98.89
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	1,033,307.38	0.76
8	其他各项资产	474,142.54	0.35
9	合计	135,784,276.47	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	83,886,742.41	62.05
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	23,996,991.52	17.75
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	107,883,733.93	79.80

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	19,734,693.34	14.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	252,322.00	0.19
F	批发和零售业	299,154.00	0.22
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	5,321,436.20	3.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	183,082.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	181,017.08	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	421,388.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	26,393,092.62	19.52

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	688235	百济神州	17,280	4,037,299.20	2.99
2	688347	华虹公司	63,863	3,506,717.33	2.59
3	688002	睿创微纳	46,038	3,209,769.36	2.37
4	688220	翱捷科技	37,090	2,904,147.00	2.15
5	688052	纳芯微	16,477	2,875,071.73	2.13
6	688018	乐鑫科技	19,616	2,865,897.60	2.12
7	688037	芯源微	26,573	2,848,625.60	2.11
8	688361	中科飞测	32,285	2,718,074.15	2.01
9	688498	源杰科技	12,818	2,499,510.00	1.85
10	688019	安集科技	16,337	2,479,956.60	1.83
11	688343	云天励飞	48,770	2,410,213.40	1.78
12	688116	天奈科技	52,631	2,408,920.87	1.78
13	688017	绿的谐波	19,173	2,394,515.97	1.77
14	688582	芯动联科	34,306	2,305,363.20	1.71
15	688327	云从科技	161,803	2,231,263.37	1.65
16	688200	华峰测控	15,441	2,226,592.20	1.65
17	688322	奥比中光	37,471	2,211,163.71	1.64
18	688385	复旦微电	42,334	2,085,796.18	1.54
19	688536	思瑞浦	14,791	2,051,807.52	1.52
20	688088	虹软科技	41,302	1,992,821.50	1.47
21	688192	迪哲医药	32,662	1,953,187.60	1.44
22	688208	道通科技	62,168	1,902,340.80	1.41
23	688629	华丰科技	32,990	1,887,028.00	1.40
24	688520	神州细胞	31,520	1,886,472.00	1.40
25	688183	生益电子	36,770	1,882,624.00	1.39
26	688568	中科星图	51,935	1,870,179.35	1.38
27	688778	厦钨新能	32,983	1,844,409.36	1.36
28	688027	国盾量子	6,449	1,773,539.49	1.31
29	688141	杰华特	52,977	1,725,990.66	1.28
30	688318	财富趋势	14,752	1,695,299.84	1.25
31	688005	容百科技	75,052	1,675,160.64	1.24
32	688331	荣昌生物	27,265	1,649,532.50	1.22
33	688333	铂力特	27,400	1,631,944.00	1.21
34	688063	派能科技	35,578	1,603,856.24	1.19
35	688166	博瑞医药	29,264	1,571,769.44	1.16
36	688110	东芯股份	50,482	1,547,778.12	1.14
37	688400	凌云光	46,774	1,289,559.18	0.95
38	688676	金盘科技	36,676	1,226,812.20	0.91
39	688484	南芯科技	29,933	1,183,850.15	0.88
40	688336	三生国健	20,792	1,127,758.08	0.83
41	688232	新点软件	36,552	1,098,022.08	0.81
42	688177	百奥泰	40,704	1,020,042.24	0.75
43	688443	智翔金泰	36,741	1,019,195.34	0.75

44	688408	中信博	20,280	946,670.40	0.70
45	688097	博众精工	33,854	944,865.14	0.70
46	688798	艾为电子	13,543	923,632.60	0.68
47	688409	富创精密	16,020	881,260.20	0.65
48	688050	爱博医疗	12,233	842,242.05	0.62
49	688281	华秦科技	13,887	840,302.37	0.62
50	688279	峰岬科技	4,421	820,095.50	0.61
51	688789	宏华数科	10,545	770,206.80	0.57
52	688029	南微医学	11,258	760,477.90	0.56
53	688390	固德威	17,161	745,645.45	0.55
54	688439	振华风光	12,386	721,484.50	0.53
55	688612	威迈斯	26,774	715,936.76	0.53
56	688289	圣湘生物	34,784	712,376.32	0.53
57	688717	艾罗能源	13,149	707,810.67	0.52
58	688083	中望软件	8,914	574,150.74	0.42
59	688433	华曙高科	14,942	549,118.50	0.41
60	688522	纳睿雷达	10,569	541,344.18	0.40
61	688631	莱斯信息	6,050	539,660.00	0.40
62	688352	颀中科技	45,276	508,449.48	0.38
63	688139	海尔生物	15,829	488,957.81	0.36
64	688147	微导纳米	15,635	471,864.30	0.35
65	688172	燕东微	23,803	467,966.98	0.35
66	688032	禾迈股份	4,130	412,421.80	0.31
67	688709	成都华微	11,944	391,046.56	0.29
68	688198	佰仁医疗	3,753	385,395.57	0.29
69	688326	经纬恒润	3,840	342,681.60	0.25
70	688016	心脉医疗	3,805	336,438.10	0.25
71	688779	五矿新能	50,481	274,616.64	0.20
72	688100	威胜信息	7,149	264,870.45	0.20
73	688301	奕瑞科技	2,989	261,866.29	0.19
74	688006	杭可科技	10,024	195,468.00	0.14
75	688107	安路科技	6,907	195,053.68	0.14
76	688432	有研硅	17,521	193,431.84	0.14
77	688161	威高骨科	6,129	164,195.91	0.12
78	688567	孚能科技	11,236	162,922.00	0.12
79	688295	中复神鹰	6,100	126,880.00	0.09
80	688153	唯捷创芯	3,793	117,620.93	0.09
81	688516	奥特维	3,435	114,179.40	0.08
82	688772	珠海冠宇	4,482	64,047.78	0.05
83	688702	盛科通信	1,026	62,668.08	0.05
84	688639	华恒生物	226	7,164.20	0.01
85	688387	信科移动	1,122	6,339.30	0.00
86	688001	华兴源创	1	25.27	0.00

87	688425	铁建重工	1	4.08	0.00
----	--------	------	---	------	------

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	688608	恒玄科技	6,180	2,150,516.40	1.59
2	002837	英维克	14,120	419,505.20	0.31
3	603881	数据港	14,960	382,228.00	0.28
4	301155	海力风电	5,300	381,070.00	0.28
5	300548	博创科技	5,600	373,912.00	0.28
6	300738	奥飞数据	17,500	366,275.00	0.27
7	002558	巨人网络	14,800	348,540.00	0.26
8	300850	新强联	8,900	318,798.00	0.24
9	688362	甬矽电子	10,518	313,226.04	0.23
10	688111	金山办公	1,115	312,255.75	0.23
11	000534	万泽股份	20,400	304,368.00	0.23
12	603893	瑞芯微	2,000	303,720.00	0.22
13	603228	景旺电子	7,100	297,064.00	0.22
14	600602	云赛智联	14,600	294,482.00	0.22
15	300315	掌趣科技	47,600	288,932.00	0.21
16	301291	明阳电气	6,900	283,935.00	0.21
17	688627	精智达	3,201	281,720.01	0.21
18	603063	禾望电气	8,300	281,038.00	0.21
19	603319	美湖股份	7,900	279,818.00	0.21
20	300857	协创数据	3,220	277,113.20	0.20
21	603083	剑桥科技	5,800	274,340.00	0.20
22	600967	内蒙一机	14,000	270,900.00	0.20
23	001339	智微智能	5,600	270,648.00	0.20
24	603121	华培动力	11,500	267,605.00	0.20
25	300634	彩讯股份	9,800	265,580.00	0.20
26	300454	深信服	2,800	263,704.00	0.20
27	301308	江波龙	3,000	262,470.00	0.19
28	688095	福昕软件	3,852	261,589.32	0.19
29	603236	移远通信	3,000	257,400.00	0.19
30	300476	胜宏科技	1,900	255,322.00	0.19
31	688099	晶晨股份	3,591	254,996.91	0.19
32	688205	德科立	4,029	252,578.01	0.19
33	301510	固高科技	8,400	252,420.00	0.19
34	001267	汇绿生态	26,900	252,322.00	0.19
35	688521	芯原股份	2,606	251,479.00	0.19
36	002916	深南电路	2,300	247,963.00	0.18

37	002130	沃尔核材	10,400	247,728.00	0.18
38	688255	凯尔达	7,250	244,252.50	0.18
39	688160	步科股份	2,839	243,302.30	0.18
40	300693	盛弘股份	8,100	242,676.00	0.18
41	002283	天润工业	40,300	240,188.00	0.18
42	601595	上海电影	8,100	240,084.00	0.18
43	003021	兆威机电	2,200	237,930.00	0.18
44	002315	焦点科技	5,200	237,588.00	0.18
45	688686	奥普特	2,464	235,607.68	0.17
46	002292	奥飞娱乐	24,200	235,224.00	0.17
47	301205	联特科技	2,400	230,064.00	0.17
48	300494	盛天网络	16,600	226,424.00	0.17
49	002757	南兴股份	11,700	221,832.00	0.16
50	603278	大业股份	24,200	220,220.00	0.16
51	688031	星环科技	4,677	218,088.51	0.16
52	688120	华海清科	1,286	216,948.20	0.16
53	600577	精达股份	29,100	216,504.00	0.16
54	301397	溯联股份	6,100	214,598.00	0.16
55	002801	微光股份	6,600	213,642.00	0.16
56	600986	浙文互联	25,600	209,152.00	0.15
57	688286	敏芯股份	2,955	208,888.95	0.15
58	688072	拓荆科技	1,339	205,817.69	0.15
59	603270	金帝股份	7,800	200,382.00	0.15
60	688687	凯因科技	7,504	199,531.36	0.15
61	300580	贝斯特	8,100	199,017.00	0.15
62	300443	金雷股份	8,700	196,620.00	0.15
63	688668	鼎通科技	3,023	188,816.58	0.14
64	000887	中鼎股份	10,400	182,936.00	0.14
65	300654	世纪天鸿	17,300	181,304.00	0.13
66	002605	姚记科技	6,400	178,560.00	0.13
67	688698	伟创电气	3,779	178,368.80	0.13
68	603728	鸣志电器	3,000	172,410.00	0.13
69	688658	悦康药业	8,880	169,075.20	0.13
70	300624	万兴科技	2,700	167,535.00	0.12
71	300442	润泽科技	3,300	163,449.00	0.12
72	688158	优刻得	7,186	162,547.32	0.12
73	300258	精锻科技	11,700	161,694.00	0.12
74	603920	世运电路	5,200	158,652.00	0.12
75	002436	兴森科技	11,900	157,556.00	0.12
76	300181	佐力药业	9,000	155,970.00	0.12
77	688306	均普智能	15,571	153,218.64	0.11
78	600710	苏美达	15,800	151,838.00	0.11
79	300563	神宇股份	3,700	150,072.00	0.11

80	002675	东诚药业	10,300	148,217.00	0.11
81	301210	金杨股份	3,565	148,090.10	0.11
82	002765	蓝黛科技	10,600	141,934.00	0.10
83	301171	易点天下	5,200	138,996.00	0.10
84	300475	香农芯创	3,900	138,957.00	0.10
85	603786	科博达	2,500	138,525.00	0.10
86	300657	弘信电子	4,900	136,661.00	0.10
87	002518	科士达	5,900	133,281.00	0.10
88	688428	诺诚健华	5,393	131,750.99	0.10
89	600458	时代新材	9,400	128,968.00	0.10
90	300558	贝达药业	2,200	127,490.00	0.09
91	688578	艾力斯	1,333	124,022.32	0.09
92	002126	银轮股份	5,000	121,400.00	0.09
93	603596	伯特利	2,300	121,187.00	0.09
94	002364	中恒电气	7,900	121,186.00	0.09
95	002922	伊戈尔	7,600	119,548.00	0.09
96	000818	航锦科技	5,300	119,250.00	0.09
97	002402	和而泰	5,000	115,850.00	0.09
98	002422	科伦药业	3,200	114,944.00	0.09
99	300638	广和通	3,900	111,657.00	0.08
100	600699	均胜电子	6,000	104,640.00	0.08
101	002600	领益智造	12,000	103,080.00	0.08
102	603127	昭衍新药	4,900	103,047.00	0.08
103	003019	宸展光电	2,900	101,587.00	0.08
104	301459	丰茂股份	2,330	98,792.00	0.07
105	002995	天地在线	5,000	96,750.00	0.07
106	600557	康缘药业	6,400	94,592.00	0.07
107	300952	恒辉安防	3,300	93,984.00	0.07
108	605068	明新旭腾	5,200	93,444.00	0.07
109	605319	无锡振华	2,700	92,232.00	0.07
110	603166	福达股份	5,900	91,273.00	0.07
111	002202	金风科技	8,900	91,225.00	0.07
112	001306	夏厦精密	1,200	91,128.00	0.07
113	603809	豪能股份	5,940	90,882.00	0.07
114	300525	博思软件	6,000	87,360.00	0.06
115	300363	博腾股份	5,100	87,108.00	0.06
116	002400	省广集团	11,300	86,332.00	0.06
117	600535	天士力	5,500	86,075.00	0.06
118	002653	海思科	2,000	84,440.00	0.06
119	603998	方盛制药	8,300	81,506.00	0.06
120	688369	致远互联	3,083	81,360.37	0.06
121	002019	亿帆医药	6,100	79,239.00	0.06
122	603039	泛微网络	1,400	77,980.00	0.06

123	300433	蓝思科技	3,300	73,590.00	0.05
124	688506	百利天恒	237	70,180.44	0.05
125	688039	当虹科技	2,082	68,331.24	0.05
126	300129	泰胜风能	8,800	62,568.00	0.05
127	300607	拓斯达	1,500	51,135.00	0.04
128	688411	海博思创	521	43,498.29	0.03
129	301333	诺思格	800	38,248.00	0.03
130	300347	泰格医药	700	37,324.00	0.03
131	688545	兴福电子	825	22,233.75	0.02
132	688583	思看科技	227	18,087.36	0.01
133	688775	影石创新	124	15,395.84	0.01
134	688082	盛美上海	116	13,217.04	0.01
135	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.01
136	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.01
137	688755	汉邦科技	189	7,433.37	0.01
138	300474	景嘉微	100	7,300.00	0.01
139	603019	中科曙光	100	7,040.00	0.01
140	688041	海光信息	42	5,934.18	0.00
141	002025	航天电器	100	5,141.00	0.00
142	300395	菲利华	100	5,110.00	0.00
143	600536	中国软件	100	4,677.00	0.00
144	301099	雅创电子	100	4,595.00	0.00
145	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
146	600316	洪都航空	100	3,770.00	0.00
147	000034	神州数码	100	3,764.00	0.00
148	603210	泰鸿万立	235	3,668.35	0.00
149	002189	中光学	100	3,080.00	0.00
150	002265	建设工业	100	3,055.00	0.00
151	301361	众智科技	100	3,053.00	0.00
152	603271	永杰新材	82	2,876.56	0.00
153	603409	汇通控股	81	2,698.92	0.00
154	300031	宝通科技	100	2,503.00	0.00
155	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
156	603014	威高血净	74	2,418.32	0.00
157	603257	中国瑞林	64	2,398.08	0.00
158	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
159	002368	太极股份	100	2,342.00	0.00
160	002180	纳思达	100	2,294.00	0.00
161	300762	上海瀚讯	100	2,263.00	0.00
162	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
163	002273	水晶光电	100	1,997.00	0.00
164	300045	华力创通	100	1,909.00	0.00
165	603202	天有为	21	1,903.86	0.00

166	600184	光电股份	100	1,756.00	0.00
167	002733	雄韬股份	100	1,647.00	0.00
168	600933	爱柯迪	100	1,601.00	0.00
169	000066	中国长城	100	1,480.00	0.00
170	300659	中孚信息	100	1,454.00	0.00
171	300383	光环新网	100	1,430.00	0.00
172	002465	海格通信	100	1,394.00	0.00
173	300002	神州泰岳	100	1,180.00	0.00
174	688012	中微公司	2	364.60	0.00
175	688047	龙芯中科	2	266.78	0.00
176	688368	晶丰明源	2	175.66	0.00
177	688508	芯朋微	2	111.64	0.00
178	688311	盟升电子	2	86.10	0.00
179	688278	特宝生物	1	72.11	0.00
180	688486	龙迅股份	1	66.88	0.00
181	688682	霍莱沃	2	62.60	0.00
182	688375	国博电子	1	60.01	0.00
183	688348	昱能科技	1	42.97	0.00
184	688062	迈威生物	1	28.28	0.00
185	688533	上声电子	1	26.93	0.00
186	688127	蓝特光学	1	25.71	0.00
187	688381	帝奥微	1	21.66	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688220	翱捷科技	4,709,858.50	1.86
2	688027	国盾量子	3,375,009.59	1.34
3	688676	金盘科技	3,373,399.81	1.33
4	688018	乐鑫科技	3,269,866.76	1.29
5	688208	道通科技	2,574,696.47	1.02
6	688116	天奈科技	2,519,663.94	1.00
7	688385	复旦微电	2,333,990.78	0.92
8	688327	云从科技	2,240,970.72	0.89
9	688235	百济神州	2,149,458.51	0.85
10	688778	厦钨新能	2,112,626.33	0.84
11	688347	华虹公司	1,918,099.82	0.76
12	688200	华峰测控	1,903,027.60	0.75
13	688279	峰昭科技	1,870,066.80	0.74
14	688608	恒玄科技	1,844,380.92	0.73
15	688019	安集科技	1,730,235.97	0.68

16	688536	思瑞浦	1,695,506.56	0.67
17	688063	派能科技	1,604,579.54	0.63
18	603005	晶方科技	1,591,333.00	0.63
19	688318	财富趋势	1,396,651.23	0.55
20	688425	铁建重工	1,331,461.84	0.53

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688608	恒玄科技	4,269,771.18	1.69
2	688578	艾力斯	3,496,858.98	1.38
3	688278	特宝生物	2,435,449.36	0.96
4	688052	纳芯微	2,083,770.15	0.82
5	688408	中信博	1,994,416.23	0.79
6	688686	奥普特	1,787,113.45	0.71
7	688498	源杰科技	1,743,154.76	0.69
8	688083	中望软件	1,698,542.13	0.67
9	688027	国盾量子	1,573,608.73	0.62
10	688425	铁建重工	1,500,894.81	0.59
11	688050	爱博医疗	1,469,077.22	0.58
12	688037	芯源微	1,434,458.83	0.57
13	688702	盛科通信	1,433,136.99	0.57
14	603005	晶方科技	1,420,785.00	0.56
15	688062	迈威生物	1,414,434.22	0.56
16	688017	绿的谐波	1,359,081.90	0.54
17	688348	昱能科技	1,331,880.59	0.53
18	688772	珠海冠宇	1,306,416.73	0.52
19	688032	禾迈股份	1,289,795.42	0.51
20	688141	杰华特	1,273,572.73	0.50

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	136,471,708.58
卖出股票收入（成交）总额	143,035,168.79

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中, 安集微电子科技(上海)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海市浦东新区卫生健康委员会的处罚。

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	13,696.56
2	应收清算款	384,829.74
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	474,142.54

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
3,392	27,903.01	11,495,101.00	12.15%	83,151,899.00	87.85%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	玄元私募基金投资管理（广东）有限公司—玄元科新 290 号私募证券投资基金	10,000,000.00	10.57%
2	王玲	3,000,000.00	3.17%
3	范晶莹	2,656,700.00	2.81%

4	邓怡	1,448,900.00	1.53%
5	任夏仪	1,055,900.00	1.12%
6	裘载问	1,014,800.00	1.07%
7	孙明	1,000,000.00	1.06%
8	苏海峰	922,500.00	0.97%
9	魏凯	921,000.00	0.97%
10	陈晓虹	883,700.00	0.93%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2024 年 6 月 27 日）基金份额总额	204,647,000.00
本报告期期初基金份额总额	199,647,000.00
本报告期基金总申购份额	46,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	151,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	94,647,000.00

§ 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。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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	
长江证券	3	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	153,696,710.98	55.10%	15,371.56	55.09%	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
兴业证券	2	1,706,826.63	0.61%	170.70	0.61%	-
银河证券	2	19,081,679.05	6.84%	1,908.30	6.84%	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中金财富	2	104,480,500.57	37.45%	10,449.89	37.45%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司合并为国泰海通证券股份有限公司。

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	
	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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-01-21
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-17
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-27
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加开源证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-05
5	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	中国证券报、基金管理人	2025-03-22

		网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
8	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
9	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-25
10	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
11	易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证券报	2025-03-31
12	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2025-04-22
13	易方达上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-24
14	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-17

§ 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 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.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