

# 易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资 基金

## 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

## § 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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                         | 5  |
| 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 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 13 |
| 6.1 资产负债表                               | 13 |
| 6.2 利润表                                 | 14 |
| 6.3 净资产变动表                              | 15 |
| 6.4 报表附注                                | 16 |
| § 7 投资组合报告                              | 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                    | 37 |
| 7.3 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         | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 49 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51 |
| 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      | 51 |
| 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   | 52 |
| 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   | 52 |
| 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      | 52 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 52 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 52 |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 52        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>53</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 53        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 53        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....   | 54        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>54</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>54</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 54        |
| 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 .....   | 54        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 54        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 54        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 55        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 55        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 55        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 56        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>56</b> |
| 11.1 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 ..... | 56        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>57</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 57        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 57        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 57        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|              |                              |
|--------------|------------------------------|
| 基金名称         | 易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 易方达上证科创板综合增强策略 ETF           |
| 场内简称         | 科创增指、科创综指增强 ETF 易方达          |
| 基金主代码        | 588550                       |
| 交易代码         | 588550                       |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                       |
| 基金合同生效日      | 2025 年 8 月 27 日              |
| 基金管理人        | 易方达基金管理有限公司                  |
| 基金托管人        | 平安银行股份有限公司                   |
| 报告期末基金份额总额   | 51,290,000.00 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 9 月 12 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 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（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，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。为更好地实现投资目标，本基金可适当参与债券和货币市场工具的投资，并可投资股指期货、国债期货、股票期权，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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 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                                                             | 平安银行股份有限公司                    |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 王玉                                                                      | 潘琦                            |
|             | 联系电话 | 020-85102688                                                            | 0755-22168257                 |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn                                                   | PANQI003@pingan.com.cn        |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088                                                            | 95511-3                       |
| 传真          |      | 020-38798812                                                            | 0755-82080387                 |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区荣粤道<br>188号6层                                                 | 广东省深圳市罗湖区深南东路<br>5047号        |
| 办公地址        |      | 广东省广州市天河区珠江西路<br>21号52层；广东省广州市天河区<br>珠江东路30号42层；广东省珠海<br>市横琴新区荣粤道188号6层 | 广东省深圳市福田区益田路<br>5023号平安金融中心B座 |
| 邮政编码        |      | 510627；510623；519031                                                    | 518001                        |
| 法定代表人       |      | 吴欣荣                                                                     | 谢永林                           |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                   |
|-------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 上海证券报             |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.efunds.com.cn |
| 基金中期报告置备地点        | 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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 38,071,251.33                        |
| 本期利润          | 52,883,705.62                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.6684                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 53.05%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 66.54%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | 33,018,580.92                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.6438                               |
| 期末基金资产净值      | 91,657,897.83                        |
| 期末基金份额净值      | 1.7871                               |

| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |
|--------------|-----------------------|
| 基金份额累计净值增长率  | 78.71%                |

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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 67.11%   | 2.54%       | 55.71%     | 2.36%         | 11.40% | 0.18% |
| 过去六个月      | 66.54%   | 2.38%       | 53.99%     | 2.23%         | 12.55% | 0.15% |
| 过去一年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 过去五年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 过去七年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 过去十年       | -        | -           | -          | -             | -      | -     |
| 自基金合同生效起至今 | 78.71%   | 2.13%       | 61.22%     | 2.07%         | 17.49% | 0.06% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达上证科创板综合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  
(2025 年 8 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：1.本基金合同于 2025 年 8 月 27 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，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。

§ 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<br>基金经理（助<br>理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                              |
|----|------------------------------------------------------------|-------------------------|----------|----------------|-------------------------------------------------|
|    |                                                            | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |                                                 |
| 殷明 | 本基金的基金经理，易方达易百智<br>能量化策略混合、易方达中证 1000<br>量化增强、易方达上证科创板 100 | 2025-<br>08-27          | -        | 10 年           | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，国盛证券有限责任公司研 |

|     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |            |   |     |                                                             |
|-----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|-----|-------------------------------------------------------------|
|     | 增强策略 ETF、易方达上证科创板综合增强、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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |            |   |     | 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。                                 |
| 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（自 2024 年 06 月 08 日至 2026 年 04 月 10 日）、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、易方达上证 580ETF 联接、易方达创业板 50ETF 联接、易方达上证科创板人工智能 ETF 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（自 2024 年 09 月 14 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达中证沪港深 500ETF（自 2024 年 09 月 14 日至 2026 年 01 月 05 日）、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（自 2024 年 11 月 22 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达中证 500 增强策略 ETF、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、易方达中证 A500 增强策略 ETF 的基金经理助理 | 2025-09-26 | - | 6 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。 |
| 刘砚芳 | 本基金的基金经理助理，易方达中证汽车零部件主题 ETF、易方达中证装备产业 ETF 联接发起式、易方达中证汽车零部件主题 ETF 联接发起式、易方达中证装备产业 ETF、易方达中证沪港深 300ETF 联接发起式、易方达中证万得并购重组指数（LOF）、易方达中证沪港深 300ETF、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达上证中盘 ETF 的基金经                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 2025-09-26 | - | 5 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研究员。                            |

|                                                               |  |  |  |  |
|---------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
| 理，易方达上证科创板成长 ETF 联接发起式、易方达恒生 ETF(QDII)、易方达上证科创板成长 ETF 的基金经理助理 |  |  |  |  |
|---------------------------------------------------------------|--|--|--|--|

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，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 64 次，均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。

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

2026 年上半年，国内经济顶住压力运行在合理区间，一季度增长开局良好，二季度增速有所回落。二季度的放缓主要受短期因素与外部环境影响：中东地缘冲突带来的能源供给冲击推升国际油价并沿产业链传导，部分石化相关行业受到扰动；同时部分需求在政策带动下已于前期集中释放，叠加房地产仍处调整阶段，内生需求偏弱，国内供强需弱的结构性矛盾较为突出。结构层面亮点亦

较为清晰：物价温和上涨，对外贸易增势良好，以信息服务业和高技术制造业为代表的新动能增速明显领先，新质生产力对经济增长的支撑作用持续显现。宏观政策方面，上半年更加积极有为的政策组合有效实施，财政与货币协同发力，市场流动性维持合理充裕，为实体经济与资本市场营造了总体适宜的环境。

在此背景下，上半年 A 股呈现“指数震荡抬升、结构极致分化”的行情特征。市场交投高度活跃，成交规模处于历史高位；但指数与个股层面的分化同样显著：科创 50 指数大幅上涨并创出历史新高，创业板指涨幅亦相当可观，而上证指数仅温和上涨，多数个股录得下跌，市场超额收益高度集中于科技硬制造赛道。行业层面，围绕全球 AI 资本开支、国产半导体替代与产业链上游涨价的主线贯穿上半年，半导体、光模块、PCB（印制电路板）等 AI 算力硬件方向领涨，半导体板块市值历史性跃居行业前列；与之相对，大消费、金融、地产等传统板块持续走弱。科创板作为本轮科技行情的核心载体，一季度报告披露后盈利的爆发性增长为板块上行提供了基本面支撑，上证科创板综合指数覆盖科创板上中下游各产业链环节，报告期内亦录得显著上涨，但成分股内部涨跌高度分化，盈利兑现能力成为个股定价的关键分水岭。

本基金作为指数增强型 ETF 基金，同时兼有指数增强与 ETF 两方面的特征：一方面在紧密跟踪上证科创板综合指数的前提下，通过量化方式力争获取超越业绩比较基准的收益；另一方面充分发挥 ETF 的工具属性。考虑到场内产品每日披露持仓且需要兼顾流动性管理，本基金的增强策略以低换手的基本面选股为主，侧重持有基本面扎实、成交与换手相对充裕的标的。本报告期内，市场上涨高度集中于少数权重与热门品种、多数个股下跌，这样的结构对偏重分散化持股的量化选股策略构成了较大考验；但另一方面，盈利兑现能力主导定价的市场环境，与本产品偏重基本面的选股框架较为契合，我们在上半年持续跟踪成分股一季报及中观景气变化，对基本面模型的因子权重进行了模型化的动态配置，其主要思路是基于历史时点信息对不同交易日给予不同的模型训练权重。同时，作为场内工具型产品，本基金上半年二级市场交易保持平稳，流动性维持在较为合理的水平，折溢价整体处于相对可控区间，较好地满足了投资者借道场内参与科创板块的配置与交易需求。

#### 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 1.7871 元，本报告期份额净值增长率为 66.54%，同期业绩比较基准收益率为 53.99%。年化跟踪误差 5.33%，超过目标控制范围，主要是投资组合与指数权重的偏差有所扩大所致。

#### 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，宏观政策有望加大逆周期和跨周期调节力度，持续扩大内需、优化供给，随着短期扰动因素逐步消除，前期受影响的行业有条件逐步恢复，经济增速有望企稳回升。需要跟踪的方

面包括：价格相关指标能否在政策发力下出现积极变化，地产调整与消费修复的进展，以及中东局势演变下能源价格对中下游行业成本与盈利的影响。

证券市场方面，上半年极致的结构性分化在下半年初已出现一定纠偏迹象，随着中报业绩陆续披露，围绕 AI 的交易预计将进一步进入考察盈利能力的阶段，概念驱动的品种可能被舍弃，资金有望向业绩确定、产业趋势具有持续性的方向集中。科创板块层面，海外与国产算力的推进节奏、半导体产业链的国产化进展与下游扩产状况、上游材料与资源品的价格传导，以及前期涨幅较大方向的业绩兑现情况，是下半年值得重点跟踪的主线；同时，部分成长板块估值已处于历史较高分位，若业绩兑现不及预期，波动可能加大，还需持续关注。

#### 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行

了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产：      |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 1,188,427.16           | 1,714,010.59             |
| 结算备付金    |         | -                      | -                        |
| 存出保证金    |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 90,763,221.72          | 156,700,769.87           |
| 其中：股票投资  |         | 90,741,221.28          | 156,666,769.42           |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | 22,000.44              | 34,000.45                |
| 资产支持证券投资 |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                      | -                        |
| 其他投资     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产   | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 应收清算款    |         | -                      | -                        |
| 应收股利     |         | -                      | -                        |
| 应收申购款    |         | -                      | -                        |
| 递延所得税资产  |         | -                      | -                        |
| 其他资产     | 6.4.7.5 | 60,492.63              | -                        |
| 资产总计     |         | 92,012,141.51          | 158,414,780.46           |
| 负债和净资产   | 附注号     | 本期末                    | 上年度末                     |

|             |         | 2026 年 6 月 30 日 | 2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-----------------|------------------|
| <b>负债：</b>  |         |                 |                  |
| 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       |         | -               | 28,349.93        |
| 应付赎回款       |         | -               | -                |
| 应付管理人报酬     |         | 34,902.53       | 81,479.24        |
| 应付托管费       |         | 6,980.49        | 16,295.86        |
| 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 | 312,360.66      | 234,078.42       |
| 负债合计        |         | 354,243.68      | 360,203.45       |
| <b>净资产：</b> |         |                 |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 51,290,000.00   | 147,290,000.00   |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 40,367,897.83   | 10,764,577.01    |
| 净资产合计       |         | 91,657,897.83   | 158,054,577.01   |
| 负债和净资产总计    |         | 92,012,141.51   | 158,414,780.46   |

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 8 月 27 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 8 月 27 日至 2025 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7871 元，基金份额总额 51,290,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|---------------------------------------|
| 一、营业总收入          |          | 53,323,108.90                         |
| 1.利息收入           |          | 2,233.50                              |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 2,233.50                              |
| 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） |          | 38,443,829.10                         |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.10 | 38,237,011.68                         |
| 基金投资收益           |          | -                                     |

|                       |          |               |
|-----------------------|----------|---------------|
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | 51,347.81     |
| 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 | 155,469.61    |
| 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 | 14,812,454.29 |
| 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 | 64,592.01     |
| 减：二、营业总支出             |          | 439,403.28    |
| 1. 管理人报酬              |          | 248,227.97    |
| 2. 托管费                |          | 49,645.54     |
| 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 | 141,529.77    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）   |          | 52,883,705.62 |
| 减：所得税费用               |          | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）     |          | 52,883,705.62 |
| 五、其他综合收益的税后净额         |          | -             |
| 六、综合收益总额              |          | 52,883,705.62 |

注：本基金合同生效日为 2025 年 8 月 27 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 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 | 147,290,000.00                        | 10,764,577.01 | 158,054,577.01 |
| 二、本期期初净资产 | 147,290,000.00                        | 10,764,577.01 | 158,054,577.01 |
| 三、本期增减变动  | -96,000,000.00                        | 29,603,320.82 | -66,396,679.18 |

|                                          |                 |                |                 |
|------------------------------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 额（减少以“-”号填列）                             |                 |                |                 |
| （一）、综合收益总额                               | -               | 52,883,705.62  | 52,883,705.62   |
| （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）      | -96,000,000.00  | -23,280,384.80 | -119,280,384.80 |
| 其中：1.基金申购款                               | 44,000,000.00   | 21,049,294.20  | 65,049,294.20   |
| 2.基金赎回款                                  | -140,000,000.00 | -44,329,679.00 | -184,329,679.00 |
| （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                                | 51,290,000.00   | 40,367,897.83  | 91,657,897.83   |

注：本基金合同生效日为 2025 年 8 月 27 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达上证科创板综合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[2025]940 号《关于准予易方达上证科创板综合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《易方达上证科创板综合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，《易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 8 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 675,290,000.00 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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局公告 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、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》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。资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。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。

至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（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及金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，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，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，免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款   | 73,059.53              |
| 等于：本金  | 73,042.69              |
| 加：应计利息 | 16.84                  |
| 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           | 1,115,367.63 |
| 等于：本金          | 1,115,227.95 |
| 加：应计利息         | 139.68       |
| 合计             | 1,188,427.16 |

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |      |               |               |
|---------------|-------|------------------------|------|---------------|---------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 66,889,020.67          | -    | 90,741,221.28 | 23,852,200.61 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -    | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 21,999.85              | 0.59 | 22,000.44     | -             |
|               | 银行间市场 | -                      | -    | -             | -             |
|               | 合计    | 21,999.85              | 0.59 | 22,000.44     | -             |
| 资产支持证券        |       | -                      | -    | -             | -             |
| 基金            |       | -                      | -    | -             | -             |
| 其他            |       | -                      | -    | -             | -             |
| 合计            |       | 66,911,020.52          | 0.59 | 90,763,221.72 | 23,852,200.61 |

#### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 应收利息  | -                      |
| 其他应收款 | -                      |
| 待摊费用  | 60,492.63              |
| 合计    | 60,492.63              |

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 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      | -                      |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 82,020.15              |
| 应付替代款       | 159,597.68             |
| 可退替代款       | 65,005.49              |
| 其他应付款       | 5,737.34               |
| 合计          | 312,360.66             |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 147,290,000.00                        | 147,290,000.00  |
| 本期申购          | 44,000,000.00                         | 44,000,000.00   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -140,000,000.00                       | -140,000,000.00 |
| 本期末           | 51,290,000.00                         | 51,290,000.00   |

#### 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 | 14,158,657.35 | -3,394,080.34 | 10,764,577.01 |
| 本期期初 | 14,158,657.35 | -3,394,080.34 | 10,764,577.01 |

|                |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 本期利润           | 38,071,251.33  | 14,812,454.29 | 52,883,705.62  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -19,211,327.76 | -4,069,057.04 | -23,280,384.80 |
| 其中：基金申购款       | 17,787,787.95  | 3,261,506.25  | 21,049,294.20  |
| 基金赎回款          | -36,999,115.71 | -7,330,563.29 | -44,329,679.00 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 33,018,580.92  | 7,349,316.91  | 40,367,897.83  |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 486.43                                |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | 1,747.07                              |
| 结算备付金利息收入 | -                                     |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 2,233.50                              |

#### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 12,116,026.08                         |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 26,120,985.60                         |
| 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               | 38,237,011.68                         |

##### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 73,934,199.41                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 61,759,256.75                         |
| 减：交易费用     | 58,916.58                             |
| 买卖股票差价收入   | 12,116,026.08                         |

##### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额 | 184,329,679.00                        |

|             |                |
|-------------|----------------|
| 减：现金支付赎回款总额 | 23,943,584.00  |
| 减：赎回股票成本总额  | 134,265,109.40 |
| 减：交易费用      | -              |
| 赎回差价收入      | 26,120,985.60  |

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 3.44                       |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 51,344.37                  |
| 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                           | 51,347.81                  |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 108,952.31                 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 57,599.91                  |
| 减：应计利息总额               | 3.54                       |
| 减：交易费用                 | 4.49                       |
| 买卖债券差价收入               | 51,344.37                  |

#### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 155,469.61                 |
| 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 | 155,469.61 |
|----|------------|

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | 14,812,454.29              |
| ——股票投资                     | 14,812,454.29              |
| ——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<br>预估增值税 | -                          |
| 合计                         | 14,812,454.29              |

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                          |
| 替代损益收入  | 64,592.01                  |
| 合计      | 64,592.01                  |

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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 22,512.78                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 存托服务费   | 2.25                       |
| 其他      | 59,507.37                  |
| 合计      | 141,529.77                 |

#### 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、关联关系

##### 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                    |
| 平安银行股份有限公司  | 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、证券经纪商 |

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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票成交总额的比例 |
| 广发证券  | 133,748,151.08             | 100.00%      |

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 |
| 广发证券  | 108,952.31                 | 100.00%      |

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |                |          |                  |
|-------|----------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                   | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 广发证券  | 13,375.78                  | 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.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 248,227.97                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 78,404.89                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 169,823.08                 |

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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 49,645.54                  |

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

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |          |
|-----------|----------------------------|----------|
|           | 期末余额                       | 当期利息收入   |
| 平安银行-活期存款 | 73,059.53                  | 486.43   |
| 广发证券-其他存款 | 1,115,367.63               | 1,747.07 |

注：1.本基金的其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

2.除其他存款外，本基金的上述银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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                            | 603435 | 嘉德利  | 新股发行 | 438        | 6,902.88 |

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（2026 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 |
| 001248               | 华润新能源 | 2026-06-25 | 1 个月以内 | 新股流通受限 | 10.11 | 10.11  | 1,000    | 10,110.00 | 10,110.00 | -  |
| 601112               | 振石股份  | 2026-01-21 | 6 个月   | 新股流通受限 | 11.18 | 17.59  | 129      | 1,442.22  | 2,269.11  | -  |
| 603284               | 林平发展  | 2026-02-03 | 6 个月   | 新股流通受限 | 37.88 | 34.87  | 25       | 947.00    | 871.75    | -  |
| 603293               | 埃泰克   | 2026-04-09 | 6 个月   | 新股流通受限 | 33.49 | 33.93  | 18       | 602.82    | 610.74    | -  |
| 603352               | 至信股份  | 2026-01-08 | 6 个月   | 新股流通受限 | 21.88 | 25.52  | 61       | 1,334.68  | 1,556.72  | -  |

|        |      |            |      |        |        |          |        |            |            |   |
|--------|------|------------|------|--------|--------|----------|--------|------------|------------|---|
| 603435 | 嘉德利  | 2026-05-15 | 6 个月 | 新股流通受限 | 15.76  | 46.71    | 44     | 693.44     | 2,055.24   | - |
| 603459 | 红板科技 | 2026-03-31 | 6 个月 | 新股流通受限 | 17.70  | 84.32    | 64     | 1,132.80   | 5,396.48   | - |
| 688635 | 长进光子 | 2026-05-20 | 6 个月 | 新股流通受限 | 40.98  | 308.19   | 38     | 1,557.24   | 11,711.22  | - |
| 688712 | 北芯生命 | 2026-01-28 | 6 个月 | 新股流通受限 | 17.52  | 35.92    | 542    | 9,495.84   | 19,468.64  | - |
| 688759 | 必贝特  | 2025-10-21 | 9 个月 | 新股流通受限 | 17.78  | 30.65    | 7,235  | 128,638.30 | 221,752.75 | - |
| 688781 | 视涯科技 | 2026-03-18 | 9 个月 | 新股流通受限 | 22.68  | 42.16    | 951    | 21,568.68  | 40,094.16  | - |
| 688783 | 西安奕材 | 2025-10-20 | 9 个月 | 新股流通受限 | 8.62   | 57.42    | 14,215 | 122,533.30 | 816,225.30 | - |
| 688785 | 恒运昌  | 2026-01-20 | 6 个月 | 新股流通受限 | 92.18  | 463.15   | 34     | 3,134.12   | 15,747.10  | - |
| 688790 | 昂瑞微  | 2025-12-09 | 9 个月 | 新股流通受限 | 83.06  | 126.45   | 609    | 50,583.54  | 77,008.05  | - |
| 688795 | 摩尔线程 | 2025-11-26 | 9 个月 | 新股流通受限 | 114.28 | 676.94   | 886    | 101,252.08 | 599,768.84 | - |
| 688802 | 沐曦股份 | 2025-12-09 | 9 个月 | 新股流通受限 | 104.66 | 768.89   | 599    | 62,691.34  | 460,565.11 | - |
| 688808 | 联讯仪器 | 2026-04-16 | 6 个月 | 新股流通受限 | 81.88  | 1,584.33 | 24     | 1,965.12   | 38,023.92  | - |
| 688811 | 有研新材 | 2026-04-01 | 6 个月 | 新股流通受限 | 6.41   | 24.13    | 316    | 2,025.56   | 7,625.08   | - |
| 688813 | 泰金新能 | 2026-03-24 | 6 个月 | 新股流通受限 | 26.28  | 172.09   | 77     | 2,023.56   | 13,250.93  | - |
| 688816 | 易思维  | 2026-02-04 | 6 个月 | 新股流通   | 55.95  | 57.10    | 48     | 2,685.60   | 2,740.80   | - |

|                             |      |            |          |        |        |        |          |          |           |    |
|-----------------------------|------|------------|----------|--------|--------|--------|----------|----------|-----------|----|
|                             |      |            |          | 受限     |        |        |          |          |           |    |
| 688818                      | 电科蓝天 | 2026-02-03 | 6 个月     | 新股流通受限 | 9.47   | 70.14  | 371      | 3,513.37 | 26,021.94 | -  |
| 688820                      | 盛合晶微 | 2026-04-13 | 6 个月     | 新股流通受限 | 19.68  | 141.49 | 144      | 2,833.92 | 20,374.56 | -  |
| <b>6.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b> |      |            |          |        |        |        |          |          |           |    |
| 证券代码                        | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期      | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量(单位：张) | 期末成本总额   | 期末估值总额    | 备注 |
| 111025                      | 圣泉转债 | 2026-06-26 | 1 个月内(含) | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 80       | 8,000.00 | 8,000.09  | -  |
| 118070                      | 南芯转债 | 2026-06-22 | 1 个月内(含) | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 60       | 6,000.00 | 6,000.23  | -  |
| 118071                      | 华峰转债 | 2026-06-24 | 1 个月内(含) | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 80       | 8,000.00 | 8,000.12  | -  |

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

|        |      |            |        |        |            |        |       |            |              |    |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|-------|------------|--------------|----|
| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期       | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额     | 期末估值总额       | 备注 |
| 688072 | 拓荆科技 | 2026-06-29 | 重大事项停牌 | 832.00 | 2026-07-13 | 890.99 | 1,395 | 765,664.85 | 1,160,640.00 | -  |
| 688260 | 昀冢科技 | 2026-06-26 | 重大事项停牌 | 144.00 | 2026-07-01 | 132.00 | 275   | 38,508.25  | 39,600.00    | -  |

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 2026 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 2026 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 2026 年 6 月 30 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%(2025 年 12 月 31 日：0.02%)。

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<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025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<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025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<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025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<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 0.00              | 0.00                |
| AAA 以下 | 22,000.44         | 34,000.45           |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 22,000.44         | 34,000.45           |

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<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025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<br>2026年6月30日 | 上年度末<br>2025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 2026 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<br>2026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              | 1,188,427.16 | -    | -         | -             | 1,188,427.16  |
| 结算备付金             | -            | -    | -         | -             | -             |
| 存出保证金             | -            | -    | -         | -             | -             |
| 交易性金融资产           | -            | -    | 22,000.44 | 90,741,221.28 | 90,763,221.72 |
| 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              | -            | -    | -         | 60,492.63     | 60,492.63     |
| 资产总计              | 1,188,427.16 | -    | 22,000.44 | 90,801,713.91 | 92,012,141.51 |
| 负债                |              |      |           |               |               |
| 短期借款              | -            | -    | -         | -             | -             |
| 交易性金融负债           | -            | -    | -         | -             | -             |
| 衍生金融负债            | -            | -    | -         | -             | -             |
| 卖出回购金融资产款         | -            | -    | -         | -             | -             |

|                             |              |       |           |                |                |
|-----------------------------|--------------|-------|-----------|----------------|----------------|
| 应付清算款                       | -            | -     | -         | -              | -              |
| 应付赎回款                       | -            | -     | -         | -              | -              |
| 应付管理人报酬                     | -            | -     | -         | 34,902.53      | 34,902.53      |
| 应付托管费                       | -            | -     | -         | 6,980.49       | 6,980.49       |
| 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                        | -            | -     | -         | 312,360.66     | 312,360.66     |
| 负债总计                        | -            | -     | -         | 354,243.68     | 354,243.68     |
| 利率敏感度缺口                     | 1,188,427.16 | -     | 22,000.44 | 90,447,470.23  | 91,657,897.83  |
| 上年度末<br>2025 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上     | 不计息            | 合计             |
| 资产                          |              |       |           |                |                |
| 货币资金                        | 1,714,010.59 | -     | -         | -              | 1,714,010.59   |
| 结算备付金                       | -            | -     | -         | -              | -              |
| 存出保证金                       | -            | -     | -         | -              | -              |
| 交易性金融资产                     | -            | -     | 34,000.45 | 156,666,769.42 | 156,700,769.87 |
| 衍生金融资产                      | -            | -     | -         | -              | -              |
| 买入返售金融资<br>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                        | 1,714,010.59 | -     | 34,000.45 | 156,666,769.42 | 158,414,780.46 |
| 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<br>产款               | -            | -     | -         | -              | -              |
| 应付清算款                       | -            | -     | -         | 28,349.93      | 28,349.93      |
| 应付赎回款                       | -            | -     | -         | -              | -              |

|         |              |   |           |                |                |
|---------|--------------|---|-----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | -            | - | -         | 81,479.24      | 81,479.24      |
| 应付托管费   | -            | - | -         | 16,295.86      | 16,295.86      |
| 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    | -            | - | -         | 234,078.42     | 234,078.42     |
| 负债总计    | -            | - | -         | 360,203.45     | 360,203.45     |
| 利率敏感度缺口 | 1,714,010.59 | - | 34,000.45 | 156,306,565.97 | 158,054,577.01 |

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<br>2026 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                          |
|--------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|              | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 90,741,221.28          | 99.00                    | 156,666,769.42           | 99.12                    |

|               |               |       |                |       |
|---------------|---------------|-------|----------------|-------|
| 交易性金融资产—债券投资  | 22,000.44     | 0.02  | -              | -     |
| 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            | 90,763,221.72 | 99.02 | 156,666,769.42 | 99.12 |

#### 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                      | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|    | 1.业绩比较基准上升 5%        | 4,584,850.57                    | 8,322,007.29             |
|    | 2.业绩比较基准下降 5%        | -4,584,850.57                   | -8,322,007.29            |

#### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | 87,147,732.84          |
| 第二层次          | 1,232,350.44           |
| 第三层次          | 2,383,138.44           |
| 合计            | 90,763,221.72          |

###### 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              | 90,741,221.28 | 98.62        |
|    | 其中：股票             | 90,741,221.28 | 98.62        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 22,000.44     | 0.02         |
|    | 其中：债券             | 22,000.44     | 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      | 1,188,427.16  | 1.29         |
| 8  | 其他各项资产            | 60,492.63     | 0.07         |
| 9  | 合计                | 92,012,141.51 | 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              | 61,973,495.51 | 67.61 |
| 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  | 13,020,057.25 | 14.21 |
| J | 金融业              | -             | -     |
| K | 房地产业             | -             | -     |
| L | 租赁和商务服务业         | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业       | 1,036,750.28  | 1.13  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 40,992.12     | 0.04  |
| 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               | 76,071,295.16 | 82.99 |

#### 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<br>（%） |
|----|------------------|---------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -                |
| B  | 采矿业              | 407,264.00    | 0.44             |
| C  | 制造业              | 12,005,219.49 | 13.10            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,110.00     | 0.01             |
| E  | 建筑业              | 320,201.00    | 0.35             |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| F | 批发和零售业          | 514,161.00    | 0.56  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 89,271.00     | 0.10  |
| H | 住宿和餐饮业          | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 345,632.20    | 0.38  |
| J | 金融业             | 479,332.00    | 0.52  |
| 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   | 146,400.00    | 0.16  |
| 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       | 352,335.43    | 0.38  |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 14,669,926.12 | 16.01 |

### 7.3 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

#### 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<br>（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|------------------|
| 1  | 688256 | 寒武纪  | 3,334  | 5,319,563.70 | 5.80             |
| 2  | 688041 | 海光信息 | 12,055 | 4,463,966.50 | 4.87             |
| 3  | 688012 | 中微公司 | 5,212  | 2,441,822.00 | 2.66             |
| 4  | 688795 | 摩尔线程 | 2,833  | 1,994,774.87 | 2.18             |
| 5  | 688008 | 澜起科技 | 5,867  | 1,818,183.30 | 1.98             |
| 6  | 688981 | 中芯国际 | 10,940 | 1,737,490.80 | 1.90             |
| 7  | 688802 | 沐曦股份 | 1,919  | 1,553,921.11 | 1.70             |
| 8  | 688498 | 源杰科技 | 768    | 1,448,448.00 | 1.58             |
| 9  | 688525 | 佰维存储 | 2,720  | 1,345,665.60 | 1.47             |
| 10 | 688521 | 芯原股份 | 3,276  | 1,215,854.64 | 1.33             |
| 11 | 688072 | 拓荆科技 | 1,395  | 1,160,640.00 | 1.27             |
| 12 | 688200 | 华峰测控 | 1,838  | 965,133.80   | 1.05             |
| 13 | 688146 | 中船特气 | 2,623  | 918,023.77   | 1.00             |
| 14 | 688082 | 盛美上海 | 2,111  | 911,952.00   | 0.99             |
| 15 | 688766 | 普冉股份 | 1,122  | 860,125.20   | 0.94             |
| 16 | 688702 | 盛科通信 | 2,158  | 841,598.42   | 0.92             |
| 17 | 688361 | 中科飞测 | 1,692  | 727,560.00   | 0.79             |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 18 | 688409 | 富创精密 | 2,374  | 727,037.50 | 0.79 |
| 19 | 688347 | 华虹宏力 | 2,131  | 716,655.30 | 0.78 |
| 20 | 688627 | 精智达  | 983    | 702,845.00 | 0.77 |
| 21 | 688172 | 燕东微  | 8,006  | 669,781.96 | 0.73 |
| 22 | 688120 | 华海清科 | 2,002  | 645,004.36 | 0.70 |
| 23 | 688629 | 华丰科技 | 3,396  | 636,783.96 | 0.69 |
| 24 | 688126 | 沪硅产业 | 15,577 | 621,366.53 | 0.68 |
| 25 | 688396 | 华润微  | 6,151  | 600,030.05 | 0.65 |
| 26 | 688183 | 生益电子 | 4,473  | 592,225.20 | 0.65 |
| 27 | 688506 | 百利天恒 | 1,864  | 548,071.92 | 0.60 |
| 28 | 688111 | 金山办公 | 2,500  | 532,625.00 | 0.58 |
| 29 | 688037 | 芯源微  | 1,212  | 532,128.60 | 0.58 |
| 30 | 688147 | 微导纳米 | 3,279  | 530,804.52 | 0.58 |
| 31 | 688048 | 长光华芯 | 1,037  | 520,574.00 | 0.57 |
| 32 | 688187 | 时代电气 | 7,390  | 507,397.40 | 0.55 |
| 33 | 688469 | 芯联集成 | 47,815 | 507,317.15 | 0.55 |
| 34 | 688313 | 仕佳光子 | 2,708  | 500,032.20 | 0.55 |
| 35 | 688300 | 联瑞新材 | 2,031  | 496,376.40 | 0.54 |
| 36 | 688249 | 晶合集成 | 8,395  | 495,556.85 | 0.54 |
| 37 | 688668 | 鼎通科技 | 1,290  | 481,557.00 | 0.53 |
| 38 | 688519 | 南亚新材 | 1,238  | 470,489.52 | 0.51 |
| 39 | 688110 | 东芯股份 | 2,159  | 439,788.30 | 0.48 |
| 40 | 688002 | 睿创微纳 | 2,738  | 423,541.22 | 0.46 |
| 41 | 688019 | 安集科技 | 1,191  | 404,296.86 | 0.44 |
| 42 | 688141 | 杰华特  | 2,578  | 395,723.00 | 0.43 |
| 43 | 688502 | 茂莱光学 | 560    | 388,416.00 | 0.42 |
| 44 | 688017 | 绿的谐波 | 902    | 376,909.72 | 0.41 |
| 45 | 688676 | 金盘科技 | 4,341  | 367,422.24 | 0.40 |
| 46 | 688234 | 天岳先进 | 2,085  | 361,768.35 | 0.39 |
| 47 | 688630 | 芯碁微装 | 642    | 352,708.38 | 0.38 |
| 48 | 688268 | 华特气体 | 1,302  | 348,285.00 | 0.38 |
| 49 | 688388 | 嘉元科技 | 7,818  | 343,992.00 | 0.38 |
| 50 | 688559 | 海目星  | 4,013  | 336,770.96 | 0.37 |
| 51 | 688025 | 杰普特  | 708    | 332,760.00 | 0.36 |
| 52 | 688167 | 炬光科技 | 934    | 330,832.14 | 0.36 |
| 53 | 688205 | 德科立  | 1,587  | 330,397.53 | 0.36 |
| 54 | 688362 | 甬矽电子 | 3,345  | 322,458.00 | 0.35 |
| 55 | 688220 | 翱捷科技 | 2,561  | 318,383.52 | 0.35 |
| 56 | 688343 | 云天励飞 | 3,834  | 313,084.44 | 0.34 |
| 57 | 688411 | 海博思创 | 1,016  | 295,859.20 | 0.32 |
| 58 | 688400 | 凌云光  | 4,410  | 291,942.00 | 0.32 |
| 59 | 688195 | 腾景科技 | 1,503  | 289,447.74 | 0.32 |
| 60 | 688322 | 奥比中光 | 2,215  | 289,168.25 | 0.32 |
| 61 | 688233 | 神工股份 | 1,340  | 287,322.80 | 0.31 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 62  | 688432 | 有研硅  | 7,046  | 281,628.62 | 0.31 |
| 63  | 688615 | 合合信息 | 2,451  | 277,208.10 | 0.30 |
| 64  | 688387 | 信科移动 | 13,836 | 274,506.24 | 0.30 |
| 65  | 688271 | 联影医疗 | 2,683  | 271,600.09 | 0.30 |
| 66  | 688318 | 财富趋势 | 3,808  | 271,548.48 | 0.30 |
| 67  | 688390 | 固德威  | 2,494  | 270,623.94 | 0.30 |
| 68  | 688800 | 瑞可达  | 2,784  | 267,180.48 | 0.29 |
| 69  | 688006 | 杭可科技 | 7,306  | 267,034.30 | 0.29 |
| 70  | 688375 | 国博电子 | 2,523  | 263,148.90 | 0.29 |
| 71  | 688578 | 艾力斯  | 2,359  | 257,602.80 | 0.28 |
| 72  | 688449 | 联芸科技 | 2,902  | 250,471.62 | 0.27 |
| 73  | 688652 | 京仪装备 | 1,244  | 249,011.48 | 0.27 |
| 74  | 688359 | 三孚新科 | 1,215  | 241,104.60 | 0.26 |
| 75  | 688052 | 纳芯微  | 832    | 239,873.92 | 0.26 |
| 76  | 688336 | 三生国健 | 4,512  | 239,587.20 | 0.26 |
| 77  | 688001 | 华兴源创 | 2,740  | 234,818.00 | 0.26 |
| 78  | 688368 | 晶丰明源 | 1,078  | 233,408.56 | 0.25 |
| 79  | 688392 | 骄成超声 | 1,024  | 232,632.32 | 0.25 |
| 80  | 688059 | 华锐精密 | 1,159  | 231,463.89 | 0.25 |
| 81  | 688127 | 蓝特光学 | 2,352  | 229,555.20 | 0.25 |
| 82  | 688372 | 伟测科技 | 1,220  | 226,920.00 | 0.25 |
| 83  | 688027 | 国盾量子 | 443    | 223,276.43 | 0.24 |
| 84  | 688603 | 天承科技 | 1,063  | 221,050.85 | 0.24 |
| 85  | 688223 | 晶科能源 | 45,881 | 217,934.75 | 0.24 |
| 86  | 688777 | 中控技术 | 1,822  | 214,085.00 | 0.23 |
| 87  | 688331 | 荣昌生物 | 1,640  | 213,626.40 | 0.23 |
| 88  | 688663 | 新风光  | 2,348  | 207,704.08 | 0.23 |
| 89  | 688536 | 思瑞浦  | 569    | 207,167.21 | 0.23 |
| 90  | 688231 | 隆达股份 | 5,530  | 203,116.90 | 0.22 |
| 91  | 688733 | 壹石通  | 4,907  | 202,904.45 | 0.22 |
| 92  | 688503 | 聚和材料 | 1,525  | 202,367.50 | 0.22 |
| 93  | 688099 | 晶晨股份 | 1,960  | 201,684.00 | 0.22 |
| 94  | 688386 | 泛亚微透 | 2,223  | 199,714.32 | 0.22 |
| 95  | 688661 | 和林微纳 | 1,255  | 199,519.90 | 0.22 |
| 96  | 688403 | 汇成股份 | 4,983  | 197,825.10 | 0.22 |
| 97  | 688235 | 百济神州 | 774    | 197,068.14 | 0.22 |
| 98  | 688257 | 新锐股份 | 1,915  | 195,138.50 | 0.21 |
| 99  | 688248 | 南网科技 | 2,772  | 191,766.96 | 0.21 |
| 100 | 688433 | 华曙高科 | 2,232  | 191,059.20 | 0.21 |
| 101 | 688692 | 达梦数据 | 782    | 191,034.78 | 0.21 |
| 102 | 688122 | 西部超导 | 3,039  | 190,879.59 | 0.21 |
| 103 | 688047 | 龙芯中科 | 1,221  | 188,852.07 | 0.21 |
| 104 | 688499 | 利元亨  | 3,568  | 187,498.40 | 0.20 |
| 105 | 688003 | 天准科技 | 1,468  | 186,876.40 | 0.20 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 106 | 688123 | 聚辰股份 | 853    | 181,347.80 | 0.20 |
| 107 | 688531 | 日联科技 | 1,019  | 181,218.96 | 0.20 |
| 108 | 688617 | 惠泰医疗 | 998    | 181,196.88 | 0.20 |
| 109 | 688036 | 传音控股 | 3,029  | 178,559.55 | 0.19 |
| 110 | 688090 | 瑞松科技 | 1,664  | 177,132.80 | 0.19 |
| 111 | 688711 | 宏微科技 | 3,891  | 176,845.95 | 0.19 |
| 112 | 688535 | 华海诚科 | 945    | 176,715.00 | 0.19 |
| 113 | 688378 | 奥来德  | 2,787  | 172,794.00 | 0.19 |
| 114 | 688686 | 奥普特  | 999    | 168,221.61 | 0.18 |
| 115 | 688472 | 阿特斯  | 15,484 | 167,536.88 | 0.18 |
| 116 | 688719 | 爱科赛博 | 2,173  | 167,321.00 | 0.18 |
| 117 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,349  | 167,276.00 | 0.18 |
| 118 | 688281 | 华秦科技 | 3,270  | 164,252.10 | 0.18 |
| 119 | 688297 | 中无人机 | 3,946  | 163,956.30 | 0.18 |
| 120 | 688584 | 上海合晶 | 4,551  | 163,608.45 | 0.18 |
| 121 | 688155 | 先惠技术 | 2,002  | 161,941.78 | 0.18 |
| 122 | 688416 | 恒烁股份 | 1,152  | 161,280.00 | 0.18 |
| 123 | 688585 | 上纬新材 | 971    | 160,991.80 | 0.18 |
| 124 | 688097 | 博众精工 | 2,509  | 158,192.45 | 0.17 |
| 125 | 688518 | 联赢激光 | 4,983  | 153,974.70 | 0.17 |
| 126 | 688659 | 元琛科技 | 14,692 | 153,384.48 | 0.17 |
| 127 | 688510 | 航亚科技 | 6,413  | 153,142.44 | 0.17 |
| 128 | 688279 | 峰岹科技 | 682    | 153,068.08 | 0.17 |
| 129 | 688308 | 欧科亿  | 838    | 152,356.78 | 0.17 |
| 130 | 688258 | 卓易信息 | 1,285  | 152,323.90 | 0.17 |
| 131 | 688028 | 沃尔德  | 948    | 147,764.76 | 0.16 |
| 132 | 688598 | 金博股份 | 2,937  | 145,234.65 | 0.16 |
| 133 | 688778 | 厦钨新能 | 2,667  | 145,084.80 | 0.16 |
| 134 | 688625 | 呈和科技 | 1,716  | 144,847.56 | 0.16 |
| 135 | 688188 | 柏楚电子 | 1,354  | 144,471.80 | 0.16 |
| 136 | 688549 | 中巨芯  | 3,913  | 144,037.53 | 0.16 |
| 137 | 688376 | 美埃科技 | 1,231  | 143,165.30 | 0.16 |
| 138 | 688385 | 复旦微电 | 1,987  | 141,653.23 | 0.15 |
| 139 | 688275 | 万润新能 | 1,074  | 136,988.70 | 0.15 |
| 140 | 688352 | 颀中科技 | 5,633  | 136,205.94 | 0.15 |
| 141 | 688548 | 广钢气体 | 2,588  | 134,834.80 | 0.15 |
| 142 | 688596 | 正帆科技 | 1,702  | 134,560.12 | 0.15 |
| 143 | 688775 | 影石创新 | 922    | 127,835.30 | 0.14 |
| 144 | 688020 | 方邦股份 | 504    | 125,798.40 | 0.14 |
| 145 | 688600 | 皖仪科技 | 3,766  | 125,332.48 | 0.14 |
| 146 | 688222 | 成都先导 | 3,873  | 124,362.03 | 0.14 |
| 147 | 688303 | 大全能源 | 7,103  | 123,805.29 | 0.14 |
| 148 | 688383 | 新益昌  | 639    | 120,157.56 | 0.13 |
| 149 | 688401 | 路维光电 | 1,237  | 118,727.26 | 0.13 |

|     |        |      |       |            |      |
|-----|--------|------|-------|------------|------|
| 150 | 688005 | 容百科技 | 3,836 | 117,381.60 | 0.13 |
| 151 | 688353 | 华盛锂电 | 1,007 | 116,882.49 | 0.13 |
| 152 | 688379 | 华光新材 | 1,374 | 115,457.22 | 0.13 |
| 153 | 688667 | 菱电电控 | 862   | 115,206.30 | 0.13 |
| 154 | 688035 | 德邦科技 | 1,253 | 115,025.40 | 0.13 |
| 155 | 688239 | 航宇科技 | 1,900 | 113,677.00 | 0.12 |
| 156 | 688150 | 莱特光电 | 1,650 | 113,223.00 | 0.12 |
| 157 | 688143 | 长盈通  | 640   | 112,563.20 | 0.12 |
| 158 | 688515 | 裕太微  | 449   | 111,693.24 | 0.12 |
| 159 | 688295 | 中复神鹰 | 1,831 | 110,848.74 | 0.12 |
| 160 | 688106 | 金宏气体 | 2,672 | 110,834.56 | 0.12 |
| 161 | 688700 | 东威科技 | 1,238 | 110,677.20 | 0.12 |
| 162 | 688131 | 皓元医药 | 1,160 | 109,736.00 | 0.12 |
| 163 | 688691 | 灿芯股份 | 913   | 105,844.09 | 0.12 |
| 164 | 688545 | 兴福电子 | 793   | 105,516.58 | 0.12 |
| 165 | 688312 | 燕麦科技 | 1,251 | 105,071.49 | 0.11 |
| 166 | 688226 | 威腾电气 | 2,441 | 104,548.03 | 0.11 |
| 167 | 688520 | 神州细胞 | 2,986 | 102,151.06 | 0.11 |
| 168 | 688158 | 优刻得  | 2,740 | 100,722.40 | 0.11 |
| 169 | 688484 | 南芯科技 | 1,760 | 99,422.40  | 0.11 |
| 170 | 688662 | 富信科技 | 586   | 98,448.00  | 0.11 |
| 171 | 688356 | 键凯科技 | 1,192 | 91,879.36  | 0.10 |
| 172 | 688170 | 德龙激光 | 947   | 90,921.47  | 0.10 |
| 173 | 688551 | 科威尔  | 1,280 | 89,945.60  | 0.10 |
| 174 | 688206 | 概伦电子 | 2,027 | 89,937.99  | 0.10 |
| 175 | 688456 | 有研粉材 | 634   | 88,506.40  | 0.10 |
| 176 | 688160 | 步科股份 | 802   | 87,233.54  | 0.10 |
| 177 | 688208 | 道通科技 | 3,417 | 86,074.23  | 0.09 |
| 178 | 688088 | 虹软科技 | 2,413 | 85,782.15  | 0.09 |
| 179 | 688100 | 威胜信息 | 2,790 | 85,346.10  | 0.09 |
| 180 | 688508 | 芯朋微  | 917   | 85,244.32  | 0.09 |
| 181 | 688180 | 君实生物 | 2,517 | 85,124.94  | 0.09 |
| 182 | 688478 | 晶升股份 | 952   | 84,299.60  | 0.09 |
| 183 | 688628 | 优利德  | 850   | 84,099.00  | 0.09 |
| 184 | 688018 | 乐鑫科技 | 654   | 83,659.68  | 0.09 |
| 185 | 688179 | 阿拉丁  | 3,019 | 83,656.49  | 0.09 |
| 186 | 688328 | 深科达  | 865   | 82,780.50  | 0.09 |
| 187 | 688419 | 耐科装备 | 1,052 | 82,739.80  | 0.09 |
| 188 | 688135 | 利扬芯片 | 1,963 | 82,603.04  | 0.09 |
| 189 | 688728 | 格科微  | 3,911 | 82,287.44  | 0.09 |
| 190 | 688475 | 萤石网络 | 2,972 | 81,284.20  | 0.09 |
| 191 | 688107 | 安路科技 | 1,780 | 81,168.00  | 0.09 |
| 192 | 688612 | 威迈斯  | 2,730 | 80,780.70  | 0.09 |
| 193 | 688717 | 艾罗能源 | 965   | 79,680.05  | 0.09 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 194 | 688190 | 云路股份 | 873    | 79,189.83 | 0.09 |
| 195 | 688698 | 伟创电气 | 1,496  | 78,465.20 | 0.09 |
| 196 | 688095 | 福昕软件 | 1,308  | 77,734.44 | 0.08 |
| 197 | 688690 | 纳微科技 | 1,751  | 77,219.10 | 0.08 |
| 198 | 688428 | 诺诚健华 | 2,708  | 77,096.76 | 0.08 |
| 199 | 688202 | 美迪西  | 953    | 76,916.63 | 0.08 |
| 200 | 688655 | 迅捷兴  | 1,429  | 76,537.24 | 0.08 |
| 201 | 688789 | 宏华数科 | 1,432  | 76,139.44 | 0.08 |
| 202 | 688332 | 中科蓝讯 | 465    | 73,237.50 | 0.08 |
| 203 | 688102 | 斯瑞新材 | 1,545  | 72,893.10 | 0.08 |
| 204 | 688321 | 微芯生物 | 2,751  | 72,433.83 | 0.08 |
| 205 | 688337 | 普源精电 | 961    | 72,007.73 | 0.08 |
| 206 | 688561 | 奇安信  | 3,000  | 71,940.00 | 0.08 |
| 207 | 688608 | 恒玄科技 | 427    | 71,390.13 | 0.08 |
| 208 | 688349 | 三一重能 | 4,608  | 69,949.44 | 0.08 |
| 209 | 688063 | 派能科技 | 1,301  | 69,304.27 | 0.08 |
| 210 | 688278 | 特宝生物 | 1,268  | 68,979.20 | 0.08 |
| 211 | 688621 | 阳光诺和 | 1,256  | 68,966.96 | 0.08 |
| 212 | 688112 | 鼎阳科技 | 937    | 68,832.02 | 0.08 |
| 213 | 688798 | 艾为电子 | 933    | 68,407.56 | 0.07 |
| 214 | 688720 | 艾森股份 | 669    | 67,569.00 | 0.07 |
| 215 | 688327 | 云从科技 | 5,414  | 67,458.44 | 0.07 |
| 216 | 688678 | 福立旺  | 2,776  | 67,095.92 | 0.07 |
| 217 | 688779 | 五矿新能 | 8,217  | 66,639.87 | 0.07 |
| 218 | 688238 | 和元生物 | 11,993 | 65,002.06 | 0.07 |
| 219 | 688611 | 杭州柯林 | 906    | 64,733.70 | 0.07 |
| 220 | 688563 | 航材股份 | 1,263  | 64,703.49 | 0.07 |
| 221 | 688582 | 芯动联科 | 985    | 64,025.00 | 0.07 |
| 222 | 688410 | 山外山  | 4,458  | 64,016.88 | 0.07 |
| 223 | 688192 | 迪哲医药 | 1,597  | 63,768.21 | 0.07 |
| 224 | 688443 | 智翔金泰 | 2,721  | 63,263.25 | 0.07 |
| 225 | 688306 | 均普智能 | 6,113  | 61,741.30 | 0.07 |
| 226 | 688665 | 四方光电 | 936    | 61,495.20 | 0.07 |
| 227 | 688262 | 国芯科技 | 1,416  | 61,213.68 | 0.07 |
| 228 | 688677 | 海泰新光 | 600    | 60,678.00 | 0.07 |
| 229 | 688593 | 新相微  | 1,541  | 59,975.72 | 0.07 |
| 230 | 688056 | 莱伯泰科 | 913    | 58,934.15 | 0.06 |
| 231 | 688799 | 华纳药厂 | 1,284  | 57,613.08 | 0.06 |
| 232 | 688191 | 智洋创新 | 1,610  | 57,477.00 | 0.06 |
| 233 | 688486 | 龙迅股份 | 895    | 56,904.10 | 0.06 |
| 234 | 688198 | 佰仁医疗 | 637    | 56,845.88 | 0.06 |
| 235 | 688115 | 思林杰  | 689    | 56,670.25 | 0.06 |
| 236 | 688319 | 欧林生物 | 1,276  | 56,118.48 | 0.06 |
| 237 | 688550 | 瑞联新材 | 964    | 55,767.40 | 0.06 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 238 | 688261 | 东微半导 | 525   | 55,088.25 | 0.06 |
| 239 | 688148 | 芳源股份 | 6,225 | 53,410.50 | 0.06 |
| 240 | 688787 | 海天瑞声 | 394   | 52,973.30 | 0.06 |
| 241 | 688685 | 迈信林  | 957   | 52,539.30 | 0.06 |
| 242 | 688568 | 中科星图 | 1,257 | 52,127.79 | 0.06 |
| 243 | 688737 | 中自科技 | 2,704 | 51,754.56 | 0.06 |
| 244 | 688277 | 天智航  | 2,984 | 51,026.40 | 0.06 |
| 245 | 688073 | 毕得医药 | 945   | 50,859.90 | 0.06 |
| 246 | 688316 | 青云科技 | 938   | 50,652.00 | 0.06 |
| 247 | 688708 | 佳驰科技 | 996   | 50,596.80 | 0.06 |
| 248 | 688699 | 明微电子 | 600   | 49,170.00 | 0.05 |
| 249 | 688581 | 安杰思  | 945   | 48,865.95 | 0.05 |
| 250 | 688185 | 康希诺  | 947   | 48,287.53 | 0.05 |
| 251 | 688556 | 高测股份 | 3,508 | 46,586.24 | 0.05 |
| 252 | 688010 | 福光股份 | 937   | 45,566.31 | 0.05 |
| 253 | 688227 | 品高股份 | 443   | 45,491.67 | 0.05 |
| 254 | 688648 | 中邮科技 | 1,232 | 45,029.60 | 0.05 |
| 255 | 688166 | 博瑞医药 | 1,271 | 44,497.71 | 0.05 |
| 256 | 688365 | 光云科技 | 2,786 | 43,935.22 | 0.05 |
| 257 | 688252 | 天德钰  | 1,797 | 43,128.00 | 0.05 |
| 258 | 688512 | 慧智微  | 2,657 | 42,432.29 | 0.05 |
| 259 | 688068 | 热景生物 | 489   | 42,347.40 | 0.05 |
| 260 | 688305 | 科德数控 | 636   | 41,511.72 | 0.05 |
| 261 | 688653 | 康希通信 | 2,387 | 41,486.06 | 0.05 |
| 262 | 688480 | 赛恩斯  | 468   | 40,992.12 | 0.04 |
| 263 | 688260 | 昀冢科技 | 275   | 39,600.00 | 0.04 |
| 264 | 688513 | 苑东生物 | 896   | 39,388.16 | 0.04 |
| 265 | 688707 | 振华新材 | 3,035 | 38,999.75 | 0.04 |
| 266 | 688393 | 安必平  | 2,184 | 38,831.52 | 0.04 |
| 267 | 688293 | 奥浦迈  | 925   | 38,563.25 | 0.04 |
| 268 | 688029 | 南微医学 | 529   | 37,982.20 | 0.04 |
| 269 | 688776 | 国光电气 | 600   | 36,804.00 | 0.04 |
| 270 | 688232 | 新点软件 | 2,065 | 36,715.70 | 0.04 |
| 271 | 688709 | 成都华微 | 945   | 35,995.05 | 0.04 |
| 272 | 688023 | 安恒信息 | 974   | 35,765.28 | 0.04 |
| 273 | 688209 | 英集芯  | 1,214 | 35,303.12 | 0.04 |
| 274 | 688039 | 当虹科技 | 945   | 35,267.40 | 0.04 |
| 275 | 688560 | 明冠新材 | 2,950 | 34,957.50 | 0.04 |
| 276 | 688577 | 浙海德曼 | 732   | 33,547.56 | 0.04 |
| 277 | 688391 | 钜泉科技 | 932   | 33,430.84 | 0.04 |
| 278 | 688182 | 灿勤科技 | 775   | 33,379.25 | 0.04 |
| 279 | 688558 | 国盛智科 | 999   | 32,827.14 | 0.04 |
| 280 | 688139 | 海尔生物 | 1,241 | 32,787.22 | 0.04 |
| 281 | 688087 | 英科再生 | 974   | 32,551.08 | 0.04 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 282 | 688523 | 航天环宇 | 617   | 32,330.80 | 0.04 |
| 283 | 688772 | 珠海冠宇 | 1,631 | 32,016.53 | 0.03 |
| 284 | 688229 | 博睿数据 | 409   | 31,370.30 | 0.03 |
| 285 | 688283 | 坤恒顺维 | 945   | 31,288.95 | 0.03 |
| 286 | 688697 | 纽威数控 | 2,295 | 31,189.05 | 0.03 |
| 287 | 688009 | 中国通号 | 6,549 | 31,173.24 | 0.03 |
| 288 | 688651 | 盛邦安全 | 954   | 30,737.88 | 0.03 |
| 289 | 688081 | 兴图新科 | 720   | 29,433.60 | 0.03 |
| 290 | 688579 | 地纬智能 | 3,748 | 28,447.32 | 0.03 |
| 291 | 688543 | 国科军工 | 720   | 28,404.00 | 0.03 |
| 292 | 688516 | 奥特维  | 444   | 25,481.16 | 0.03 |
| 293 | 688726 | 拉普拉斯 | 471   | 24,892.35 | 0.03 |
| 294 | 688658 | 悦康药业 | 1,923 | 24,729.78 | 0.03 |
| 295 | 688050 | 爱博医疗 | 600   | 21,870.00 | 0.02 |
| 296 | 688636 | 智明达  | 600   | 21,738.00 | 0.02 |
| 297 | 688357 | 建龙微纳 | 691   | 20,363.77 | 0.02 |
| 298 | 688369 | 致远互联 | 943   | 19,812.43 | 0.02 |
| 299 | 688058 | 宝兰德  | 928   | 19,413.76 | 0.02 |
| 300 | 688339 | 亿华通  | 987   | 18,456.90 | 0.02 |
| 301 | 688207 | 格灵深瞳 | 915   | 18,391.50 | 0.02 |
| 302 | 688345 | 博力威  | 302   | 17,540.16 | 0.02 |
| 303 | 688501 | 青达环保 | 840   | 16,128.00 | 0.02 |
| 304 | 688687 | 凯因科技 | 982   | 16,016.42 | 0.02 |
| 305 | 688567 | 孚能科技 | 1,502 | 15,771.00 | 0.02 |
| 306 | 688186 | 广大特材 | 986   | 14,937.90 | 0.02 |
| 307 | 688330 | 宏力达  | 439   | 14,851.37 | 0.02 |
| 308 | 688590 | 新致软件 | 960   | 11,932.80 | 0.01 |
| 309 | 688588 | 凌志软件 | 1,264 | 11,489.76 | 0.01 |
| 310 | 688639 | 华恒生物 | 215   | 3,470.10  | 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<br>比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|------------------|
| 1  | 688783 | 西安奕材 | 14,215 | 816,225.30 | 0.89             |
| 2  | 002384 | 东山精密 | 900    | 236,115.00 | 0.26             |
| 3  | 603678 | 火炬电子 | 2,800  | 232,400.00 | 0.25             |
| 4  | 688759 | 必贝特  | 7,235  | 221,752.75 | 0.24             |
| 5  | 301235 | 华康洁净 | 2,900  | 217,529.00 | 0.24             |
| 6  | 301308 | 江波龙  | 300    | 211,140.00 | 0.23             |
| 7  | 300726 | 宏达电子 | 2,400  | 202,968.00 | 0.22             |
| 8  | 002487 | 大金重工 | 3,500  | 202,895.00 | 0.22             |
| 9  | 002364 | 中恒电气 | 3,600  | 193,680.00 | 0.21             |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 10 | 001309 | 德明利  | 200    | 188,580.00 | 0.21 |
| 11 | 605060 | 联德股份 | 3,200  | 181,568.00 | 0.20 |
| 12 | 000021 | 深科技  | 2,800  | 179,956.00 | 0.20 |
| 13 | 300693 | 盛弘股份 | 3,500  | 170,625.00 | 0.19 |
| 14 | 603950 | 长源东谷 | 2,000  | 168,860.00 | 0.18 |
| 15 | 301205 | 联特科技 | 500    | 167,050.00 | 0.18 |
| 16 | 300547 | 川环科技 | 4,900  | 163,611.00 | 0.18 |
| 17 | 603986 | 兆易创新 | 200    | 163,000.00 | 0.18 |
| 18 | 605117 | 德业股份 | 1,500  | 159,270.00 | 0.17 |
| 19 | 605100 | 华丰股份 | 3,940  | 159,254.80 | 0.17 |
| 20 | 601166 | 兴业银行 | 9,500  | 157,320.00 | 0.17 |
| 21 | 002636 | 金安国纪 | 1,300  | 155,961.00 | 0.17 |
| 22 | 002735 | 王子新材 | 9,500  | 154,185.00 | 0.17 |
| 23 | 300870 | 欧陆通  | 440    | 152,103.60 | 0.17 |
| 24 | 002885 | 京泉华  | 3,700  | 151,182.00 | 0.16 |
| 25 | 603308 | 应流股份 | 2,500  | 151,000.00 | 0.16 |
| 26 | 000534 | 万泽股份 | 5,500  | 150,480.00 | 0.16 |
| 27 | 300475 | 香农芯创 | 500    | 150,000.00 | 0.16 |
| 28 | 000880 | 潍柴重机 | 6,500  | 149,565.00 | 0.16 |
| 29 | 300223 | 北京君正 | 600    | 149,340.00 | 0.16 |
| 30 | 000338 | 潍柴动力 | 5,400  | 147,150.00 | 0.16 |
| 31 | 300990 | 同飞股份 | 1,400  | 147,098.00 | 0.16 |
| 32 | 300816 | 艾可蓝  | 2,000  | 146,400.00 | 0.16 |
| 33 | 605589 | 圣泉集团 | 2,300  | 146,211.00 | 0.16 |
| 34 | 600096 | 云天化  | 4,700  | 142,880.00 | 0.16 |
| 35 | 002536 | 飞龙股份 | 3,000  | 141,540.00 | 0.15 |
| 36 | 601126 | 四方股份 | 2,200  | 139,040.00 | 0.15 |
| 37 | 300548 | 长芯博创 | 500    | 139,000.00 | 0.15 |
| 38 | 600183 | 生益科技 | 800    | 138,720.00 | 0.15 |
| 39 | 002916 | 深南电路 | 300    | 137,370.00 | 0.15 |
| 40 | 002353 | 杰瑞股份 | 900    | 137,250.00 | 0.15 |
| 41 | 601208 | 东材科技 | 1,900  | 134,501.00 | 0.15 |
| 42 | 603083 | 剑桥科技 | 500    | 127,435.00 | 0.14 |
| 43 | 300308 | 中际旭创 | 100    | 127,000.00 | 0.14 |
| 44 | 300593 | 新雷能  | 4,200  | 126,252.00 | 0.14 |
| 45 | 300757 | 罗博特科 | 200    | 123,800.00 | 0.14 |
| 46 | 600585 | 海螺水泥 | 7,300  | 123,735.00 | 0.13 |
| 47 | 000404 | 长虹华意 | 15,000 | 117,900.00 | 0.13 |
| 48 | 601877 | 正泰电器 | 4,600  | 115,322.00 | 0.13 |
| 49 | 300491 | 通合科技 | 3,000  | 114,570.00 | 0.12 |
| 50 | 300499 | 高澜股份 | 2,956  | 114,397.20 | 0.12 |
| 51 | 600938 | 中国海油 | 4,200  | 114,030.00 | 0.12 |
| 52 | 603186 | 华正新材 | 500    | 112,650.00 | 0.12 |
| 53 | 601225 | 陕西煤业 | 5,500  | 111,925.00 | 0.12 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 54 | 002922 | 伊戈尔  | 3,400  | 111,520.00 | 0.12 |
| 55 | 603558 | 健盛集团 | 9,900  | 109,791.00 | 0.12 |
| 56 | 601801 | 皖新传媒 | 22,200 | 109,446.00 | 0.12 |
| 57 | 002697 | 红旗连锁 | 26,000 | 108,160.00 | 0.12 |
| 58 | 601577 | 长沙银行 | 12,400 | 108,004.00 | 0.12 |
| 59 | 601818 | 光大银行 | 37,200 | 107,508.00 | 0.12 |
| 60 | 600036 | 招商银行 | 3,000  | 106,500.00 | 0.12 |
| 61 | 002580 | 圣阳股份 | 5,200  | 104,832.00 | 0.11 |
| 62 | 002706 | 良信股份 | 9,600  | 104,736.00 | 0.11 |
| 63 | 600970 | 中材国际 | 14,400 | 102,672.00 | 0.11 |
| 64 | 601001 | 晋控煤业 | 5,900  | 102,601.00 | 0.11 |
| 65 | 301171 | 易点天下 | 2,910  | 98,823.60  | 0.11 |
| 66 | 601339 | 百隆东方 | 14,500 | 98,165.00  | 0.11 |
| 67 | 603191 | 望变电气 | 6,200  | 97,898.00  | 0.11 |
| 68 | 003026 | 中晶科技 | 2,100  | 95,781.00  | 0.10 |
| 69 | 600552 | 凯盛科技 | 2,900  | 94,482.00  | 0.10 |
| 70 | 002091 | 江苏国泰 | 13,000 | 93,990.00  | 0.10 |
| 71 | 002315 | 焦点科技 | 4,020  | 93,585.60  | 0.10 |
| 72 | 600707 | 彩虹股份 | 5,400  | 91,206.00  | 0.10 |
| 73 | 603936 | 博敏电子 | 3,400  | 90,814.00  | 0.10 |
| 74 | 002533 | 金杯电工 | 8,400  | 89,628.00  | 0.10 |
| 75 | 603565 | 中谷物流 | 9,100  | 89,271.00  | 0.10 |
| 76 | 600367 | 红星发展 | 1,400  | 88,102.00  | 0.10 |
| 77 | 002733 | 雄韬股份 | 2,800  | 86,744.00  | 0.09 |
| 78 | 601900 | 南方传媒 | 7,900  | 85,794.00  | 0.09 |
| 79 | 002335 | 科华数据 | 2,000  | 84,900.00  | 0.09 |
| 80 | 300243 | 瑞丰高材 | 3,900  | 84,786.00  | 0.09 |
| 81 | 300394 | 天孚通信 | 280    | 84,750.40  | 0.09 |
| 82 | 301086 | 鸿富瀚  | 400    | 83,712.00  | 0.09 |
| 83 | 605377 | 华旺科技 | 9,000  | 83,700.00  | 0.09 |
| 84 | 603368 | 柳药集团 | 5,700  | 83,619.00  | 0.09 |
| 85 | 002851 | 麦格米特 | 500    | 83,590.00  | 0.09 |
| 86 | 301486 | 致尚科技 | 400    | 83,328.00  | 0.09 |
| 87 | 002741 | 光华科技 | 2,300  | 82,202.00  | 0.09 |
| 88 | 600380 | 健康元  | 8,700  | 81,954.00  | 0.09 |
| 89 | 000719 | 中原传媒 | 6,901  | 78,878.43  | 0.09 |
| 90 | 601958 | 金钼股份 | 2,800  | 78,708.00  | 0.09 |
| 91 | 600710 | 苏美达  | 8,200  | 78,392.00  | 0.09 |
| 92 | 600757 | 长江传媒 | 10,700 | 78,217.00  | 0.09 |
| 93 | 301373 | 凌玮科技 | 500    | 77,750.00  | 0.08 |
| 94 | 603681 | 永冠新材 | 3,400  | 77,690.00  | 0.08 |
| 95 | 688790 | 昂瑞微  | 609    | 77,008.05  | 0.08 |
| 96 | 300454 | 深信服  | 800    | 76,960.00  | 0.08 |
| 97 | 300576 | 容大感光 | 1,500  | 76,830.00  | 0.08 |

|     |        |       |       |           |      |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 98  | 002957 | 科瑞技术  | 1,400 | 76,776.00 | 0.08 |
| 99  | 300360 | 炬华科技  | 6,500 | 76,375.00 | 0.08 |
| 100 | 603861 | 白云电器  | 5,900 | 76,169.00 | 0.08 |
| 101 | 002203 | 海亮股份  | 3,300 | 75,405.00 | 0.08 |
| 102 | 301630 | 同宇新材  | 300   | 75,048.00 | 0.08 |
| 103 | 300442 | 润泽科技  | 900   | 74,763.00 | 0.08 |
| 104 | 301526 | 国际复材  | 1,600 | 74,672.00 | 0.08 |
| 105 | 003036 | 泰坦股份  | 800   | 73,992.00 | 0.08 |
| 106 | 301188 | 力诺药包  | 1,100 | 73,590.00 | 0.08 |
| 107 | 002270 | 华明装备  | 3,900 | 73,515.00 | 0.08 |
| 108 | 605006 | 山东玻纤  | 3,400 | 71,706.00 | 0.08 |
| 109 | 002975 | 博杰股份  | 500   | 71,000.00 | 0.08 |
| 110 | 002378 | 章源钨业  | 2,100 | 70,308.00 | 0.08 |
| 111 | 600869 | 远东股份  | 2,100 | 70,287.00 | 0.08 |
| 112 | 605198 | 安德利   | 1,100 | 69,696.00 | 0.08 |
| 113 | 300400 | 劲拓股份  | 1,800 | 67,770.00 | 0.07 |
| 114 | 300395 | 菲利华   | 500   | 66,865.00 | 0.07 |
| 115 | 603773 | 沃格光电  | 400   | 65,188.00 | 0.07 |
| 116 | 301338 | 凯格精机  | 400   | 65,156.00 | 0.07 |
| 117 | 002112 | 三变科技  | 3,700 | 60,643.00 | 0.07 |
| 118 | 301511 | 德福科技  | 400   | 57,540.00 | 0.06 |
| 119 | 301397 | 溯联股份  | 1,600 | 51,776.00 | 0.06 |
| 120 | 688781 | 视涯科技  | 951   | 40,094.16 | 0.04 |
| 121 | 688808 | 联讯仪器  | 24    | 38,023.92 | 0.04 |
| 122 | 688818 | 电科蓝天  | 371   | 26,021.94 | 0.03 |
| 123 | 002518 | 科士达   | 400   | 21,436.00 | 0.02 |
| 124 | 688820 | 盛合晶微  | 144   | 20,374.56 | 0.02 |
| 125 | 688712 | 北芯生命  | 542   | 19,468.64 | 0.02 |
| 126 | 688785 | 恒运昌   | 34    | 15,747.10 | 0.02 |
| 127 | 688813 | 泰金新能  | 77    | 13,250.93 | 0.01 |
| 128 | 688635 | 长进光子  | 38    | 11,711.22 | 0.01 |
| 129 | 001248 | 华润新能源 | 1,000 | 10,110.00 | 0.01 |
| 130 | 688811 | 有研复材  | 316   | 7,625.08  | 0.01 |
| 131 | 603459 | 红板科技  | 64    | 5,396.48  | 0.01 |
| 132 | 688816 | 易思维   | 48    | 2,740.80  | 0.00 |
| 133 | 601112 | 振石股份  | 129   | 2,269.11  | 0.00 |
| 134 | 603435 | 嘉德利   | 44    | 2,055.24  | 0.00 |
| 135 | 603352 | 至信股份  | 61    | 1,556.72  | 0.00 |
| 136 | 603881 | 数据港   | 60    | 1,500.00  | 0.00 |
| 137 | 603284 | 林平发展  | 25    | 871.75    | 0.00 |
| 138 | 603293 | 埃泰克   | 18    | 610.74    | 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  | 688795 | 摩尔线程 | 1,809,338.29 | 1.14           |
| 2  | 688802 | 沐曦股份 | 1,518,431.06 | 0.96           |
| 3  | 688041 | 海光信息 | 760,641.08   | 0.48           |
| 4  | 688187 | 时代电气 | 616,430.90   | 0.39           |
| 5  | 000534 | 万泽股份 | 614,128.00   | 0.39           |
| 6  | 688012 | 中微公司 | 610,835.52   | 0.39           |
| 7  | 301235 | 华康洁净 | 584,269.00   | 0.37           |
| 8  | 688702 | 盛科通信 | 545,284.24   | 0.34           |
| 9  | 688326 | 经纬恒润 | 532,840.65   | 0.34           |
| 10 | 688082 | 盛美上海 | 512,714.22   | 0.32           |
| 11 | 002487 | 大金重工 | 485,799.00   | 0.31           |
| 12 | 688396 | 华润微  | 477,575.30   | 0.30           |
| 13 | 688072 | 拓荆科技 | 476,016.00   | 0.30           |
| 14 | 688036 | 传音控股 | 470,165.26   | 0.30           |
| 15 | 688521 | 芯原股份 | 456,694.30   | 0.29           |
| 16 | 688506 | 百利天恒 | 454,076.10   | 0.29           |
| 17 | 000880 | 潍柴重机 | 426,647.00   | 0.27           |
| 18 | 688775 | 影石创新 | 415,367.55   | 0.26           |
| 19 | 688205 | 德科立  | 408,617.47   | 0.26           |
| 20 | 300443 | 金雷股份 | 398,287.00   | 0.25           |

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  | 688498 | 源杰科技 | 2,362,559.03 | 1.49           |
| 2  | 688041 | 海光信息 | 1,475,342.70 | 0.93           |
| 3  | 688256 | 寒武纪  | 1,398,067.35 | 0.88           |
| 4  | 688027 | 国盾量子 | 1,120,354.90 | 0.71           |
| 5  | 688375 | 国博电子 | 779,121.59   | 0.49           |
| 6  | 688031 | 星环科技 | 743,596.54   | 0.47           |
| 7  | 688568 | 中科星图 | 706,685.52   | 0.45           |
| 8  | 688326 | 经纬恒润 | 665,404.51   | 0.42           |
| 9  | 688502 | 茂莱光学 | 652,704.76   | 0.41           |
| 10 | 301171 | 易点天下 | 625,010.00   | 0.40           |
| 11 | 002384 | 东山精密 | 609,387.00   | 0.39           |
| 12 | 688099 | 晶晨股份 | 603,852.98   | 0.38           |
| 13 | 688981 | 中芯国际 | 586,301.43   | 0.37           |
| 14 | 002364 | 中恒电气 | 576,405.00   | 0.36           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 15 | 301235 | 华康洁净 | 566,004.00 | 0.36 |
| 16 | 688167 | 炬光科技 | 559,899.76 | 0.35 |
| 17 | 002922 | 伊戈尔  | 548,455.00 | 0.35 |
| 18 | 000977 | 浪潮信息 | 545,410.00 | 0.35 |
| 19 | 300870 | 欧陆通  | 538,218.00 | 0.34 |
| 20 | 688519 | 南亚新材 | 536,819.40 | 0.34 |

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 | 60,145,071.72 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 73,934,199.41 |

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

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） | 22,000.44 | 0.02         |
| 8  | 同业存单      | -         | -            |
| 9  | 其他        | -         | -            |
| 10 | 合计        | 22,000.44 | 0.02         |

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

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 | 118071 | 华峰转债 | 80 | 8,000.12 | 0.01 |
| 2 | 111025 | 圣泉转债 | 80 | 8,000.09 | 0.01 |
| 3 | 118070 | 南芯转债 | 60 | 6,000.23 | 0.01 |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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约定的备选股票库。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | -         |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | -         |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | 60,492.63 |
| 8  | 其他    | -         |

|   |    |           |
|---|----|-----------|
| 9 | 合计 | 60,492.63 |
|---|----|-----------|

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值 | 占基金资产净<br>值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|----------|
| 1  | 688795 | 摩尔线程 | 599,768.84      | 0.65             | 新股流通受限   |
| 2  | 688802 | 沐曦股份 | 460,565.11      | 0.50             | 新股流通受限   |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值 | 占基金资产净<br>值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|----------|
| 1  | 688783 | 西安奕材 | 816,225.30      | 0.89             | 新股流通受限   |
| 2  | 688759 | 必贝特  | 221,752.75      | 0.24             | 新股流通受限   |

§ 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<br>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<br>比例 | 持有份额          | 占总份额<br>比例 |
| 1,891    | 27,123.22     | 1,721,600.00 | 3.36%      | 49,568,400.00 | 96.64%     |

8.2 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% |
|------------------|------|---------|

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                 | 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<br>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（2025 年 8 月 27 日）基金份额总额 | 675,290,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 147,290,000.00 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 44,000,000.00  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 140,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              |
| 本报告期末基金份额总额                    | 51,290,000.00  |

§ 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 2026 年 1 月 5 日发布公告，自 2026 年 1 月 3 日起高松凡先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况****10.6.1 管理人受调查或处罚等情况**

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

**10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况**

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

**10.6.3 托管人受调查或处罚等情况**

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

**10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况**

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

**10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况****10.7.1 基金租用或者通过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 |    |
| 广发证券 | 6      | 133,748,151.08 | 100.00%      | 13,375.78 | 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广发证券股份有限公司。广发证券股份有限公司系本基金管理人的股东。

c）本报告期本基金的平均佣金费率为：股票 0.01000%、债券 0.00010%。

d）本基金管理人负责选择证券经营机构，本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

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

e）本报告期内基金的证券经营机构的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用的证券经营机构。

2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过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 |
| 广发证券 | 108,952.31 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                          | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|-----------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 1  | 易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告                         | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-01-05 |
| 2  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告           | 上海证券报                       | 2026-01-22 |
| 3  | 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（2025 年度）   | 基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站       | 2026-03-31 |
| 4  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告               | 上海证券报                       | 2026-03-31 |
| 5  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告           | 上海证券报                       | 2026-04-22 |
| 6  | 2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露 | 基金管理人网站                     | 2026-04-30 |
| 7  | 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                    | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-05-16 |
| 8  | 易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告           | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-15 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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.《易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达上证科创板综合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。

### 12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

### 12.3 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

二〇二六年八月三十一日