

易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年三月三十一日

§ 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 10 月 10 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 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	49

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	65
8.6	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	65
8.7	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	65
8.8	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	65
8.9	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	65
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	65
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12	投资组合报告附注	66
§ 9	基金份额持有人信息	67
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2	期末上市基金前十名持有人	67
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.4	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	68
§ 10	开放式基金份额变动	68
§ 11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
11.2	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	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4	基金投资策略的改变	69
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8	其他重大事件	71
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	71
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	71
§ 13	备查文件目录	72
13.1	备查文件目录	72
13.2	存放地点	72
13.3	查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达上证 580ETF
场内简称	上证 580、上证 580ETF 易方达
基金主代码	530100
交易代码	530100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 10 月 10 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	440,696,000.00 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	2025 年 10 月 22 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	上证 580 指数收益率

风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路 21号52层；广东省广州市天河 区珠江东路30号42层；广东省 珠海市横琴新区荣粤道188号6 层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510627；510623；519031	100140
法定代表人		吴欣荣	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普 通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	17,242,954.87
本期利润	38,426,385.26
加权平均基金份额本期利润	0.1002
本期加权平均净值利润率	9.94%
本期基金份额净值增长率	4.69%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	20,454,461.90
期末可供分配基金份额利润	0.0464
期末基金资产净值	461,360,715.76
期末基金份额净值	1.0469
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	4.69%

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 10 月 10 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

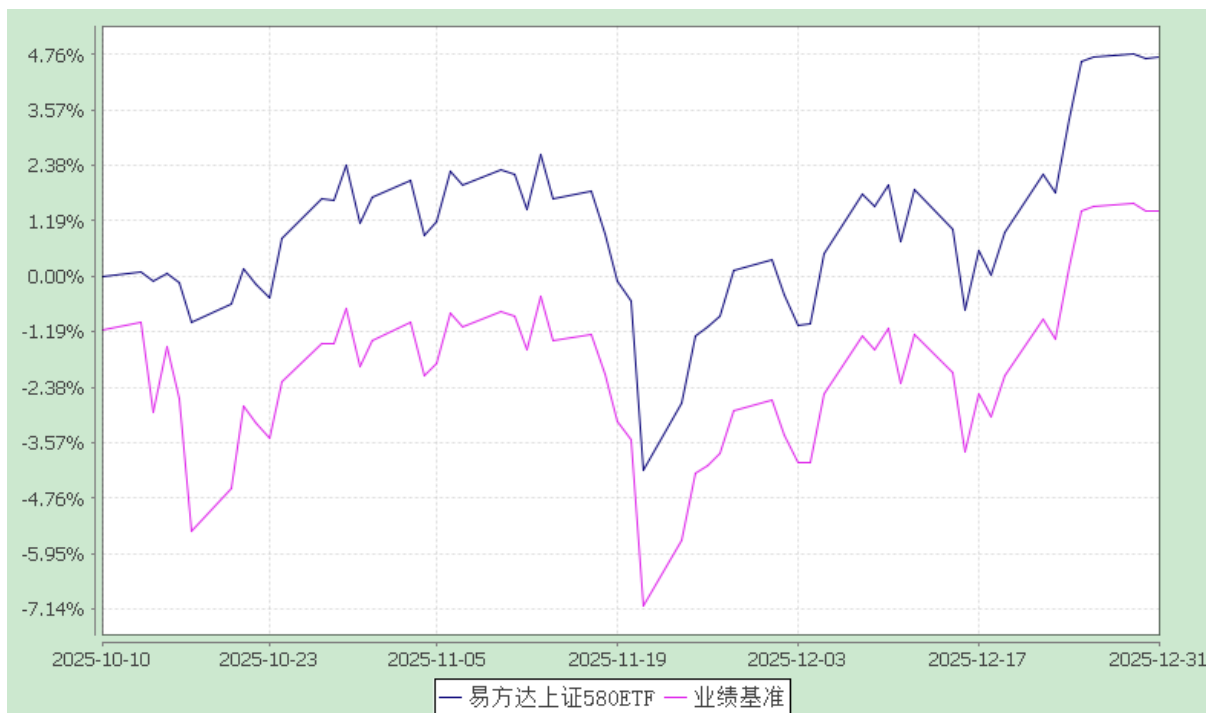
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.69%	0.95%	1.41%	1.12%	3.28%	-0.17%

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 580 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
 (2025 年 10 月 10 日至 2025 年 12 月 31 日)

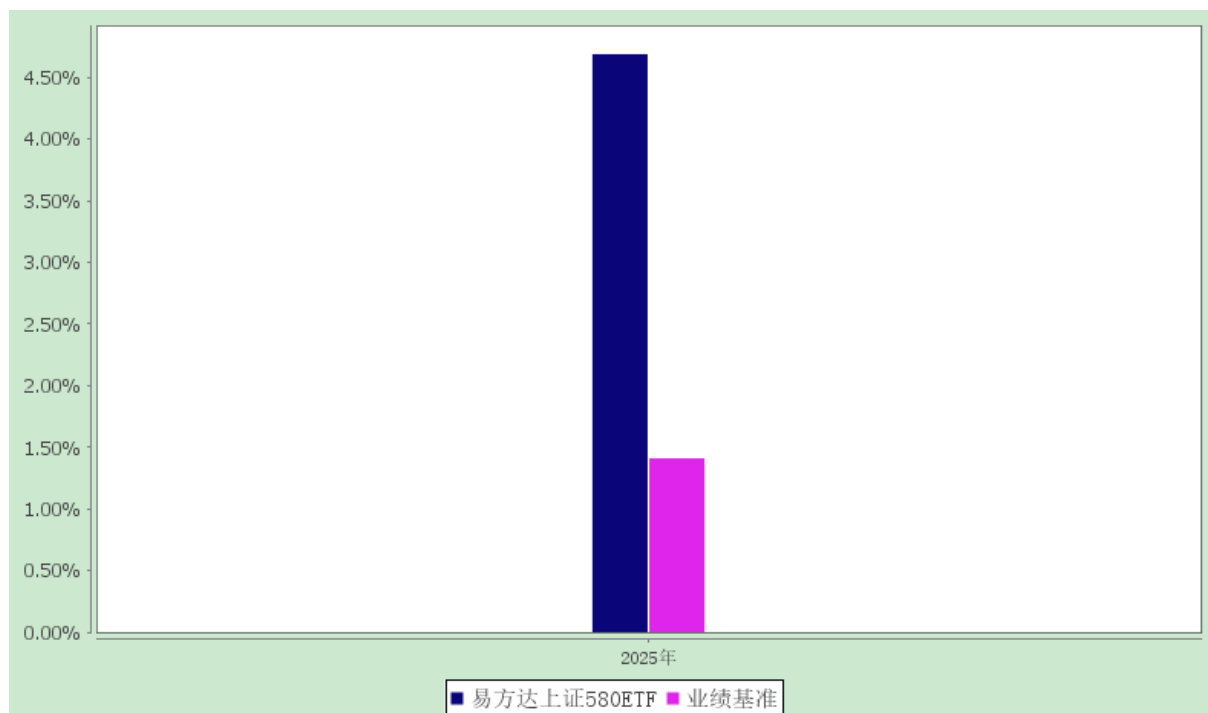


注：1. 本基金合同于 2025 年 10 月 10 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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 580 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为 2025 年 10 月 10 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2025 年 10 月 10 日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 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 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		
李博扬	本基金的基金经理，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、易方达创业板 50ETF、易方达上证科创板新能源 ETF、易方达上证科创板 200ETF 联接、易方达上证 580ETF 联接、易方达创业板 50ETF 联接的基金经理，易方达恒生 ETF(QDII)、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证沪深港黄金产业股票指数发起式、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证消费电子主题 ETF 联接发起式（自 2024 年 12 月 14 日至 2025 年 04 月 28 日）、易方达中证生物科技主题 ETF（自 2024 年 12 月 14 日至 2025 年 04 月 28 日）、易方达上证科创板综合 ETF 联接、易方达中证数字经济主题 ETF、易方达上证科创板综合增强策略 ETF、易方达中证 A500 增强策略 ETF 的基金经理助理	2025-10-10	-	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。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内，本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% 的交易共有 94 次，其中 80 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，14 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪上证 580 指数，该指数从沪市证券中选取市值规模较小、流动性较好的 580 只证券作为样本，反映上海证券市场市值较小上市公司证券的整体表现。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2025 年是“十四五”规划收官之年，也是中国经济顶压前行、向新向优的关键一年。全年宏观调控精准发力，适度宽松的货币政策与积极有为的财政政策协同发力，有效对冲内外不确定性，国民经济实现平稳运行，高质量发展取得积极成效。根据国家统计局初步核算数据，2025 年我国国内生产总值首次突破 140 万亿元，按不变价格计算，比上年增长 5.0%，圆满完成全年增长目标，实现了经济总量的新跨越。物价水平方面，2025 年居民消费价格指数（CPI）全年同比持平，核心 CPI 表现亮眼，全年上涨 0.7%，有效缓解了通缩压力，符合宏观调控预期。货币政策方面，2025 年央行坚持实施适度宽松的货币政策，综合运用公开市场操作、中期借贷便利、再贷款再贴现等多种工具，保持银行体系流动性充裕，推动社会综合融资成本持续下降，为实体经济高质量发展营造了适宜的货币金融环境。财政政策方面，2025 年财政部出台一系列积极的财政政策，强化逆周期调节，加大与货币政策的协同配合力度，重点支持提振消费、科技创新、产业升级等领域，有效激发了市场活力。总体而言，2025 年国内经济顶住外部环境复杂严峻、内部需求不足等多重压力，在宏观政策的精准调控下，实现了“稳增长、调结构、促转型”的多重目标，展现出强大的发展韧性。

资本市场方面，2025 年 A 股市场在宏观经济平稳运行、流动性充裕、产业政策利好、外资持续流入等多重因素的共同推动下，实现整体上行，主要指数全年均实现正增长，成交额创下历史较高水平。行业结构上，多数行业全年取得正收益，科技、资源类行业表现亮眼，消费类行业则表现低迷。受益于资本市场整体表现，2025 年，上证 580 指数上涨 39.20%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0469 元，本报告期份额净值增长率为 4.69%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%。受建仓期影响，年化跟踪误差 7.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，2026 年是“十五五”规划开局之年，也是推动高质量发展、培育新质生产力的关键一年，预计全年宏观经济将保持温和复苏态势，增速处于合理区间，结构优化与动能转换成为核心主线。消费方面，根据财政部政策部署，2026 年将加大消费补贴力度，打破支出固化格局，重点支持汽车以旧换新、银发经济、文旅消费等领域，促进居民消费能力与意愿逐步提升，有望推动服务消费占比进一步提升。投资方面，2026 年固定资产投资核心导向将从“规模扩张”转向“结构优化”。其中，新基建投资成为核心抓手，财政部明确专项债、超长期特别国债将重点支持新基建、城市更新、绿色能源等领域。出口方面，尽管面临全球经济增速放缓、地缘冲突等外部压力，但贸易多元化战略成效持续显现，我国对东盟、中东、拉美等新兴市场出口占比稳步提升。同时，高端制造出口竞争力持续提升，AI 服务器、半导体设备、新能源汽车等高技术产品出口加速，成为出口增长的核心动力。宏观政策端将延续“积极财政+适度宽松货币+精准产业”的组合发力模式，为经济复苏保驾护航。

资本市场方面，2026 年，依托宏观经济温和复苏、政策持续赋能、中长期资金加速入市的核心逻辑，A 股市场将延续“慢牛+分化”格局，驱动力从 2025 年的估值扩张转向盈利改善，整体可能呈现“稳中向好、结构制胜”的特征。资金面上，居民定期存款将在 2026 年迎来到期潮，其中部分资金可能通过各类渠道入市，为市场提供长期稳定流动性。同时，证监会明确提出，2026 年将持续拓宽中长期资金来源渠道，推动社保基金、养老基金、险资等“长钱”加速入市。我们对资本市场保持乐观预期的同时，也需关注潜在的市场风险。外部环境上，美联储主席换届提高全球流动性不确定性，同时美国政策的不确定性可能影响北向资金流向与出口韧性。内部风险上，房地产风险化解进度不及预期、地方政府债务压力缓释缓慢，可能影响宏观经济复苏节奏与市场风险偏好。综上所述，2026 年，在“十五五”规划开局启新，宏观经济温和复苏，政策协同发力的背景下，A 股市场预计延续慢牛走势，同时行业结构性机会或将凸显。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人紧扣公募基金行业高质量发展主线，根据法律法规、最新监管要求和业务发展需要，围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程，强化对法规和制度执行情况的监督检查，保障旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作情况如下：

(1) 坚持投资者利益至上，大力培育良好的合规文化，严格落实从业人员廉洁从业、职业操守和道德规范相关要求，积极探索合规文化宣贯新形式，组织面向全体员工及不同部门的合规专项培训、考试及承诺函签署等工作，引导员工将合规意识内化于心、外化于行，自觉践行“五要五不”的中国特色金融文化。

(2) 通过系统升级，进一步优化投资交易的日常监控机制，提升投前、投中和投后全链条的合规风控效能。投资合规部门与研究、投资、交易业务部门协同完善内部制度和流程，进一步明确业务执行规范。根据监管要求和业务发展情况，加强程序化交易执行监控，持续巩固公平交易和异常交易管控措施。

(3) 持续优化各类法律文件审核流程，强化全流程合规管控。坚持以投资者为本，积极推进浮动费率基金等创新产品开发论证，审慎评估各项新业务方案，保障公司各项业务稳妥有序开展，更好服务广大投资者财富管理需求。

(4) 严格遵守法律法规及监管规定，持续规范基金销售行为，强化对自媒体账号、社群运营等重点领域的合规管控。不断完善新型基金营销模式管控机制，支持创新业务与服务规范有序落地。积极探索运用数智化技术，开发宣传推介材料智能审核系统，提升合规审核效率。始终坚持以投资者利益为核心，健全投资者适当性管理长效机制，优化公募基金产品风险评价方法，提升产品评级的科学性与合理性。认真贯彻落实监管部门关于中小投资者保护工作要求，深入推进投诉溯源治理，妥善化解业务纠纷，切实维护投资者合法权益。

(5) 持续督促各部门落实法律法规、自律规则、基金法律文件中各项信息披露规定，优化完善相关制度流程；推进公司级信息披露平台和智能审核系统建设，深度探索人工智能技术在信息披露工作中的应用，以科技赋能有效应对持续增长的信息披露工作，防范信息披露合规风险和操作风险，做好公司及旗下各基金信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 深入贯彻落实新《反洗钱法》及配套法规制度要求，全面完善“基于风险”的洗钱风险管理体系，建立健全客户尽职调查和受益所有人识别机制，加强洗钱风险识别管控，推动科技赋能与数据治理，持续提升反洗钱工作有效性水平。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、运营、人员规范、反洗钱、境内外子公司等工作领域开展内审检查，同时聘请并配合外部审计机构开展年度内控评价、ISAE3402 内控鉴证、GIPS（全球投资业绩标准）鉴证项目，全方位审视公司内控机制和执行情况，督促改进内外部检查发现问题，进一步提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

完整。

§ 6 审计报告

德师报(审)字(26)第 P00385 号

易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金全体持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

易方达基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

汪芳 江丽雅

中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

2026 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	1,326,439.75
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	460,335,494.43
其中：股票投资		460,230,104.26
基金投资		-
债券投资		105,390.17
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-

应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		461,661,934.18
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		171,391.10
应付赎回款		-
应付管理人报酬		88,368.46
应付托管费		29,456.16
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		2.70
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	12,000.00
负债合计		301,218.42
净资产:		
实收基金	7.4.7.7	440,696,000.00
未分配利润	7.4.7.8	20,664,715.76
净资产合计		461,360,715.76
负债和净资产总计		461,661,934.18

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 10 月 10 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 10 月 10 日至 2025 年 12 月 31 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 12 月 31 日，基金份额净值 1.0469 元，基金份额总额 440,696,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		38,651,092.78
1.利息收入		23,237.24
其中：存款利息收入	7.4.7.9	23,237.24
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）		17,376,393.74
其中：股票投资收益	7.4.7.10	17,172,197.97
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	61,862.63
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.13	-
股利收益	7.4.7.14	142,333.14
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	21,183,430.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	68,031.41

减：二、营业总支出		224,707.52
1. 管理人报酬		131,007.19
2. 托管费		43,669.04
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	7.4.7.17	-
7. 税金及附加		0.29
8. 其他费用	7.4.7.18	50,031.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,426,385.26
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,426,385.26
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		38,426,385.26

注：本基金合同生效日为 2025 年 10 月 10 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 10 月 10 日至 2025 年 12 月 31 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。

7.3 净资产变动表

会计主体：易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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	212,696,000.00	-	212,696,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	228,000,000.00	20,664,715.76	248,664,715.76

(一)、综合收益总额	-	38,426,385.26	38,426,385.26
(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)	228,000,000.00	-17,761,669.50	210,238,330.50
其中: 1.基金申购款	840,000,000.00	-4,539,601.09	835,460,398.91
2.基金赎回款	-612,000,000.00	-13,222,068.41	-625,222,068.41
(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	440,696,000.00	20,664,715.76	461,360,715.76

注: 本基金合同生效日为 2025 年 10 月 10 日, 2025 年度实际报告期间为 2025 年 10 月 10 日至 2025 年 12 月 31 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 7.1 至 7.4, 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达上证 580 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[2025]1414 号《关于准予易方达上证 580 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 580 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 580 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 10 月 10 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 212,696,000.00 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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2025 年 9 月 22 日至 2025 年 9 月 29 日, 募集金额总额为人民币 212,727,355.87 元, 其中: 有效净认购金额为人民币 212,696,000.00 元, 有效认购资金在募集期内产生的银行利息

共计人民币 31,355.87 元，经安永华明（2025）验字第 70013033_G41 号验资报告予以审验。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 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 10 月 10 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该

限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且(2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额，以及由本基金申购对价包含可以现金替代时被可以替代成分股票在未补足(或未强制退款)前形成的公允价值变动收益/(损失)而来的未实现平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务,是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,仍按原金融资产类别进行后续计量,并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息,以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用,本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式采用现金分红;

2、每一基金份额享有同等分配权;

3、在符合以下有关基金分红条件的情形下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以届时的公告为准:

(1)本基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过业绩比较基准同期累计报酬率或者基金可供分配利润金额大于 0 元时,基金管理人可进行收益分配,累计报酬率计算方式详见招募说明书;若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2)当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时,基于本基金的特点,本基金收益分配无需以弥补亏损为前提,收益分配后基金份额净值有可能低于面值;当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时,本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、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,不需召开基金份额持有人大会审议;

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

7.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1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。

7.4.5.2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。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、

财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳

税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
	2025 年 12 月 31 日
活期存款	949,561.87
等于：本金	949,472.15
加：应计利息	89.72
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	376,877.88
等于：本金	376,764.59
加：应计利息	113.29
合计	1,326,439.75

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		439,085,059.05	-	460,230,104.26	21,145,045.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	66,999.12	5.87	105,390.17	38,385.18
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	66,999.12	5.87	105,390.17	38,385.18
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		439,152,058.17	5.87	460,335,494.43	21,183,430.39

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	
其中：交易所市场	
银行间市场	
应付利息	
预提费用	12,000.00
合计	12,000.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	212,696,000.00	212,696,000.00
本期申购	840,000,000.00	840,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-612,000,000.00	-612,000,000.00
本期末	440,696,000.00	440,696,000.00

注：本基金合同于 2025 年 10 月 10 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 212,696,000.00 份基金份额。

7.4.7.8 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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	17,242,954.87	21,183,430.39	38,426,385.26
本期基金份额交易产生的变动数	3,211,507.03	-20,973,176.53	-17,761,669.50
其中：基金申购款	16,085,055.81	-20,624,656.90	-4,539,601.09
基金赎回款	-12,873,548.78	-348,519.63	-13,222,068.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,454,461.90	210,253.86	20,664,715.76

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	7,201.01
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	16,036.23
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	23,237.24

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,398,663.26
股票投资收益——赎回差价收入	13,773,534.71
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	17,172,197.97

7.4.7.10.2 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 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	219,978,489.30
减：卖出股票成本总额	216,365,892.86
减：交易费用	213,933.18
买卖股票差价收入	3,398,663.26

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	625,222,068.41
减：现金支付赎回款总额	8,342,455.41
减：赎回股票成本总额	603,106,078.29

减：交易费用	-
赎回差价收入	13,773,534.71

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	81.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	61,780.77
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	61,862.63

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,506,856.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,396,410.70
减：应计利息总额	48,381.88
减：交易费用	283.35
买卖债券差价收入	61,780.77

7.4.7.12 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。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	142,333.14
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	142,333.14

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	21,183,430.39
——股票投资	21,145,045.21
——债券投资	38,385.18
——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	21,183,430.39

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	36,675.54
其他	31,355.87
合计	68,031.41

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。

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.18其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	12,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	131.00
其他	37,900.00
合计	50,031.00

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1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。

7.4.8.2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。

7.4.9关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司	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
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达私募基金管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司

易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	131,007.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,229.61
应支付基金管理人的净管理费	127,777.58

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为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，自动在次月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、

休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	43,669.04

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

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

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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 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
易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	407,383,200.00	92.4409%

广发证券股份有限公司	7,263,876.00	1.6483%
------------	--------------	---------

注：本基金合同生效日为 2025 年 10 月 10 日。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。

7.4.10.6 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10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	949,561.87	7,201.01

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年10月10日（基金合同生效日）至2025年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	688795	摩尔线程	新股发行	351	40,112.28
广发证券股份有限公司	688805	健信超导	新股发行	2,643	49,106.94

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
603248	锡华科技	2025-12-16	6 个月	新股流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	6 个月	新股流通受限	83.06	117.19	45	3,737.70	5,273.55	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	416.02	246	28,112.88	102,340.92	-
688796	百奥赛图	2025-12-02	6 个月	新股流通受限	26.68	42.25	68	1,814.24	2,873.00	-
688805	健信超导	2025-12-17	6 个月	新股流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6 个月	新股流通受限	51.66	135.56	29	1,498.14	3,931.24	-
688809	强一股份	2025-12-23	6 个月	新股流通受限	85.09	203.31	216	18,379.44	43,914.96	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600058	五矿发展	2025-12-30	重大事项停牌	11.52	2026-01-15	12.67	53,900	472,740.59	620,928.00	-
603508	思维列控	2025-12-29	重大事项停牌	27.82	2026-01-07	27.83	24,900	719,053.79	692,718.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、地方政府债、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 0.02%。

7.4.13.2.1 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12月31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。

7.4.13.2.2 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12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.3 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12月31日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.4 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12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	105,390.17
未评级	0.00

合计	105,390.17
----	------------

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。

7.4.13.2.5 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12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.2.6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12月31日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

7.4.13.3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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计

息(但该利息金额不重大)以外,本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息,可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2025 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	1,326,439.75	-	-	-	1,326,439.75
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	105,390.17	460,230,104.26	460,335,494.43
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	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,326,439.75	-	105,390.17	460,230,104.26	461,661,934.18
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	-	-	-	171,391.10	171,391.10
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	88,368.46	88,368.46
应付托管费	-	-	-	29,456.16	29,456.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.70	2.70
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	12,000.00	12,000.00
负债总计	-	-	-	301,218.42	301,218.42
利率敏感度缺口	1,326,439.75	-	105,390.17	459,928,885.84	461,360,715.76

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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	460,230,104.26	99.75
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	460,230,104.26	99.75

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	23,017,884.48
	2.业绩比较基准下降 5%	-23,017,884.48

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	458,850,698.71
第二层次	1,313,646.00
第三层次	171,149.72
合计	460,335,494.43

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	61,092.10	61,092.10
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	110,057.62	110,057.62
其中：计入损益的利得或损失	-	110,057.62	110,057.62
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	171,149.72	171,149.72
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的	-	110,057.62	110,057.62

未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
-----------------------	--	--	--

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	171,149.72	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	1.4146—2.2282	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	460,230,104.26	99.69
	其中：股票	460,230,104.26	99.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	105,390.17	0.02
	其中：债券	105,390.17	0.02
	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	1,326,439.75	0.29
8	其他各项资产	-	-
9	合计	461,661,934.18	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,094,937.00	0.45
B	采矿业	11,742,398.00	2.55
C	制造业	310,070,724.53	67.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,483,218.00	3.14
E	建筑业	5,854,097.00	1.27
F	批发和零售业	13,369,750.00	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	19,096,246.00	4.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,641,857.63	9.24
J	金融业	11,802,933.89	2.56
K	房地产业	6,162,996.00	1.34
L	租赁和商务服务业	4,674,507.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	6,674,110.21	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	6,126,071.00	1.33
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	5,436,258.00	1.18
S	综合	-	-
	合计	460,230,104.26	99.75

8.3 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

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	688498	源杰科技	7,701	4,943,964.99	1.07
2	603516	淳中科技	18,000	4,023,000.00	0.87
3	600105	永鼎股份	148,200	3,719,820.00	0.81
4	688313	仕佳光子	40,704	3,613,701.12	0.78
5	603119	浙江荣泰	27,600	3,192,492.00	0.69
6	601208	东材科技	103,200	2,795,688.00	0.61
7	600595	中孚实业	355,700	2,792,245.00	0.61
8	688270	臻镭科技	21,716	2,650,872.12	0.57
9	603308	应流股份	60,200	2,513,350.00	0.54
10	600410	华胜天成	139,000	2,485,320.00	0.54
11	600343	航天动力	48,500	2,375,045.00	0.51
12	603667	五洲新春	32,400	2,267,352.00	0.49
13	600151	航天机电	127,200	2,232,360.00	0.48
14	601020	华钰矿业	83,100	2,232,066.00	0.48
15	601606	长城军工	46,000	2,213,520.00	0.48
16	688627	精智达	9,626	2,152,277.34	0.47
17	600201	生物股份	140,700	2,120,349.00	0.46
18	603306	华懋科技	33,500	2,110,835.00	0.46
19	600388	龙净环保	128,800	2,100,728.00	0.46
20	600330	天通股份	156,300	2,052,219.00	0.44
21	600114	东睦股份	64,000	1,955,200.00	0.42
22	688048	长光华芯	15,593	1,954,582.55	0.42
23	688536	思瑞浦	12,145	1,941,742.60	0.42
24	688195	腾景科技	11,388	1,930,835.40	0.42
25	688205	德科立	13,981	1,922,107.88	0.42
26	688102	斯瑞新材	48,979	1,897,446.46	0.41
27	688327	云从科技	131,499	1,889,640.63	0.41
28	600155	华创云信	280,700	1,858,234.00	0.40
29	600728	佳都科技	269,900	1,802,932.00	0.39
30	600179	安通控股	321,900	1,776,888.00	0.39
31	600416	湘电股份	112,500	1,775,250.00	0.38
32	600113	浙江东日	26,700	1,686,639.00	0.37
33	600259	中稀有金	29,800	1,676,548.00	0.36
34	600759	洲际油气	524,800	1,637,376.00	0.35
35	688167	炬光科技	9,201	1,610,819.07	0.35
36	688382	益方生物	58,901	1,604,463.24	0.35
37	600635	大众公用	245,300	1,604,262.00	0.35
38	600877	电科芯片	90,400	1,586,520.00	0.34
39	605196	华通线缆	45,500	1,580,670.00	0.34
40	603686	福龙马	52,600	1,561,694.00	0.34
41	600859	王府井	99,800	1,549,894.00	0.34

42	600206	有研新材	75,100	1,526,783.00	0.33
43	600326	西藏天路	138,200	1,524,346.00	0.33
44	605376	博迁新材	23,300	1,523,820.00	0.33
45	600490	鹏欣资源	196,400	1,518,172.00	0.33
46	603358	华达科技	29,700	1,499,850.00	0.33
47	601375	中原证券	348,500	1,498,550.00	0.32
48	688141	杰华特	34,333	1,491,082.19	0.32
49	601975	招商南油	492,200	1,486,444.00	0.32
50	600619	海立股份	70,000	1,477,000.00	0.32
51	600986	浙文互联	188,500	1,474,070.00	0.32
52	688548	广钢气体	100,760	1,465,050.40	0.32
53	688567	孚能科技	92,948	1,454,636.20	0.32
54	603360	百傲化学	44,900	1,446,678.00	0.31
55	603009	北特科技	30,000	1,444,800.00	0.31
56	600456	宝钛股份	36,400	1,435,980.00	0.31
57	688372	伟测科技	13,153	1,434,860.77	0.31
58	688766	普冉股份	11,169	1,420,808.49	0.31
59	600226	亨通股份	263,000	1,401,790.00	0.30
60	600872	中炬高新	79,100	1,388,205.00	0.30
61	600596	新安股份	119,800	1,374,106.00	0.30
62	600186	莲花控股	226,500	1,354,470.00	0.29
63	601778	晶科科技	362,200	1,347,384.00	0.29
64	688068	热景生物	8,306	1,345,572.00	0.29
65	603997	继峰股份	96,800	1,345,520.00	0.29
66	600366	宁波韵升	97,300	1,341,767.00	0.29
67	688698	伟创电气	13,481	1,333,001.28	0.29
68	600629	华建集团	61,100	1,325,870.00	0.29
69	688668	鼎通科技	10,690	1,325,560.00	0.29
70	603026	石大胜华	17,600	1,316,656.00	0.29
71	688585	上纬新材	10,326	1,315,222.62	0.29
72	601333	广深铁路	430,000	1,307,200.00	0.28
73	688503	聚和材料	21,380	1,304,180.00	0.28
74	600320	振华重工	252,700	1,301,405.00	0.28
75	688158	优刻得	46,322	1,301,184.98	0.28
76	600739	辽宁成大	116,300	1,300,234.00	0.28
77	601918	新集能源	196,700	1,300,187.00	0.28
78	603929	亚翔集成	13,600	1,298,800.00	0.28
79	688409	富创精密	19,214	1,295,023.60	0.28
80	688239	航宇科技	19,132	1,294,662.44	0.28
81	603323	苏农银行	255,900	1,292,295.00	0.28
82	600797	浙大网新	130,300	1,291,273.00	0.28
83	603319	美湖股份	34,600	1,265,668.00	0.27
84	600531	豫光金铅	106,700	1,253,725.00	0.27
85	688652	京仪装备	12,701	1,248,635.31	0.27

86	688403	汇成股份	76,047	1,245,649.86	0.27
87	688063	派能科技	21,782	1,237,653.24	0.27
88	688400	凌云光	29,199	1,237,453.62	0.27
89	600550	保变电气	116,700	1,231,185.00	0.27
90	600133	东湖高新	135,100	1,226,708.00	0.27
91	600835	上海机电	40,818	1,224,948.18	0.27
92	600301	华锡有色	31,900	1,223,684.00	0.27
93	688559	海目星	25,347	1,218,176.82	0.26
94	600867	通化东宝	149,000	1,217,330.00	0.26
95	600718	东软集团	120,476	1,213,193.32	0.26
96	688025	杰普特	8,516	1,205,610.12	0.26
97	600645	中源协和	47,700	1,202,040.00	0.26
98	688362	甬矽电子	36,664	1,188,280.24	0.26
99	600552	凯盛科技	95,800	1,187,920.00	0.26
100	603301	振德医疗	16,800	1,184,400.00	0.26
101	601609	金田股份	109,500	1,182,600.00	0.26
102	603809	豪能股份	81,600	1,170,960.00	0.25
103	600478	科力远	168,900	1,163,721.00	0.25
104	688062	迈威生物	30,195	1,161,601.65	0.25
105	688660	电气风电	67,806	1,153,380.06	0.25
106	600908	无锡银行	194,400	1,152,792.00	0.25
107	688031	星环科技	10,653	1,152,548.07	0.25
108	600528	中铁工业	140,600	1,150,108.00	0.25
109	688502	茂莱光学	2,872	1,146,071.60	0.25
110	600480	凌云股份	92,500	1,136,825.00	0.25
111	600869	远东股份	140,400	1,130,220.00	0.24
112	600771	广誉远	62,000	1,114,760.00	0.24
113	688789	宏华数科	13,642	1,112,777.94	0.24
114	601678	滨化股份	260,800	1,105,792.00	0.24
115	600389	江山股份	43,500	1,099,680.00	0.24
116	688147	微导纳米	17,506	1,099,201.74	0.24
117	600961	株冶集团	68,100	1,096,410.00	0.24
118	600959	江苏有线	317,000	1,090,480.00	0.24
119	600063	皖维高新	183,300	1,079,637.00	0.23
120	601005	重庆钢铁	737,900	1,077,334.00	0.23
121	600391	航发科技	29,000	1,075,900.00	0.23
122	601929	吉视传媒	309,700	1,065,368.00	0.23
123	688321	微芯生物	36,409	1,063,870.98	0.23
124	603876	鼎胜新材	70,600	1,059,706.00	0.23
125	600267	海正药业	106,400	1,052,296.00	0.23
126	688612	威迈斯	31,890	1,051,413.30	0.23
127	688518	联赢激光	43,202	1,049,376.58	0.23
128	600864	哈投股份	158,200	1,048,866.00	0.23
129	603337	杰克科技	24,200	1,048,586.00	0.23

130	603859	能科科技	24,900	1,047,045.00	0.23
131	605020	永和股份	38,800	1,043,332.00	0.23
132	688433	华曙高科	15,702	1,039,001.34	0.23
133	688262	国芯科技	34,104	1,035,056.40	0.22
134	603011	合锻智能	43,600	1,033,756.00	0.22
135	600821	金开新能	202,600	1,033,260.00	0.22
136	603887	城地香江	76,100	1,028,872.00	0.22
137	600621	华鑫股份	67,300	1,025,652.00	0.22
138	601860	紫金银行	371,300	1,024,788.00	0.22
139	600022	山东钢铁	675,300	1,019,703.00	0.22
140	600353	旭光电子	62,900	1,013,948.00	0.22
141	600509	天富能源	122,100	1,008,546.00	0.22
142	600572	康恩贝	224,100	999,486.00	0.22
143	688392	骄成超声	8,888	997,233.60	0.22
144	688543	国科军工	15,837	983,002.59	0.21
145	600501	航天晨光	32,400	976,212.00	0.21
146	600056	中国医药	94,400	975,152.00	0.21
147	600556	天下秀	160,400	973,628.00	0.21
148	600592	龙溪股份	35,500	969,505.00	0.21
149	600686	金龙汽车	54,480	966,475.20	0.21
150	688531	日联科技	14,635	966,349.05	0.21
151	688206	概伦电子	27,548	959,496.84	0.21
152	688556	高测股份	83,954	958,754.68	0.21
153	688519	南亚新材	11,819	955,684.34	0.21
154	600315	上海家化	42,400	954,848.00	0.21
155	600996	贵广网络	94,800	951,792.00	0.21
156	603663	三祥新材	26,700	943,845.00	0.20
157	688691	灿芯股份	9,216	939,847.68	0.20
158	603220	中贝通信	44,000	937,200.00	0.20
159	688049	炬芯科技	17,735	932,861.00	0.20
160	601718	际华集团	278,400	932,640.00	0.20
161	600783	鲁信创投	37,700	932,321.00	0.20
162	600651	飞乐音响	127,100	926,559.00	0.20
163	601069	西部黄金	34,700	925,796.00	0.20
164	600787	中储股份	164,500	924,490.00	0.20
165	688319	欧林生物	36,231	918,818.16	0.20
166	600827	百联股份	101,600	913,384.00	0.20
167	688306	均普智能	78,060	905,496.00	0.20
168	688326	经纬恒润	7,677	902,047.50	0.20
169	600461	洪城环境	97,300	901,971.00	0.20
170	688591	泰凌微	21,173	901,122.88	0.20
171	601969	海南矿业	75,700	899,316.00	0.19
172	600037	歌华有线	122,800	896,440.00	0.19
173	688798	艾为电子	11,735	893,150.85	0.19

174	600587	新华医疗	61,500	885,600.00	0.19
175	603169	兰石重装	82,700	881,582.00	0.19
176	605507	国邦医药	35,500	880,400.00	0.19
177	600475	华光环能	48,400	879,428.00	0.19
178	600255	鑫科材料	228,400	879,340.00	0.19
179	603039	泛微网络	16,400	878,056.00	0.19
180	601890	亚星锚链	85,100	875,679.00	0.19
181	601369	陕鼓动力	87,300	873,873.00	0.19
182	688717	艾罗能源	14,134	870,654.40	0.19
183	688066	航天宏图	26,553	864,565.68	0.19
184	688523	航天环宇	15,422	863,015.12	0.19
185	688499	利元亨	14,916	860,951.52	0.19
186	603171	税友股份	15,600	860,028.00	0.19
187	603031	安孚科技	19,400	859,420.00	0.19
188	600420	国药现代	85,000	858,500.00	0.19
189	688097	博众精工	22,689	856,509.75	0.19
190	603123	翠微股份	50,600	850,586.00	0.18
191	600158	中体产业	97,300	849,429.00	0.18
192	600106	重庆路桥	134,700	843,222.00	0.18
193	600496	精工钢构	201,800	837,470.00	0.18
194	688401	路维光电	17,121	835,676.01	0.18
195	600055	万东医疗	53,300	830,414.00	0.18
196	600654	中安科	218,800	824,876.00	0.18
197	603256	宏和科技	22,400	824,544.00	0.18
198	600789	鲁抗医药	91,100	823,544.00	0.18
199	601619	嘉泽新能	184,100	817,404.00	0.18
200	688153	唯捷创芯	21,660	815,282.40	0.18
201	600717	天津港	182,300	814,881.00	0.18
202	688146	中船特气	20,127	813,130.80	0.18
203	600882	妙可蓝多	32,300	812,022.00	0.18
204	688108	赛诺医疗	42,199	811,908.76	0.18
205	688332	中科蓝讯	6,175	810,839.25	0.18
206	603936	博敏电子	63,700	808,990.00	0.18
207	600361	创新新材	190,400	807,296.00	0.17
208	600203	福日电子	60,100	801,734.00	0.17
209	688696	极米科技	7,168	799,088.64	0.17
210	600198	大唐电信	82,600	797,090.00	0.17
211	600266	城建发展	156,600	793,962.00	0.17
212	605123	派克新材	7,600	789,640.00	0.17
213	603698	航天工程	20,300	786,625.00	0.17
214	600094	大名城	188,600	784,576.00	0.17
215	688165	埃夫特	33,010	784,317.60	0.17
216	605305	中际联合	18,800	783,208.00	0.17
217	600458	时代新材	58,900	781,603.00	0.17

218	603800	洪田股份	15,900	775,443.00	0.17
219	688658	悦康药业	34,257	774,550.77	0.17
220	600252	中恒集团	282,100	772,954.00	0.17
221	688261	东微半导	9,413	771,960.13	0.17
222	600269	赣粤高速	148,000	768,120.00	0.17
223	600881	亚泰集团	409,800	762,228.00	0.17
224	600973	宝胜股份	104,300	761,390.00	0.17
225	688352	颀中科技	60,272	760,029.92	0.16
226	600855	航天长峰	35,900	755,336.00	0.16
227	688300	联瑞新材	12,162	755,138.58	0.16
228	600611	大众交通	138,300	755,118.00	0.16
229	600744	华银电力	128,400	754,992.00	0.16
230	688007	光峰科技	40,539	752,809.23	0.16
231	600571	信雅达	47,400	752,712.00	0.16
232	601568	北元集团	201,400	749,208.00	0.16
233	603668	天马科技	44,900	748,034.00	0.16
234	600751	海航科技	195,200	747,616.00	0.16
235	603100	川仪股份	32,500	747,500.00	0.16
236	600125	铁龙物流	115,800	745,752.00	0.16
237	600059	古越龙山	80,300	743,578.00	0.16
238	600682	南京新百	85,000	742,900.00	0.16
239	688418	震有科技	17,051	741,377.48	0.16
240	603533	掌阅科技	33,500	741,020.00	0.16
241	688091	上海谊众	15,673	736,631.00	0.16
242	600623	华谊集团	95,300	734,763.00	0.16
243	688275	万润新能	9,685	730,249.00	0.16
244	600006	东风股份	101,600	729,488.00	0.16
245	600138	中青旅	73,400	725,192.00	0.16
246	688639	华恒生物	22,228	724,188.24	0.16
247	600284	浦东建设	86,100	723,240.00	0.16
248	688160	步科股份	4,740	722,850.00	0.16
249	600775	南京熊猫	59,100	722,202.00	0.16
250	688003	天准科技	12,235	720,641.50	0.16
251	688685	迈信林	12,956	718,798.88	0.16
252	600345	长江通信	20,700	717,462.00	0.16
253	600033	福建高速	173,700	717,381.00	0.16
254	603368	柳药集团	40,200	716,364.00	0.16
255	600710	苏美达	66,200	715,622.00	0.16
256	600502	安徽建工	152,100	713,349.00	0.15
257	688258	卓易信息	9,303	712,330.71	0.15
258	688593	新相微	35,227	710,880.86	0.15
259	688222	成都先导	30,283	710,136.35	0.15
260	600590	泰豪科技	75,400	709,514.00	0.15
261	688508	芯朋微	11,564	704,247.60	0.15

262	600597	光明乳业	86,800	702,212.00	0.15
263	600649	城投控股	157,600	701,320.00	0.15
264	600017	日照港	233,200	699,600.00	0.15
265	603197	保隆科技	18,900	699,111.00	0.15
266	688776	国光电气	6,936	698,732.64	0.15
267	600966	博汇纸业	101,600	693,928.00	0.15
268	603508	思维列控	24,900	692,718.00	0.15
269	688150	莱特光电	25,554	690,724.62	0.15
270	605128	上海沿浦	18,700	689,282.00	0.15
271	688535	华海诚科	6,145	688,731.60	0.15
272	603328	依顿电子	62,800	688,288.00	0.15
273	601200	上海环境	85,300	686,665.00	0.15
274	688507	索辰科技	6,843	686,284.47	0.15
275	603118	共进股份	59,400	683,100.00	0.15
276	688513	苑东生物	11,096	682,958.80	0.15
277	688549	中巨芯	74,733	681,564.96	0.15
278	688739	成大生物	26,451	681,377.76	0.15
279	600757	长江传媒	76,700	681,096.00	0.15
280	603227	雪峰科技	81,400	677,248.00	0.15
281	688311	盟升电子	14,843	676,840.80	0.15
282	688788	科思科技	10,039	676,026.26	0.15
283	600268	国电南自	64,400	674,912.00	0.15
284	603713	密尔克卫	12,100	674,817.00	0.15
285	603477	巨星农牧	38,700	666,027.00	0.14
286	603008	喜临门	32,400	663,552.00	0.14
287	600305	恒顺醋业	83,500	661,320.00	0.14
288	600664	哈药股份	191,000	658,950.00	0.14
289	603977	国泰集团	47,400	658,860.00	0.14
290	603969	银龙股份	65,107	658,231.77	0.14
291	600307	酒钢宏兴	397,100	655,215.00	0.14
292	688380	中微半导	20,296	652,516.40	0.14
293	600292	远达环保	49,900	651,195.00	0.14
294	600990	四创电子	20,500	648,825.00	0.14
295	600199	金种子酒	66,900	647,592.00	0.14
296	605599	菜百股份	39,400	644,978.00	0.14
297	603181	皇马科技	45,000	643,050.00	0.14
298	688486	龙迅股份	8,533	634,087.23	0.14
299	600748	上实发展	116,500	631,430.00	0.14
300	688305	科德数控	10,207	630,792.60	0.14
301	688515	裕太微	6,144	630,067.20	0.14
302	601326	秦港股份	180,400	629,596.00	0.14
303	688787	海天瑞声	5,405	626,925.95	0.14
304	688095	福昕软件	7,016	626,318.32	0.14
305	688707	振华新材	45,215	626,227.75	0.14

306	600846	同济科技	47,600	625,940.00	0.14
307	600963	岳阳林纸	134,000	625,780.00	0.14
308	688621	阳光诺和	10,035	623,675.25	0.14
309	600928	西安银行	168,400	623,080.00	0.14
310	600477	杭萧钢构	209,400	621,918.00	0.13
311	600058	五矿发展	53,900	620,928.00	0.13
312	600610	中毅达	62,500	620,625.00	0.13
313	600108	亚盛集团	196,500	618,975.00	0.13
314	600313	农发种业	96,000	618,240.00	0.13
315	600575	淮河能源	181,700	617,780.00	0.13
316	603322	超讯通信	16,100	617,596.00	0.13
317	688277	天智航	40,452	614,465.88	0.13
318	603738	泰晶科技	39,100	614,261.00	0.13
319	601579	会稽山	30,300	614,181.00	0.13
320	688522	纳睿雷达	15,311	611,368.23	0.13
321	600609	金杯汽车	132,000	611,160.00	0.13
322	688562	航天软件	25,590	611,089.20	0.13
323	603131	上海沪工	20,136	609,114.00	0.13
324	603636	南威软件	51,400	608,576.00	0.13
325	605488	福莱新材	17,700	607,995.00	0.13
326	603128	华贸物流	99,500	606,950.00	0.13
327	600557	康缘药业	42,900	605,319.00	0.13
328	601900	南方传媒	45,000	603,450.00	0.13
329	600167	联美控股	85,600	601,768.00	0.13
330	688190	云路股份	6,144	598,425.60	0.13
331	600812	华北制药	107,800	596,134.00	0.13
332	600217	中再资环	145,900	595,272.00	0.13
333	603111	康尼机电	86,900	595,265.00	0.13
334	688550	瑞联新材	13,129	594,874.99	0.13
335	603638	艾迪精密	31,400	594,402.00	0.13
336	688432	有研硅	47,505	589,537.05	0.13
337	600425	青松建化	141,600	589,056.00	0.13
338	600736	苏州高新	87,100	588,796.00	0.13
339	603918	金桥信息	37,300	585,237.00	0.13
340	688686	奥普特	4,694	582,666.22	0.13
341	688202	美迪西	10,318	581,935.20	0.13
342	601500	通用股份	120,400	580,328.00	0.13
343	603297	永新光学	5,500	579,150.00	0.13
344	601163	三角轮胎	40,500	578,745.00	0.13
345	601686	友发集团	91,900	577,132.00	0.13
346	605016	百龙创园	26,700	576,720.00	0.13
347	688553	汇宇制药	31,981	568,941.99	0.12
348	603383	顶点软件	15,700	566,927.00	0.12
349	600742	富维股份	56,600	566,000.00	0.12

350	600643	爱建集团	101,713	562,472.89	0.12
351	600184	光电股份	29,500	562,270.00	0.12
352	688584	上海合晶	25,541	560,369.54	0.12
353	603033	三维股份	51,800	559,958.00	0.12
354	600975	新五丰	94,700	557,783.00	0.12
355	601096	宏盛华源	134,400	557,760.00	0.12
356	688107	安路科技	20,321	552,324.78	0.12
357	688577	浙海德曼	5,697	551,811.42	0.12
358	605088	冠盛股份	15,500	551,800.00	0.12
359	603202	天有为	6,000	550,860.00	0.12
360	600708	光明地产	141,300	549,657.00	0.12
361	601789	宁波建工	110,000	548,900.00	0.12
362	600694	大商股份	30,500	546,865.00	0.12
363	603416	信捷电气	9,900	546,777.00	0.12
364	600510	黑牡丹	64,900	544,511.00	0.12
365	603069	海汽集团	20,000	543,000.00	0.12
366	600251	冠农股份	58,500	539,955.00	0.12
367	601177	杭齿前进	31,000	537,850.00	0.12
368	600073	光明肉业	83,200	532,480.00	0.12
369	603002	宏昌电子	71,800	530,602.00	0.12
370	688226	威腾电气	14,296	530,381.60	0.11
371	600976	健民集团	15,700	527,049.00	0.11
372	600861	北京人力	28,600	524,524.00	0.11
373	688586	江航装备	40,112	523,060.48	0.11
374	688368	晶丰明源	4,531	523,013.33	0.11
375	603078	江化微	29,300	523,005.00	0.11
376	601101	昊华能源	73,000	522,680.00	0.11
377	600163	中闽能源	96,000	520,320.00	0.11
378	603229	奥翔药业	52,400	519,808.00	0.11
379	688212	澳华内镜	11,864	518,575.44	0.11
380	688219	会通股份	41,630	517,044.60	0.11
381	605168	三人行	13,400	516,972.00	0.11
382	603985	恒润股份	33,700	513,588.00	0.11
383	603166	福达股份	32,500	510,250.00	0.11
384	600770	综艺股份	98,500	509,245.00	0.11
385	600195	中牧股份	64,600	508,402.00	0.11
386	601515	衢州东峰	117,798	506,531.40	0.11
387	600640	国脉文化	40,300	506,168.00	0.11
388	688443	智翔金泰	18,572	505,901.28	0.11
389	601388	怡球资源	166,700	501,767.00	0.11
390	603995	甬金股份	27,700	500,816.00	0.11
391	600212	绿能慧充	62,200	500,710.00	0.11
392	688656	浩欧博	3,250	499,850.00	0.11
393	601107	四川成渝	82,200	499,776.00	0.11

394	600197	伊力特	36,100	499,624.00	0.11
395	600894	广日股份	54,000	499,500.00	0.11
396	688225	亚信安全	25,591	496,465.40	0.11
397	600604	市北高新	89,600	496,384.00	0.11
398	688626	翔宇医疗	8,192	495,616.00	0.11
399	603367	辰欣药业	28,600	495,352.00	0.11
400	600979	广安爱众	112,600	494,314.00	0.11
401	600468	百利电气	69,600	494,160.00	0.11
402	605133	嵘泰股份	14,400	493,776.00	0.11
403	600335	国机汽车	75,800	493,458.00	0.11
404	688155	先惠技术	8,092	489,161.40	0.11
405	601801	皖新传媒	73,700	484,946.00	0.11
406	600020	中原高速	113,400	483,084.00	0.10
407	688603	天承科技	6,386	478,694.56	0.10
408	603013	亚普股份	19,300	476,131.00	0.10
409	603203	快克智能	13,000	475,930.00	0.10
410	603112	华翔股份	27,300	474,201.00	0.10
411	603950	长源东谷	16,300	471,885.00	0.10
412	600223	福瑞达	64,100	471,776.00	0.10
413	601886	江河集团	57,800	471,648.00	0.10
414	600971	恒源煤电	75,400	470,496.00	0.10
415	600929	雪天盐业	82,700	467,255.00	0.10
416	601949	中国出版	72,400	466,980.00	0.10
417	603348	文灿股份	24,200	466,092.00	0.10
418	600874	创业环保	78,300	465,102.00	0.10
419	600810	神马股份	51,700	464,783.00	0.10
420	688552	航天南湖	12,749	463,043.68	0.10
421	601226	华电科工	59,000	462,560.00	0.10
422	600997	开滦股份	80,400	462,300.00	0.10
423	600071	凤凰光学	21,400	460,100.00	0.10
424	688185	康希诺	7,320	460,062.00	0.10
425	603093	南华期货	23,500	458,015.00	0.10
426	688622	禾信仪器	4,510	456,096.30	0.10
427	600449	宁夏建材	36,900	456,084.00	0.10
428	688365	光云科技	26,950	454,646.50	0.10
429	603121	华培动力	21,400	452,824.00	0.10
430	605555	德昌股份	24,660	451,278.00	0.10
431	600713	南京医药	82,500	450,450.00	0.10
432	603992	松霖科技	11,000	450,120.00	0.10
433	605277	新亚电子	20,400	448,800.00	0.10
434	603530	神马电力	10,900	447,772.00	0.10
435	688182	灿勤科技	15,158	447,464.16	0.10
436	688128	中国电研	15,331	445,825.48	0.10
437	600987	航民股份	64,700	445,783.00	0.10

438	601921	浙版传媒	56,800	444,176.00	0.10
439	688268	华特气体	7,699	441,845.61	0.10
440	603629	利通电子	16,500	439,725.00	0.10
441	688035	德邦科技	9,103	439,219.75	0.10
442	600433	冠豪高新	133,300	437,224.00	0.09
443	688209	英集芯	21,917	437,024.98	0.09
444	688252	天德钰	20,642	436,991.14	0.09
445	601089	福元医药	18,200	436,800.00	0.09
446	688588	凌志软件	30,417	435,267.27	0.09
447	600508	上海能源	36,700	431,959.00	0.09
448	603466	风语筑	45,800	428,688.00	0.09
449	603567	珍宝岛	48,000	428,640.00	0.09
450	603162	海通发展	35,500	427,420.00	0.09
451	603124	江南新材	5,400	425,898.00	0.09
452	688320	禾川科技	11,396	425,298.72	0.09
453	603826	坤彩科技	25,000	425,000.00	0.09
454	600403	大有能源	60,500	422,290.00	0.09
455	601008	连云港	79,300	421,876.00	0.09
456	688389	普门科技	32,294	419,176.12	0.09
457	600576	祥源文旅	67,100	418,704.00	0.09
458	605183	确成股份	20,900	416,328.00	0.09
459	688351	微电生理	17,869	413,667.35	0.09
460	603299	苏盐井神	39,600	412,632.00	0.09
461	600780	通宝能源	72,300	410,664.00	0.09
462	600088	中视传媒	25,300	409,354.00	0.09
463	600825	新华传媒	66,200	409,116.00	0.09
464	603855	华荣股份	21,100	408,285.00	0.09
465	603072	天和磁材	10,000	406,900.00	0.09
466	600548	深高速	46,000	404,800.00	0.09
467	688232	新点软件	16,283	404,144.06	0.09
468	688105	诺唯赞	20,162	403,643.24	0.09
469	688348	昱能科技	8,001	403,170.39	0.09
470	688136	科兴制药	12,679	401,543.93	0.09
471	688046	药康生物	26,038	399,943.68	0.09
472	600368	五洲交通	102,000	399,840.00	0.09
473	688093	世华科技	10,766	396,727.10	0.09
474	600826	兰生股份	37,600	396,304.00	0.09
475	600605	汇通能源	13,200	396,000.00	0.09
476	600035	楚天高速	102,000	395,760.00	0.09
477	603366	日出东方	41,000	394,010.00	0.09
478	600903	贵州燃气	58,800	388,668.00	0.08
479	605116	奥锐特	15,500	388,275.00	0.08
480	601038	一拖股份	27,400	388,258.00	0.08
481	601116	三江购物	27,700	381,429.00	0.08

482	603098	森特股份	27,300	379,743.00	0.08
483	688505	复旦张江	45,441	377,160.30	0.08
484	600650	锦江在线	24,800	376,960.00	0.08
485	603193	润本股份	15,500	375,565.00	0.08
486	605319	无锡振华	17,700	372,408.00	0.08
487	600657	信达地产	107,300	370,185.00	0.08
488	603312	西典新能	7,900	369,720.00	0.08
489	688337	普源精电	9,926	366,170.14	0.08
490	600054	黄山旅游	32,200	364,504.00	0.08
491	601083	锦江航运	32,600	363,816.00	0.08
492	688177	百奥泰	15,699	363,274.86	0.08
493	600644	乐山电力	37,200	362,700.00	0.08
494	688697	纽威数控	23,357	359,230.66	0.08
495	600491	龙元建设	135,700	358,248.00	0.08
496	688298	东方生物	15,281	358,033.83	0.08
497	600981	苏豪汇鸿	113,100	355,134.00	0.08
498	605368	蓝天燃气	45,900	354,348.00	0.08
499	600310	广西能源	92,800	353,568.00	0.08
500	605056	咸亨国际	20,800	343,200.00	0.07
501	603223	恒通股份	36,500	339,450.00	0.07
502	605050	福然德	25,100	338,097.00	0.07
503	688001	华兴源创	11,200	338,016.00	0.07
504	600726	华电能源	141,200	337,468.00	0.07
505	600618	氯碱化工	28,400	337,392.00	0.07
506	601330	绿色动力	50,100	337,173.00	0.07
507	600278	东方创业	44,200	335,920.00	0.07
508	601339	百隆东方	57,900	335,241.00	0.07
509	603983	丸美生物	10,100	334,815.00	0.07
510	688138	清溢光电	11,887	334,737.92	0.07
511	603989	艾华集团	19,900	333,922.00	0.07
512	605009	豪悦护理	10,800	333,720.00	0.07
513	600935	华塑股份	135,600	332,220.00	0.07
514	688230	芯导科技	4,516	327,319.68	0.07
515	600279	重庆港	59,700	325,962.00	0.07
516	600053	九鼎投资	16,400	325,868.00	0.07
517	600569	安阳钢铁	144,200	324,450.00	0.07
518	601003	柳钢股份	64,300	323,429.00	0.07
519	603055	台华新材	34,200	322,848.00	0.07
520	600841	动力新科	52,700	320,943.00	0.07
521	605179	一鸣食品	15,300	319,923.00	0.07
522	603325	博隆技术	4,100	318,857.00	0.07
523	600724	宁波富达	54,800	315,648.00	0.07
524	601279	英利汽车	59,800	310,960.00	0.07
525	600162	香江控股	165,500	306,175.00	0.07

526	600746	江苏索普	44,500	306,160.00	0.07
527	600814	杭州解百	37,600	304,560.00	0.07
528	603271	永杰新材	7,400	303,992.00	0.07
529	601133	柏诚股份	19,700	303,380.00	0.07
530	600429	三元股份	58,100	300,958.00	0.07
531	603310	巍华新材	17,400	292,494.00	0.06
532	603708	家家悦	24,700	292,201.00	0.06
533	605222	起帆电缆	15,800	290,562.00	0.06
534	600551	时代出版	35,000	284,200.00	0.06
535	603395	红四方	9,700	283,531.00	0.06
536	603257	中国瑞林	4,700	278,710.00	0.06
537	688315	诺禾致源	20,949	278,202.72	0.06
538	600983	惠而浦	29,100	278,196.00	0.06
539	603050	科林电气	15,400	277,508.00	0.06
540	600400	红豆股份	115,800	275,604.00	0.06
541	603489	八方股份	8,900	272,162.00	0.06
542	603693	江苏新能	22,900	271,594.00	0.06
543	688151	华强科技	13,027	268,616.74	0.06
544	688526	科前生物	17,410	265,676.60	0.06
545	603125	常青科技	15,500	261,640.00	0.06
546	601086	国芳集团	25,400	258,318.00	0.06
547	603194	中力股份	6,560	257,873.60	0.06
548	605286	同力天启	6,300	255,843.00	0.06
549	603275	众辰科技	5,600	255,248.00	0.06
550	603210	泰鸿万立	13,000	252,980.00	0.05
551	605296	神农集团	8,600	252,152.00	0.05
552	600081	东风科技	21,000	248,430.00	0.05
553	603219	富佳股份	14,500	244,180.00	0.05
554	603587	地素时尚	18,000	240,480.00	0.05
555	688721	龙图光罩	5,126	238,512.78	0.05
556	605008	长鸿高科	16,300	232,601.00	0.05
557	600817	宇通重工	20,000	227,400.00	0.05
558	600939	重庆建工	71,500	226,655.00	0.05
559	603082	北自科技	6,083	224,462.70	0.05
560	603135	中重科技	24,300	223,803.00	0.05
561	603680	今创集团	14,000	215,740.00	0.05
562	605577	龙版传媒	16,500	215,655.00	0.05
563	603014	威高血净	5,400	214,002.00	0.05
564	603057	紫燕食品	10,200	207,468.00	0.04
565	605011	杭州热电	10,000	204,400.00	0.04
566	601068	中铝国际	38,600	204,194.00	0.04
567	605118	力鼎光电	6,700	201,737.00	0.04
568	605300	佳禾食品	17,199	199,508.40	0.04
569	605099	共创草坪	5,500	196,295.00	0.04

570	605198	安德利	5,200	195,624.00	0.04
571	600828	茂业商业	30,100	175,784.00	0.04
572	603153	上海建科	10,100	171,700.00	0.04
573	603103	横店影视	9,600	159,168.00	0.03
574	603382	海阳科技	4,700	151,528.00	0.03
575	603262	技源集团	5,200	148,148.00	0.03
576	603711	香飘飘	10,200	136,986.00	0.03
577	603400	华之杰	2,600	135,954.00	0.03
578	605005	合兴股份	6,500	124,670.00	0.03
579	603511	爱慕股份	7,100	109,979.00	0.02
580	603848	好太太	6,000	109,620.00	0.02
581	688795	摩尔线程	246	102,340.92	0.02
582	688809	强一股份	216	43,914.96	0.01
583	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
584	688790	昂瑞微	45	5,273.55	0.00
585	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
586	688807	优迅股份	29	3,931.24	0.00
587	688796	百奥赛图	68	2,873.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	688498	源杰科技	9,115,892.53	1.98
2	603131	上海沪工	5,303,958.34	1.15
3	688195	腾景科技	4,281,793.28	0.93
4	688068	热景生物	3,270,314.71	0.71
5	688627	精智达	2,932,887.10	0.64
6	688167	炬光科技	2,904,495.26	0.63
7	688205	德科立	2,823,632.08	0.61
8	688536	思瑞浦	2,566,869.60	0.56
9	688652	京仪装备	2,452,841.63	0.53
10	688279	峰昭科技	2,448,231.84	0.53
11	600113	浙江东日	2,376,425.00	0.52
12	600619	海立股份	2,325,543.00	0.50
13	603516	淳中科技	2,277,894.00	0.49
14	688668	鼎通科技	2,249,578.32	0.49
15	688766	普冉股份	2,214,253.59	0.48
16	603686	福龙马	2,156,325.00	0.47
17	688502	茂莱光学	2,154,327.12	0.47

18	688048	长光华芯	2,146,222.09	0.47
19	603119	浙江荣泰	2,101,337.00	0.46
20	688110	东芯股份	2,095,792.65	0.45

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。

8.4.2 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	688110	东芯股份	7,884,290.51	1.71
2	600601	方正科技	7,380,010.00	1.60
3	688498	源杰科技	6,173,272.62	1.34
4	603131	上海沪工	5,128,821.60	1.11
5	688343	云天励飞	3,773,316.73	0.82
6	688322	奥比中光	3,554,089.73	0.77
7	600331	宏达股份	3,445,936.99	0.75
8	688331	荣昌生物	3,133,853.97	0.68
9	600967	内蒙一机	2,792,492.00	0.61
10	603881	数据港	2,696,407.00	0.58
11	601519	大智慧	2,653,885.00	0.58
12	688279	峰昭科技	2,580,273.91	0.56
13	600602	云赛智联	2,487,015.00	0.54
14	688088	虹软科技	2,443,528.74	0.53
15	688205	德科立	2,222,614.48	0.48
16	688336	三生国健	2,130,527.51	0.46
17	603662	柯力传感	2,109,767.28	0.46
18	688031	星环科技	2,011,413.02	0.44
19	688167	炬光科技	1,980,579.14	0.43
20	688698	伟创电气	1,915,915.01	0.42

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。

8.4.3 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	435,750,741.16
卖出股票收入（成交）总额	219,978,489.30

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	105,390.17	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	105,390.17	0.02

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118062	天准转债	670	105,390.17	0.02

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,浙江荣泰电工器材股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到浙江省统计局的处罚。浙江臻镭科技股份有限公司在本报告期内被中国证券监督管理委员会立案调查。

本基金为指数型基金,上述主体所发行的证券系标的指数成份股,上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外,基金管理人未发现本基金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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	-

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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		中国工商银行股份有 限公司—易方达上证 580 交易型开放式指数 证券投资基金联接基 金	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
665	662,700.7 5	416,531,29 6.00	94.52%	24,164,704. 00	5.48%	407,383,20 0.00	92.44%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含该基金的联接基金“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 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	广发证券股份有限公司	7,263,876.00	1.65%
2	张昕	2,808,554.00	0.64%
3	范莹	1,589,000.00	0.36%
4	陈钢炼	1,000,000.00	0.23%
5	刘晖平	1,000,000.00	0.23%
6	唐亚玲	850,000.00	0.19%
7	中泰证券股份有限公司	573,358.00	0.13%
8	高巧英	500,000.00	0.11%
9	李文杰	500,000.00	0.11%
10	何珀禄	445,000.00	0.10%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达 上证 580 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金	407,383,200.00	92.44%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 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%

9.4 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025 年 10 月 10 日)基金份额总额	212,696,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	840,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	612,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	440,696,000.00

注：本基金合同生效日为 2025 年 10 月 10 日。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。本基金管理人于 2025 年 9 月 30 日发布公告，自 2025 年 9 月 29 日起张清华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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 12,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控、其他问题（销售管理）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《货币市场基金监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管部门对管理人上述方面部分制度机制不完善、规定执行不严格提出整改意见，管理人已及时通过完善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改，整改成果已经监管部门验收通过。
其他	/

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，本基金相关从业人员未受到调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中泰证券	5	649,552,062.95	100.00%	62,289.82	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中泰证券股份有限公司。本基金管理人与中泰证券股份有限公司不存在关联方关系。

c) 沪深交易所 A 股普通交易佣金率为 0.015%（包含经手费、证管费和深交所过户费），北交所股票交易佣金率为 0.02%（包含经手费），港股通股票交易佣金率为 0.01%，基金交易佣金率为 0.015%，货币 ETF 及债券 ETF 不收取佣金，债券交易佣金率为 0.0001%，回购交易佣金率为 0.0005%-0.015%，可转债和可交换债佣金率为 0.004%。

d) 本基金管理人负责选择证券经营机构，本年度内选择标准有调整，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。

11.7.2 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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例
中泰证券	7,092,914.80	100.00%	-	-	-	-

11.8 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 580 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-10-11
2	易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-10-17
3	易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-10-17
4	易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	证券日报	2025-10-17
5	易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-10-22
6	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加中航证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-03
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-24
8	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-11-28
9	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-19
10	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加世纪证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-12-22

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-------	----------------	------------

	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国工商银行股份有限公司—易方达上证580交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2025年11月07日~2025年12月31日	0.00	846,030,900.00	438,647,700.00	407,383,200.00	92.44%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达上证 580 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 580 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达上证 580 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。

13.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

13.3 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

二〇二六年三月三十一日