## 易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告

2025年9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

报告送出日期:二〇二五年十月二十八日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

| 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               |  |
| 报告期末基金份额总额 | 561,620,136.03 份         |  |
| 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% 本基金为股票型基金, 理论上其预期风险与预期 风险收益特征 收益水平高干混合型基金、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                     | 也与香港股票市场交易互        |  |
|            | 联互通机制投资的风险语                     | 单见招募说明书。           |  |
| 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                      |                    |  |
| 下属分级基金的基金简 | 易方达上证科创板综合<br>增强 A              | 易方达上证科创板综合<br>增强 C |  |
| 称          | ·肯法 A                           | 増短し                |  |
| 下属分级基金的交易代 | 023998                          | 023999             |  |
| 码          | 023776                          | 023777             |  |
| 报告期末下属分级基金 | 131,593,461.94 份                | 430,026,674.09 份   |  |
| 的份额总额      | 131,393, <del>4</del> 01.94 [J] | 430,020,074.09 M   |  |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

|                | 报告期                    |                |  |
|----------------|------------------------|----------------|--|
| 主要财务指标         | (2025年7月1日-2025年9月30日) |                |  |
| 土安州分泪你         | 易方达上证科创板综              | 易方达上证科创板综      |  |
|                | 合增强 A                  | 合增强 C          |  |
| 1.本期已实现收益      | 13,121,394.40          | 24,715,395.51  |  |
| 2.本期利润         | 50,717,851.49          | 98,244,876.61  |  |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3978                 | 0.3978         |  |
| 4.期末基金资产净值     | 190,090,533.34         | 620,134,560.71 |  |
| 5.期末基金份额净值     | 1.4445                 | 1.4421         |  |

- 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。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1本报告期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                 | 净值增长 率① | 净值增长<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差 | 1)-(3) | 2-4    |
|--------------------|---------|-------------------|--------------------|----------------------|--------|--------|
| 过去三个 月             | 38.32%  | 1.60%             | 37.38%             | 1.61%                | 0.94%  | -0.01% |
| 过去六个 月             | -       | -                 | 1                  | 1                    | 1      | -      |
| 过去一年               | -       | -                 | -                  | -                    | -      | -      |
| 过去三年               | -       | -                 | -                  | -                    | -      | -      |
| 过去五年               | -       | -                 | -                  | -                    | -      | -      |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 44.45%  | 1.35%             | 45.38%             | 1.40%                | -0.93% | -0.05% |

## 易方达上证科创板综合增强 C

| 阶段                 | 净值增长 率① | 净值增长<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | 1)-(3) | 2-4    |
|--------------------|---------|-------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个 月             | 38.20%  | 1.60%             | 37.38%             | 1.61%                     | 0.82%  | -0.01% |
| 过去六个 月             | -       | -                 | -                  | -                         | -      | -      |
| 过去一年               | -       | -                 | -                  | -                         | -      | -      |
| 过去三年               | -       | -                 | -                  | -                         | -      | -      |
| 过去五年               | -       | -                 | -                  | -                         | -      | -      |
| 自基金合<br>同生效起<br>至今 | 44.21%  | 1.35%             | 45.38%             | 1.40%                     | -1.17% | -0.05% |

# 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2025年4月29日至2025年9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。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓  | шь   |                | 金的基里期限   | 证券         | 74 111   |
|----|--|----------------|----------|------------|--|
| 名  | 职务   | 任职<br>日期       | 离任<br>日期 | 从业<br>  年限 | 说明   |
| 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、易方达上证科创板综合增强策略 ETF、易方达创业板增强的基金经理,量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员 | 2025-<br>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,<br>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, "任职日期"和"离 任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

### 4.3 公平交易专项说明

#### 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、决策流程和交易流程,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,通过投资交易系统中的公平交易模块,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 20 次,其中 16 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,4 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 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期,宏观经济在政策持续发力与新动能培育的双重支撑下,延续稳中有进态势,但内生增长动力仍待进一步夯实。各项稳增长举措持续显效,尤其以"反内卷"为核心的一揽子供给政策给市场注入了新的强心剂。但同时,我们也可以看到,消费和地产数据依然在底部徘徊,经济全面回暖尚需等待。另一方面,政策层面聚焦"新质生产力培育"与"产业升级攻坚",通过超长期特别国债等工具定向支持资源开发、高端材料突破、人工智能、商业航天等多个未来产业赛道,引导资金流向核心技术领域,不过传统行业转型与新兴产业规模化的衔接仍需时间沉淀。

市场信心伴随经济韧性与政策落地出现修复,报告期内 A 股融资融券活跃度显著提升,创多年来较高水平,QFII(合格境外机构投资者)持仓规模持续扩大,但投资者对行业景气度的判断差异导致优质资产配置需求分化,资本市场处于结构优化与估值重塑的过渡阶段。

本报告期内,新兴领域的结构性亮点持续凸显。AI 领域从技术突破转向生态构建,AI Agent 在各场景开启自主化应用探索,科技巨头深度参与生态建设推动行业快速迭代;新能源领域聚焦"材料升级与场景拓展",固态电池材料攻坚取得重要进展;国产芯片研发进度持续超预期,国内互联网巨头纷纷表示会进一步加大算力储备。在此背景下,AI、国防军工、储能、新能源制造等产业板块成为

科技制造行情核心驱动力,带动科创板块实现结构性上涨。

本基金在报告期内跑赢基准。经过上个季度的建仓后,本季度组合已经进入 指数增强运作阶段,在此阶段不做过多的指数择时和行业轮动,主要通过选股贡 献超额收益。

我们认为,科技作为本轮市场的投资主线之一,估值的提升贡献了科创综指的主要涨幅。但如果仔细拆解会发现,国产算力、半导体制造、创新药等领域的估值提升来源于对核心公司未来业绩的预期折现;而半导体设备与材料、锂电、储能等板块的估值提升则来源于过去或者当下真实的基本面变化。由此而言,后续值得继续观察国产算力的推进节奏、锂电储能景气度持续性、半导体设备下游扩产状况等。在过去一段时间,虽然权重股大幅上涨使得偏向于分散化投资的量化产品较难跑赢指数,但我们通过严格的风控控制了业绩回撤。后续我们将继续坚持多策略打法,坚持在严控跟踪误差的前提下,不断迭代优化模型,通过量化模型捕捉市场交易机会。

## 4.5 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 1.4445 元,本报告期份额净值增长率为 38.32%,同期业绩比较基准收益率为 37.38%; C 类基金份额净值为 1.4421 元,本报告期份额净值增长率为 38.20%,同期业绩比较基准收益率为 37.38%。年化跟踪误差 2.74%,在合同规定的目标控制范围之内。

#### 4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额(元)          | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|----------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 721,944,683.14 | 85.49        |
|    | 其中: 股票 | 721,944,683.14 | 85.49        |

| 2 | 固定收益投资         | -              | -      |
|---|----------------|----------------|--------|
|   | 其中:债券          | -              | -      |
|   | 资产支持证券         | -              | -      |
| 3 | 贵金属投资          | -              | -      |
| 4 | 金融衍生品投资        | 1              | -      |
| 5 | 买入返售金融资产       | -              | -      |
|   | 其中: 买断式回购的买入返售 |                |        |
|   | 金融资产           | -              | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计   | 92,272,898.83  | 10.93  |
| 7 | 其他资产           | 30,269,225.19  | 3.58   |
| 8 | 合计             | 844,486,807.16 | 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 229,340.58 元,占净值比例 0.03%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

## 5.2.1.1积极投资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             | 413,140.00     | 0.05         |
| В  | 采矿业                  | -              | -            |
| C  | 制造业                  | 100,731,217.01 | 12.43        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应<br>业 | -              | -            |
| Е  | 建筑业                  | 411,840.00     | 0.05         |
| F  | 批发和零售业               | 2,027,484.00   | 0.25         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业          | -              | -            |
| Н  | 住宿和餐饮业               | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业      | 15,318,944.20  | 1.89         |
| J  | 金融业                  | 1,817,677.00   | 0.22         |
| K  | 房地产业                 | -              | -            |

| L | 租赁和商务服务业      | 2,526,425.00   | 0.31  |
|---|---------------|----------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | 373,965.00     | 0.05  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 36,271.00      | 0.00  |
| О | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 223,710.00     | 0.03  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 1,566,042.00   | 0.19  |
| S | 综合            | 393,432.00     | 0.05  |
|   | 合计            | 125,840,147.21 | 15.53 |

## 5.2.1.2指数投资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             | -              | -            |
| В  | 采矿业                  | -              | -            |
| С  | 制造业                  | 457,490,015.09 | 56.46        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应<br>业 | -              | -            |
| Е  | 建筑业                  | -              | -            |
| F  | 批发和零售业               | -              | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业          | -              | -            |
| Н  | 住宿和餐饮业               | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业      | 128,246,031.88 | 15.83        |
| 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           | 9,680,438.36   | 1.19         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业        | 458,710.02     | 0.06         |
| О  | 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 595,875,195.35 73.54

## 5.2.2 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     | ı          | -            |
| 工业     | F          | -            |
| 非必需消费品 | F          | -            |
| 必需消费品  | 1          | 1            |
| 保健     | 229,340.58 | 0.03         |
| 金融     | ŀ          | 1            |
| 信息技术   | 1          | -            |
| 电信服务   | 1          | 1            |
| 公用事业   | 1          | 1            |
| 房地产    | -          | -            |
| 合计     | 229,340.58 | 0.03         |

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## 5. 3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

# 5.3.1 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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值 (元)      | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------------------|
| 1  | 688256 | 寒武纪  | 34,649  | 45,909,925.00 | 5.67                     |
| 2  | 688041 | 海光信息 | 181,363 | 45,812,293.80 | 5.65                     |
| 3  | 688981 | 中芯国际 | 132,008 | 18,498,281.04 | 2.28                     |
| 4  | 688012 | 中微公司 | 38,491  | 11,508,424.09 | 1.42                     |
| 5  | 688008 | 澜起科技 | 70,985  | 10,988,478.00 | 1.36                     |
| 6  | 688111 | 金山办公 | 32,399  | 10,254,283.50 | 1.27                     |
| 7  | 688506 | 百利天恒 | 20,943  | 7,859,907.90  | 0.97                     |
| 8  | 688775 | 影石创新 | 22,147  | 6,435,032.32  | 0.79                     |
| 9  | 688271 | 联影医疗 | 42,355  | 6,425,253.50  | 0.79                     |
| 10 | 688521 | 芯原股份 | 31,599  | 5,782,617.00  | 0.71                     |

# 5.3.2 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前五名股票投资明细

| 序号 股票代码 股票名称 | 数量 (股) | 公允价值 (元) | 占基金 |
|--------------|--------|----------|-----|
|--------------|--------|----------|-----|

|   |        |      |        |              | 资产净  |
|---|--------|------|--------|--------------|------|
|   |        |      |        |              | 值比例  |
|   |        |      |        |              | (%)  |
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 10,000 | 4,020,000.00 | 0.50 |
| 2 | 300475 | 香农芯创 | 15,900 | 1,451,034.00 | 0.18 |
| 3 | 300857 | 协创数据 | 7,600  | 1,383,124.00 | 0.17 |
| 4 | 300308 | 中际旭创 | 3,300  | 1,332,144.00 | 0.16 |
| 5 | 300059 | 东方财富 | 48,800 | 1,323,456.00 | 0.16 |

5.4 报告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。

- 5.5 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债券投资明细本基金本报告期末未持有债券。
- 5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7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。

- 5.8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权证投资明细本基金本报告期末未持有权证。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码            | 名称     | 持仓量 | 合约市值(元)       | 公允价值变             | 风险说明  |
|---------------|--------|-----|---------------|-------------------|---|
|               |        |     |               | 动(元)              |   |
| IM2512        | IM2512 | 15  | 22,225,200.00 | 536,762.31        | 本基金买入股指期<br>货多头合约的目的<br>是进行更有效的流<br>动性管理,降低现金<br>拖累的同时保障基<br>金运作安全,以更好<br>地跟踪标的指数,实<br>现指数增强的投资 |
| 公允价值变动总额合计(元) |        |     |               | 目标。<br>536,762.31 |   |
| 股指期货投资本期收益(元) |        |     |               | 2,480,481.45      |   |

## 股指期货投资本期公允价值变动(元)

536,762.31

## 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。若本基金投资股指期货、国债期货,将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,综合考虑流动性、基差水平等因素。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.11投资组合报告附注

- 5.11.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
- 5.11.2 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。

## 5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额 (元)        |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,667,024.00  |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 27,602,201.19 |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 30,269,225.19 |

#### 5.11.4报告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。

- 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- 5.11.5.1 **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。
- 5.11.5.2 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位:份

| 福口              | 易方达上证科创板       | 易方达上证科创板       |
|-----------------|----------------|----------------|
| 项目              | 综合增强A          | 综合增强C          |
| 报告期期初基金份额总额     | 124,031,350.66 | 241,446,132.73 |
| 报告期期间基金总申购份额    | 135,161,164.53 | 611,162,582.32 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额  | 127,599,053.25 | 422,582,040.96 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份 |                |                |
| 额减少以"-"填列)      | -              | -              |
| 报告期期末基金份额总额     | 131,593,461.94 | 430,026,674.09 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

## §8 备查文件目录

#### 8.1 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。

#### 8.2 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。

#### 8.3 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 二〇二五年十月二十八日