易方达上证综合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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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 30 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遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 9
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 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
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 11
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 13
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 40
7.1 期末基金资产组合情况 40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 60
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 61
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 61
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 61
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 61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 61

7.12 投资组合报告附注 61
§8 基金份额持有人信息 63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 63
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 63
§9 开放式基金份额变动 63
§10 重大事件揭示 64
10.1 基金份额持有人大会决议 64
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 64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 64
10.4 基金投资策略的改变 64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 64
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 64
10.8 其他重大事件 65
§11 影响投资者决策的其他重要信息 66
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 66
§12 备查文件目录 66
12.1 备查文件目录 66
12.2 存放地点 66
12.3 查阅方式 66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达上证综合 ETF
场内简称	上证综 E、上证指数 ETF 易方达
基金主代码	530060
交易代码	530060
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2026 年 1 月 30 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	258,193,000.00 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	2026 年 2 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人可根据基金运作及指数情况决定本基金采用抽样复制投资策略或完全复制投资策略。本基金目前采用抽样复制投资策略。本基金采用抽样复制投资策略时，基金管理人将依托指数投资平台，综合考虑指数成份股构成、代表性、相关性、流动性等因素，构建指数化投资组合，追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金采用完全复制投资策略时，将完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	上证综合指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人

名称		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510627；510623；519031	100818
法定代表人		吴欣荣	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告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 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	10,564,090.69
本期利润	16,358,874.96
加权平均基金份额本期利润	0.0977
本期加权平均净值利润率	9.77%
本期基金份额净值增长率	2.16%
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	5,565,028.65
期末可供分配基金份额利润	0.0216
期末基金资产净值	263,758,028.65
期末基金份额净值	1.0216

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	2.16%

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

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

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

4.本基金合同于 2026 年 1 月 30 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

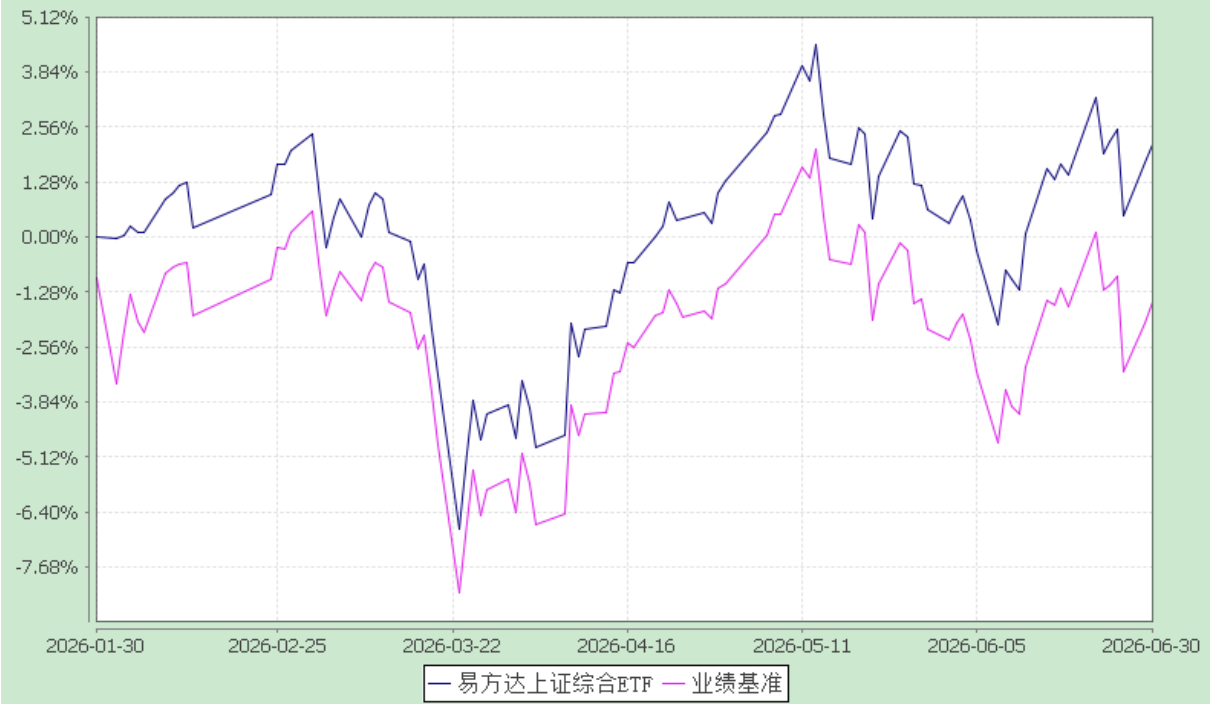
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	7.18%	0.91%	5.20%	0.94%	1.98%	-0.03%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.16%	0.94%	-1.53%	1.01%	3.69%	-0.07%

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

易方达上证综合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

（2026 年 1 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：1.本基金合同于 2026 年 1 月 30 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII 等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
聂启文	本基金的基金经理，易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达深证 50ETF 联接发起式、易方达中证	2026-01-30	-	4 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。

	内地低碳经济主题 ETF、易方达中证全指建筑材料 ETF、易方达中证物联网主题 ETF 联接发起式、易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证国有企业改革指数（LOF）、易方达中证现代农业主题 ETF、易方达恒生 A 股电网设备 ETF、易方达中证全指电力公用事业 ETF 的基金经理，易方达中证 2000ETF、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式、易方达黄金股指数发起式、易方达恒生港股通新经济 ETF、易方达上证科创板 100ETF、易方达中证 A50 增强策略 ETF、易方达深证 50ETF、易方达中证全指食品 ETF、易方达中证畜牧养殖产业 ETF、易方达国证粮食产业 ETF、易方达中证全指可选消费指数发起式的基金经理助理				

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。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 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

本基金跟踪上证综合指数，该指数由在上海证券交易所上市的符合条件的股票与存托凭证组成样本，反映上海证券交易所上市公司的整体表现。报告期内本基金主要采用抽样复制投资策略，基金管理人依托指数投资平台，综合考虑指数成份股构成、代表性、相关性、流动性等因素，构建指数化投资组合，追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，以达到紧密跟踪标的指数的目的。

2026 年上半年，中东地缘冲突推高能源价格，国际贸易环境更趋复杂，经济运行面临的外部挑战明显增多。承压之下，中国经济总体保持平稳，上半年国内生产总值按不变价格计算同比增长 4.7%，落在全年 4.5%至 5%的预期目标区间内。从供给端看，产业升级持续推进，规模以上工业增加值同比增长 5.4%，其中高技术制造业增长 13.3%，明显快于整体工业水平；以高端制造、数字经济为代表的新动能成为拉动增长的主要引擎。从需求侧看，货物出口同比增长 13.4%，外贸竞争力彰显；消费温和复苏，投资结构进一步向高技术领域倾斜。物价方面，居民消费价格和工业生产者出厂价格温和上涨，价格形势出现积极变化。政策端，更加积极有为的宏观政策落地见效，重点投向科技创新、新动能培育与扩大内需。总体看，尽管外部环境复杂，中国经济依靠新动能的快速成长和增长动力的接续转换，实现了量的合理增长与质的稳步提升。

证券市场方面，2026 年上半年 A 股呈现宽幅震荡、中枢逐步抬升的走势。流动性总体充裕，上市公司分红与回购力度加大，为市场提供了有力支撑。行业表现分化明显，算力需求扩张带动相关产业链持续活跃，成为上半年最主要的结构性主线。二季度，中东地缘局势一度压制全球风险偏好，市场出现明显调整，但随着外部冲击逐步消化，叠加企业盈利改善，市场回撤得到修复。2026 年上半年，上证综合指数上涨 3.16%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0216 元，本报告期份额净值增长率为 2.16%，同期业绩比

较基准收益率为-1.53%。受建仓期影响，年化跟踪误差 5.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，中国经济正处在新旧动能深度转换的关键期，高质量发展主线贯穿始终，经济运行有望在平稳基础上继续向上修复。以人工智能、商业航天、低空经济、新能源等为代表的新质生产力加速成长，战略性新兴产业扩容与传统产业智能化、绿色化改造协同并进，持续释放强劲动能。消费结构升级与制造业投资回暖相互呼应，内需作为经济增长压舱石的作用更加凸显。尽管外部环境复杂多变，但中国经济基础稳固、韧性充足，长期向好的基本面没有改变。随着政策效应持续释放、新动能不断积蓄，中国经济有望在应对挑战中实现质的有效提升和量的合理增长。上证综合指数作为反映上海证券交易所整体表现的宽基指数，代表了其核心上市公司群体的整体状况。指数短期表现受宏观经济周期、市场情绪与政策变化影响较大，但长期趋势基本能够反映中国经济的持续增长。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§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：易方达上证综合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 2026 年 6 月 30 日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	6,863,845.06
结算备付金		1,377,613.02
存出保证金		631,564.80
交易性金融资产	6.4.7.2	255,324,143.60
其中：股票投资		255,265,140.91
基金投资		-
债券投资		59,002.69
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	65,714.72
资产总计		264,262,881.20
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		276,374.32
应付赎回款		-
应付管理人报酬		28,515.00
应付托管费		9,504.97
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		811.02
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	189,647.24
负债合计		504,852.55
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	258,193,000.00
未分配利润	6.4.7.8	5,565,028.65
净资产合计		263,758,028.65
负债和净资产总计		264,262,881.20

注：1.本基金合同生效日为 2026 年 1 月 30 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 1 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0216 元，基金份额总额 258,193,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,566,047.09
1.利息收入		36,791.43
其中：存款利息收入	6.4.7.9	36,791.43
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）		10,574,304.55
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,704,533.91
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	25,318.20
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	227,241.53
股利收益	6.4.7.14	1,617,210.91
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	5,794,784.27
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	160,166.84
减：二、营业总支出		207,172.13
1．管理人报酬		102,812.92
2．托管费		34,271.00
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		820.32
8．其他费用	6.4.7.18	69,267.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**16,358,874.96**
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**16,358,874.96**
五、其他综合收益的税后净额		**-**
六、综合收益总额		**16,358,874.96**

注：本基金合同生效日为 2026 年 1 月 30 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 1 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均

无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	321,193,000.00	-	321,193,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-63,000,000.00	5,565,028.65	-57,434,971.35
（一）、综合收益总额	-	16,358,874.96	16,358,874.96
（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）	-63,000,000.00	-10,793,846.31	-73,793,846.31
其中：1.基金申购款	531,000,000.00	-6,592,787.55	524,407,212.45
2.基金赎回款	-594,000,000.00	-4,201,058.76	-598,201,058.76
（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	258,193,000.00	5,565,028.65	263,758,028.65

注：本基金合同生效日为 2026 年 1 月 30 日，2026 年半年度实际报告期间为 2026 年 1 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达上证综合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]3060 号《关于准予易方达上证综合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《易方达上证综合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，《易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2026 年 1 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 321,193,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2026 年 1 月 21 日至 2026 年 1 月 27 日，募集金额总额为人民币 321,204,820.76 元，其中：有效净认购金额为人民币 321,193,000.00 元，有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币 11,820.76 元，经安永华明(2026)验字第 70013033_G05 号验资报告予以审验。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止，惟本会计年度期间为 2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金收益分配方式采用现金分红；

2、每一基金份额享有同等分配权；

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

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

（2）当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人履行适当程序后可调整基金收益的分配原则；

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

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部 税务总局公告 2021 年第 33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、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、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，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%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前

已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,020,001.35
等于：本金	2,019,926.68
加：应计利息	74.67
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	4,843,843.71
等于：本金	4,843,322.19

加：应计利息	521.52
合计	6,863,845.06

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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		249,591,356.64	-	255,265,140.91	5,673,784.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	58,999.78	2.91	59,002.69	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	58,999.78	2.91	59,002.69	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		249,650,356.42	2.91	255,324,143.60	5,673,784.27

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,142,040.00	-	-	-
IC2609	3,395,680.00	-	-	-
IH2609	1,746,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,142,040.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2609	IC2609	2	3,504,560.00	108,880.00
IH2609	IH2609	2	1,758,480.00	12,120.00
合计	-	-	-	121,000.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	121,000.00
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	65,714.72
合计	65,714.72

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	13,572.08
应付替代款	62,044.64

可退替代款	99,322.02
其他应付款	14,708.50
合计	189,647.24

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	321,193,000.00	321,193,000.00
本期申购	531,000,000.00	531,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-594,000,000.00	-594,000,000.00
本期末	258,193,000.00	258,193,000.00

注：本基金合同于 2026 年 1 月 30 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 321,193,000.00 份基金份额。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	10,564,090.69	5,794,784.27	16,358,874.96
本期基金份额交易产生的变动数	7,942,299.37	-18,736,145.68	-10,793,846.31
其中：基金申购款	26,339,985.29	-32,932,772.84	-6,592,787.55
基金赎回款	-18,397,685.92	14,196,627.16	-4,201,058.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,506,390.06	-12,941,361.41	5,565,028.65

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,528.89
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	20,161.59
结算备付金利息收入	4,100.95
其他	-
合计	36,791.43

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 2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,587,844.59
股票投资收益——赎回差价收入	3,116,689.32
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	8,704,533.91

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 2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	224,747,624.88
减：卖出股票成本总额	218,924,115.74
减：交易费用	235,664.55
买卖股票差价收入	5,587,844.59

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 2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	598,201,058.76
减：现金支付赎回款总额	14,817,873.76
减：赎回股票成本总额	580,266,495.68
减：交易费用	-
赎回差价收入	3,116,689.32

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 2026年1月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	23.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	25,294.48
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	25,318.20

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 2026年1月30日（基金合同生效日）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	1,384,867.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,351,514.21
减：应计利息总额	7,995.07
减：交易费用	63.83
买卖债券差价收入	25,294.48

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

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股指期货投资收益	227,241.53

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,617,210.91
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,617,210.91

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1.交易性金融资产	5,673,784.27
——股票投资	5,673,784.27
——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	121,000.00

——权证投资	-
——期货投资	121,000.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,794,784.27

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	148,346.08
其他	11,820.76
合计	160,166.84

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 2026年1月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
审计费用	13,572.08
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,010.53
其他	54,685.28
合计	69,267.89

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	102,812.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,528.20
应支付基金管理人的净管理费	88,284.72

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

H＝E×0.15%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人

无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,271.00

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

H＝E×0.05%÷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，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	758,600.00	0.2938%

注：本基金合同生效日为 2026 年 01 月 30 日。除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

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 2026年1月30日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	2,020,001.35	12,528.89

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国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 2026 年 1 月 30 日（基金合同生效日）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	601	9,471.76

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
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	23	770.27	780.39	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	61	961.36	2,849.31	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通	17.70	84.32	61	1,079.70	5,143.52	-

				受限						
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	51	2,089.98	15,717.69	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	837	18,983.16	35,287.92	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	73	3,252.88	34,212.91	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	38	3,111.44	60,204.54	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	302	1,935.82	7,287.26	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	66	1,734.48	11,357.94	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	185	3,640.80	26,175.65	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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	100	10,000.00	10,000.11	-
113705	豪 26 转债	2026-06-16	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.01	350	35,000.00	35,002.30	-
118071	华峰转债	2026-06-24	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.10	-
118072	鼎通转债	2026-06-25	1 个月内（含）	新发流通受限	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.18	-

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
601369	陕鼓动力	2026-06-29	重大事项停牌	9.05	2026-07-13	9.96	25,400	226,517.56	229,870.00	-
603137	恒尚节能	2026-06-16	重大事项停牌	12.94	2026-07-01	14.23	3,600	45,282.00	46,584.00	-
603722	阿科力	2026-06-29	重大事项停牌	39.60	2026-07-06	43.56	1,600	58,104.80	63,360.00	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	1,273	780,800.03	1,059,136.00	-

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

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%。

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 2026年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日
A-1	0.00
A-1 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末

	2026年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	59,002.69
未评级	0.00
合计	59,002.69

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 2026年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 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 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	6,863,845.06	-	-	-	6,863,845.06
结算备付金	1,377,613.02	-	-	-	1,377,613.02
存出保证金	631,564.80	-	-	-	631,564.80
交易性金融资产	-	-	59,002.69	255,265,140.91	255,324,143.6

					0
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	-	-	-	65,714.72	65,714.72
资产总计	8,873,022.88	-	59,002.69	255,330,855.63	264,262,881.20
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	-	-	-	276,374.32	276,374.32
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	28,515.00	28,515.00
应付托管费	-	-	-	9,504.97	9,504.97
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	811.02	811.02
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	189,647.24	189,647.24
负债总计	-	-	-	504,852.55	504,852.55
利率敏感度缺口	8,873,022.88	-	59,002.69	254,826,003.08	263,758,028.65

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 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	255,265,140.91	96.78
交易性金融资产－债券投资	59,002.69	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	255,324,143.60	96.80

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026 年 6 月 30 日
	1.业绩比较基准上升 5%	12,731,394.17
	2.业绩比较基准下降 5%	-12,731,394.17

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	253,667,173.78
第二层次	1,457,952.69
第三层次	199,017.13
合计	255,324,143.60

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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

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

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	255,265,140.91	96.60
	其中：股票	255,265,140.91	96.60

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,002.69	0.02
	其中：债券	59,002.69	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	8,241,458.08	3.12
8	其他各项资产	697,279.52	0.26
9	合计	264,262,881.20	100.00

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

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

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	135,369.00	0.05
B	采矿业	18,669,100.00	7.08
C	制造业	130,975,209.77	49.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,825,664.00	4.10
E	建筑业	4,727,746.00	1.79
F	批发和零售业	2,735,239.00	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	7,851,546.00	2.98
H	住宿和餐饮业	322,021.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,436,906.67	6.23
J	金融业	53,541,925.40	20.30
K	房地产业	1,777,292.00	0.67
L	租赁和商务服务业	1,719,740.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	2,908,605.03	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	965,204.82	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	38,696.00	0.01
Q	卫生和社会工作	202,320.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	1,366,369.00	0.52
S	综合	66,898.00	0.03
	合计	255,265,851.69	96.78

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601288	农业银行	1,300,500	7,894,035.00	2.99
2	601398	工商银行	1,086,100	7,678,727.00	2.91
3	600519	贵州茅台	4,900	5,808,901.00	2.20
4	601138	工业富联	77,900	5,620,485.00	2.13
5	601857	中国石油	635,300	5,514,404.00	2.09
6	688256	寒武纪	2,315	3,693,698.25	1.40
7	688041	海光信息	9,185	3,401,205.50	1.29
8	600036	招商银行	86,600	3,074,300.00	1.17
9	601628	中国人寿	81,600	2,884,560.00	1.09
10	601088	中国神华	70,000	2,732,800.00	1.04
11	600900	长江电力	97,700	2,586,119.00	0.98
12	601166	兴业银行	131,800	2,182,608.00	0.83
13	601899	紫金矿业	82,300	2,069,022.00	0.78
14	601318	中国平安	43,100	2,057,594.00	0.78
15	603986	兆易创新	2,500	2,037,500.00	0.77
16	601658	邮储银行	401,000	1,976,930.00	0.75
17	601939	建设银行	189,200	1,821,996.00	0.69
18	600000	浦发银行	207,000	1,782,270.00	0.68
19	600028	中国石化	389,800	1,738,508.00	0.66
20	600183	生益科技	9,500	1,647,300.00	0.62
21	688012	中微公司	3,480	1,630,380.00	0.62
22	601728	中国电信	304,000	1,577,760.00	0.60
23	688498	源杰科技	793	1,495,598.00	0.57
24	688409	富创精密	4,852	1,485,925.00	0.56
25	603268	松发股份	10,400	1,448,512.00	0.55
26	688002	睿创微纳	9,096	1,407,060.24	0.53
27	600030	中信证券	47,900	1,376,167.00	0.52
28	601328	交通银行	213,900	1,375,377.00	0.52
29	601869	长飞光纤	2,400	1,310,160.00	0.50
30	688008	澜起科技	4,211	1,304,988.90	0.49
31	600276	恒瑞医药	24,700	1,285,388.00	0.49

32	688981	中芯国际	7,929	1,259,283.78	0.48
33	603259	药明康德	9,600	1,195,296.00	0.45
34	603993	洛阳钼业	68,100	1,195,155.00	0.45
35	603256	宏和科技	4,500	1,193,985.00	0.45
36	688200	华峰测控	2,225	1,168,347.50	0.44
37	600221	海航控股	858,200	1,158,570.00	0.44
38	600176	中国巨石	15,800	1,151,504.00	0.44
39	688766	普冉股份	1,485	1,138,401.00	0.43
40	601998	中信银行	159,800	1,107,414.00	0.42
41	688072	拓荆科技	1,273	1,059,136.00	0.40
42	600487	亨通光电	9,400	1,027,796.00	0.39
43	600150	中国船舶	30,000	1,013,700.00	0.38
44	601211	国泰海通	55,400	1,008,280.00	0.38
45	601319	中国人保	142,100	960,596.00	0.36
46	688120	华海清科	2,914	938,832.52	0.36
47	688536	思瑞浦	2,562	932,798.58	0.35
48	688347	华虹宏力	2,755	926,506.50	0.35
49	688110	东芯股份	4,439	904,224.30	0.34
50	601816	京沪高铁	196,700	891,051.00	0.34
51	688521	芯原股份	2,349	871,807.86	0.33
52	600642	申能股份	97,700	852,921.00	0.32
53	600309	万华化学	12,300	841,443.00	0.32
54	600522	中天科技	13,500	819,180.00	0.31
55	600016	民生银行	253,000	814,660.00	0.31
56	688728	格科微	38,402	807,978.08	0.31
57	603061	金海通	1,600	803,552.00	0.30
58	600919	江苏银行	73,600	793,408.00	0.30
59	688519	南亚新材	2,056	781,362.24	0.30
60	601225	陕西煤业	38,000	773,300.00	0.29
61	601601	中国太保	26,900	767,188.00	0.29
62	600584	长电科技	7,200	745,560.00	0.28
63	601066	中信建投	25,500	741,285.00	0.28
64	688082	盛美上海	1,699	733,968.00	0.28
65	601233	桐昆股份	33,700	729,605.00	0.28
66	601985	中国核电	80,600	727,818.00	0.28
67	600406	国电南瑞	31,700	724,345.00	0.27
68	603288	海天味业	21,800	722,888.00	0.27
69	601668	中国建筑	164,800	715,232.00	0.27
70	688538	和辉光电	267,136	694,553.60	0.26
71	600111	北方稀土	14,200	682,310.00	0.26
72	601919	中远海控	50,700	672,282.00	0.25
73	688627	精智达	931	665,665.00	0.25
74	603083	剑桥科技	2,600	662,662.00	0.25
75	600025	华能水电	74,500	662,305.00	0.25

76	600901	江苏金租	113,600	653,200.00	0.25
77	688037	芯源微	1,482	650,672.10	0.25
78	688525	佰维存储	1,315	650,569.95	0.25
79	603663	三祥新材	6,600	635,580.00	0.24
80	688052	纳芯微	2,199	633,993.69	0.24
81	603019	中科曙光	5,800	621,934.00	0.24
82	603298	杭叉集团	25,700	613,202.00	0.23
83	601100	恒立液压	5,700	613,092.00	0.23
84	601777	千里科技	74,900	611,184.00	0.23
85	600999	招商证券	28,700	605,570.00	0.23
86	600887	伊利股份	24,800	594,208.00	0.23
87	688048	长光华芯	1,179	591,858.00	0.22
88	601688	华泰证券	28,700	591,794.00	0.22
89	688503	聚和材料	4,452	590,780.40	0.22
90	600989	宝丰能源	28,700	583,471.00	0.22
91	688702	盛科通信	1,493	582,255.07	0.22
92	688127	蓝特光学	5,959	581,598.40	0.22
93	600031	三一重工	33,300	575,424.00	0.22
94	688266	泽璟制药	4,875	568,717.50	0.22
95	603283	赛腾股份	6,890	557,952.20	0.21
96	601872	招商轮船	31,700	556,969.00	0.21
97	600160	巨化股份	10,500	556,605.00	0.21
98	600885	宏发股份	16,100	555,289.00	0.21
99	600925	苏能股份	138,400	554,984.00	0.21
100	605117	德业股份	4,980	528,776.40	0.20
101	600809	山西汾酒	4,800	524,976.00	0.20
102	600369	西南证券	130,200	523,404.00	0.20
103	600884	杉杉股份	38,300	518,965.00	0.20
104	601818	光大银行	179,400	518,466.00	0.20
105	601126	四方股份	8,100	511,920.00	0.19
106	601766	中国中车	97,200	505,440.00	0.19
107	601698	中国卫通	16,600	502,150.00	0.19
108	688126	沪硅产业	12,551	500,659.39	0.19
109	600690	海尔智家	24,500	500,045.00	0.19
110	600259	中稀有色	4,900	497,889.00	0.19
111	601009	南京银行	49,900	493,511.00	0.19
112	603501	豪威集团	5,200	493,220.00	0.19
113	600398	海澜之家	94,100	492,143.00	0.19
114	600050	中国联通	122,600	490,400.00	0.19
115	601336	新华保险	8,200	489,212.00	0.19
116	600346	恒力石化	27,600	488,796.00	0.19
117	688390	固德威	4,469	484,931.19	0.18
118	601229	上海银行	55,700	483,476.00	0.18
119	600760	中航沈飞	11,700	480,870.00	0.18

120	603766	隆鑫通用	40,300	480,779.00	0.18
121	688396	华润微	4,889	476,921.95	0.18
122	600019	宝钢股份	87,500	475,125.00	0.18
123	688506	百利天恒	1,606	472,212.18	0.18
124	600816	建元信托	193,000	470,920.00	0.18
125	688368	晶丰明源	2,174	470,714.48	0.18
126	688349	三一重能	30,819	467,832.42	0.18
127	601665	齐鲁银行	80,400	463,908.00	0.18
128	600998	九州通	98,900	463,841.00	0.18
129	688668	鼎通科技	1,221	455,799.30	0.17
130	600711	盛屯矿业	41,500	455,255.00	0.17
131	601155	新城控股	44,300	454,518.00	0.17
132	600549	厦门钨业	5,300	451,560.00	0.17
133	600153	建发股份	56,800	450,424.00	0.17
134	600100	同方股份	65,700	450,045.00	0.17
135	601898	中煤能源	36,700	447,006.00	0.17
136	600089	特变电工	19,800	445,500.00	0.17
137	600595	中孚实业	78,600	441,732.00	0.17
138	601995	中金公司	12,200	441,030.00	0.17
139	600104	上汽集团	45,000	439,200.00	0.17
140	601928	凤凰传媒	49,900	438,621.00	0.17
141	600018	上港集团	91,300	430,936.00	0.16
142	688387	信科移动	21,644	429,416.96	0.16
143	600905	三峡能源	115,000	426,650.00	0.16
144	600566	济川药业	19,100	423,829.00	0.16
145	688475	萤石网络	15,385	420,779.75	0.16
146	600926	杭州银行	29,100	420,495.00	0.16
147	601600	中国铝业	51,100	420,042.00	0.16
148	600886	国投电力	31,500	419,265.00	0.16
149	600188	兖矿能源	23,500	417,595.00	0.16
150	600688	上海石化	142,400	417,232.00	0.16
151	688630	芯碁微装	757	415,888.23	0.16
152	601888	中国中免	7,700	413,567.00	0.16
153	603296	华勤技术	5,560	412,941.20	0.16
154	688392	骄成超声	1,814	412,104.52	0.16
155	600801	华新建材	26,400	411,840.00	0.16
156	601169	北京银行	83,800	410,620.00	0.16
157	600015	华夏银行	64,200	410,238.00	0.16
158	600685	中船防务	16,100	409,584.00	0.16
159	688599	天合光能	28,938	408,604.56	0.15
160	600098	广州发展	68,800	406,608.00	0.15
161	600010	包钢股份	182,100	406,083.00	0.15
162	605289	罗曼股份	2,800	406,000.00	0.15
163	603186	华正新材	1,800	405,540.00	0.15

164	601963	重庆银行	40,200	405,216.00	0.15
165	603077	和邦生物	173,100	401,592.00	0.15
166	688248	南网科技	5,772	399,306.96	0.15
167	600660	福耀玻璃	7,900	398,476.00	0.15
168	601916	浙商银行	151,300	397,919.00	0.15
169	601012	隆基绿能	30,200	396,224.00	0.15
170	603991	领先股份	2,800	395,220.00	0.15
171	600893	航发动力	10,300	394,902.00	0.15
172	600316	洪都航空	14,045	392,417.30	0.15
173	601000	唐山港	94,500	392,175.00	0.15
174	601127	赛力斯	6,400	392,000.00	0.15
175	600869	远东股份	11,700	391,599.00	0.15
176	600008	首创环保	143,900	391,408.00	0.15
177	600535	天士力	29,300	387,639.00	0.15
178	601689	拓普集团	6,800	383,656.00	0.15
179	603733	仙鹤股份	14,200	383,542.00	0.15
180	603638	艾迪精密	16,300	382,235.00	0.14
181	688147	微导纳米	2,361	382,198.68	0.14
182	601997	贵阳银行	73,300	376,029.00	0.14
183	600390	五矿资本	82,200	374,832.00	0.14
184	601006	大秦铁路	80,700	372,027.00	0.14
185	601633	长城汽车	24,500	369,705.00	0.14
186	688279	峰岹科技	1,647	369,652.68	0.14
187	688172	燕东微	4,403	368,354.98	0.14
188	601868	中国能建	137,100	366,057.00	0.14
189	601216	君正集团	81,900	365,274.00	0.14
190	600875	东方电气	12,600	362,502.00	0.14
191	600397	江钨装备	13,300	362,159.00	0.14
192	601880	辽港股份	260,100	358,938.00	0.14
193	600995	南网储能	29,100	357,930.00	0.14
194	601881	中国银河	28,400	356,988.00	0.14
195	603124	江南新材	1,900	355,262.00	0.13
196	603799	华友钴业	7,300	352,298.00	0.13
197	600362	江西铜业	8,100	350,730.00	0.13
198	600460	士兰微	6,400	349,824.00	0.13
199	688111	金山办公	1,634	348,123.70	0.13
200	688319	欧林生物	7,908	347,793.84	0.13
201	601098	中南传媒	35,200	346,368.00	0.13
202	600489	中金黄金	19,000	342,950.00	0.13
203	600606	绿地控股	281,200	340,252.00	0.13
204	605358	立昂微	4,353	337,792.80	0.13
205	688652	京仪装备	1,684	337,086.28	0.13
206	601390	中国中铁	80,300	334,851.00	0.13
207	600547	山东黄金	14,500	334,805.00	0.13

208	688400	凌云光	5,029	332,919.80	0.13
209	601208	东材科技	4,700	332,713.00	0.13
210	601231	环旭电子	10,100	327,240.00	0.12
211	600011	华能国际	43,100	327,129.00	0.12
212	600795	国电电力	70,000	326,900.00	0.12
213	688778	厦钨新能	5,993	326,019.20	0.12
214	603658	安图生物	11,200	325,024.00	0.12
215	600754	锦江酒店	17,900	322,021.00	0.12
216	603699	纽威股份	6,400	321,920.00	0.12
217	600820	隧道股份	61,700	321,457.00	0.12
218	600938	中国海油	11,800	320,370.00	0.12
219	601669	中国电建	67,500	317,250.00	0.12
220	600366	宁波韵升	21,500	315,620.00	0.12
221	600345	长江通信	4,800	314,448.00	0.12
222	600655	豫园股份	76,300	313,593.00	0.12
223	688090	瑞松科技	2,939	312,856.55	0.12
224	688559	海目星	3,716	311,846.72	0.12
225	688271	联影医疗	3,074	311,181.02	0.12
226	600060	海信视像	11,000	306,570.00	0.12
227	605499	东鹏饮料	2,470	304,872.10	0.12
228	601077	渝农商行	49,700	303,667.00	0.12
229	688779	五矿新能	37,291	302,430.01	0.11
230	603893	瑞芯微	1,600	301,376.00	0.11
231	603132	金徽股份	19,200	299,136.00	0.11
232	600933	爱柯迪	20,200	298,556.00	0.11
233	688295	中复神鹰	4,924	298,098.96	0.11
234	600329	达仁堂	8,000	297,760.00	0.11
235	688275	万润新能	2,325	296,553.75	0.11
236	601111	中国国航	49,000	296,450.00	0.11
237	688100	威胜信息	9,691	296,447.69	0.11
238	603067	振华股份	6,400	296,256.00	0.11
239	601699	潞安环能	20,700	295,596.00	0.11
240	603297	永新光学	2,000	293,900.00	0.11
241	601838	成都银行	16,600	293,820.00	0.11
242	600941	中国移动	3,400	292,842.00	0.11
243	600299	安迪苏	37,300	292,805.00	0.11
244	600026	中远海能	16,300	292,422.00	0.11
245	600928	西安银行	89,000	291,030.00	0.11
246	600808	马钢股份	116,200	290,500.00	0.11
247	600482	中国动力	8,800	288,640.00	0.11
248	600528	中铁工业	43,500	286,665.00	0.11
249	688235	百济神州	1,124	286,181.64	0.11
250	688416	恒烁股份	2,040	285,600.00	0.11
251	601139	深圳燃气	50,300	284,698.00	0.11

252	688378	奥来德	4,587	284,394.00	0.11
253	601825	沪农商行	37,800	283,122.00	0.11
254	603317	天味食品	21,400	278,414.00	0.11
255	603195	公牛集团	7,102	278,043.30	0.11
256	688800	瑞可达	2,892	277,545.24	0.11
257	600958	东方证券	29,300	276,592.00	0.10
258	600023	浙能电力	52,500	276,150.00	0.10
259	600651	飞乐音响	49,200	275,028.00	0.10
260	600039	四川路桥	35,100	274,482.00	0.10
261	600029	南方航空	52,800	273,504.00	0.10
262	600331	宏达股份	24,700	271,453.00	0.10
263	600674	川投能源	19,100	270,647.00	0.10
264	600732	爱旭股份	19,500	270,075.00	0.10
265	601186	中国铁建	45,100	268,345.00	0.10
266	600585	海螺水泥	15,700	266,115.00	0.10
267	600361	创新新材	73,700	265,320.00	0.10
268	601800	中国交建	46,400	264,944.00	0.10
269	601187	厦门银行	38,700	264,321.00	0.10
270	600872	中炬高新	15,200	263,872.00	0.10
271	688257	新锐股份	2,578	262,698.20	0.10
272	601061	中信金属	24,200	260,634.00	0.10
273	600115	中国东航	67,900	258,699.00	0.10
274	603125	常青科技	7,800	255,372.00	0.10
275	605589	圣泉集团	4,000	254,280.00	0.10
276	600737	中粮糖业	20,400	251,532.00	0.10
277	688036	传音控股	4,230	249,358.50	0.09
278	600167	联美控股	44,300	247,637.00	0.09
279	601018	宁波港	78,500	247,275.00	0.09
280	688220	翱捷科技	1,974	245,407.68	0.09
281	601360	三六零	28,200	245,058.00	0.09
282	603194	中力股份	6,700	244,952.00	0.09
283	600236	桂冠电力	27,800	244,084.00	0.09
284	603179	新泉股份	4,900	243,285.00	0.09
285	688047	龙芯中科	1,567	242,367.89	0.09
286	600764	中国海防	13,900	242,277.00	0.09
287	600436	片仔癀	2,200	240,416.00	0.09
288	600155	华创云信	43,400	239,568.00	0.09
289	600271	航天信息	36,300	238,854.00	0.09
290	688777	中控技术	2,031	238,642.50	0.09
291	603063	禾望电气	4,500	238,005.00	0.09
292	601033	永兴股份	17,600	235,840.00	0.09
293	603826	坤彩科技	9,200	235,152.00	0.09
294	600977	中国电影	18,100	233,852.00	0.09
295	600352	浙江龙盛	19,300	233,723.00	0.09

296	600066	宇通客车	8,700	233,247.00	0.09
297	688321	微芯生物	8,762	230,703.46	0.09
298	601901	方正证券	32,000	230,400.00	0.09
299	601369	陕鼓动力	25,400	229,870.00	0.09
300	600761	安徽合力	14,000	229,040.00	0.09
301	603260	合盛硅业	4,700	226,822.00	0.09
302	605507	国邦医药	15,300	226,440.00	0.09
303	600461	洪城环境	24,900	225,594.00	0.09
304	600009	上海机场	9,700	224,070.00	0.08
305	600415	小商品城	22,000	223,520.00	0.08
306	603707	健友股份	31,600	223,412.00	0.08
307	688187	时代电气	3,239	222,389.74	0.08
308	688486	龙迅股份	3,477	221,067.66	0.08
309	601788	光大证券	15,300	220,779.00	0.08
310	603992	松霖科技	6,800	220,320.00	0.08
311	600233	圆通速递	13,900	218,925.00	0.08
312	600285	羚锐制药	11,200	217,056.00	0.08
313	600720	中交设计	45,000	216,900.00	0.08
314	688231	隆达股份	5,903	216,817.19	0.08
315	600048	保利发展	46,800	216,684.00	0.08
316	600438	通威股份	17,600	213,136.00	0.08
317	605016	百龙创园	8,200	211,970.00	0.08
318	601377	兴业证券	35,000	211,400.00	0.08
319	601877	正泰电器	8,400	210,588.00	0.08
320	600116	三峡水利	37,500	210,000.00	0.08
321	603927	中科软	16,300	207,173.00	0.08
322	600372	中航机载	19,000	206,150.00	0.08
323	601059	信达证券	12,700	205,613.00	0.08
324	688313	仕佳光子	1,111	205,146.15	0.08
325	601021	春秋航空	4,500	205,110.00	0.08
326	603072	天和磁材	5,200	203,840.00	0.08
327	601001	晋控煤业	11,700	203,463.00	0.08
328	688059	华锐精密	1,015	202,705.65	0.08
329	603882	金域医学	9,000	202,320.00	0.08
330	600803	新奥股份	12,800	202,240.00	0.08
331	600741	华域汽车	13,000	201,760.00	0.08
332	603626	科森科技	10,900	201,650.00	0.08
333	600006	东风股份	39,200	201,096.00	0.08
334	600452	涪陵电力	21,400	199,662.00	0.08
335	601333	广深铁路	72,600	199,650.00	0.08
336	600426	华鲁恒升	8,300	198,536.00	0.08
337	688046	药康生物	8,125	196,625.00	0.07
338	688063	派能科技	3,666	195,287.82	0.07
339	688258	卓易信息	1,635	193,812.90	0.07

340	600395	盘江股份	42,100	191,976.00	0.07
341	603888	新华网	11,200	190,736.00	0.07
342	600973	宝胜股份	26,900	190,721.00	0.07
343	688093	世华科技	5,167	190,662.30	0.07
344	600392	盛和资源	6,400	190,528.00	0.07
345	603929	亚翔集成	700	190,414.00	0.07
346	605376	博迁新材	700	189,910.00	0.07
347	603235	天新药业	8,500	189,125.00	0.07
348	600383	金地集团	88,500	186,735.00	0.07
349	600196	复星医药	8,300	186,501.00	0.07
350	688252	天德钰	7,768	186,432.00	0.07
351	688223	晶科能源	39,145	185,938.75	0.07
352	605100	华丰股份	4,600	185,932.00	0.07
353	603588	高能环境	9,600	184,320.00	0.07
354	688191	智洋创新	5,162	184,283.40	0.07
355	603931	格林达	3,100	184,140.00	0.07
356	603171	税友股份	4,600	183,310.00	0.07
357	603915	国茂股份	12,900	183,051.00	0.07
358	688449	联芸科技	2,115	182,545.65	0.07
359	601456	国联民生	20,600	182,104.00	0.07
360	600269	赣粤高速	45,700	181,886.00	0.07
361	601607	上海医药	11,800	181,720.00	0.07
362	600219	南山铝业	45,500	181,545.00	0.07
363	600298	安琪酵母	5,000	181,000.00	0.07
364	603057	紫燕食品	8,100	180,630.00	0.07
365	603100	川仪股份	10,000	180,500.00	0.07
366	600162	香江控股	64,100	179,480.00	0.07
367	601619	嘉泽新能	41,700	179,310.00	0.07
368	601886	江河集团	22,200	178,266.00	0.07
369	600728	佳都科技	41,800	178,068.00	0.07
370	601117	中国化学	24,000	176,400.00	0.07
371	688710	益诺思	2,624	176,332.80	0.07
372	688678	福立旺	7,282	176,005.94	0.07
373	600377	宁沪高速	15,200	175,864.00	0.07
374	601618	中国中冶	71,900	175,436.00	0.07
375	600027	华电国际	39,200	174,440.00	0.07
376	601200	上海环境	26,400	174,240.00	0.07
377	600757	长江传媒	23,800	173,978.00	0.07
378	601860	紫金银行	71,800	173,756.00	0.07
379	600273	嘉化能源	26,600	173,432.00	0.07
380	603219	富佳股份	11,100	172,938.00	0.07
381	603257	中国瑞林	2,200	171,578.00	0.07
382	600037	歌华有线	27,300	171,171.00	0.06
383	688230	芯导科技	2,167	170,781.27	0.06

384	600307	酒钢宏兴	122,800	170,692.00	0.06
385	601528	瑞丰银行	38,450	169,949.00	0.06
386	601298	青岛港	21,100	169,855.00	0.06
387	603166	福达股份	12,700	169,799.00	0.06
388	600935	华塑股份	71,700	168,495.00	0.06
389	600662	外服控股	41,700	168,051.00	0.06
390	601878	浙商证券	17,600	167,200.00	0.06
391	688221	前沿生物	7,440	166,656.00	0.06
392	688009	中国通号	34,980	166,504.80	0.06
393	603323	苏农银行	42,920	166,100.40	0.06
394	600185	珠免集团	36,900	166,050.00	0.06
395	600918	中泰证券	31,200	165,984.00	0.06
396	688578	艾力斯	1,516	165,547.20	0.06
397	688689	银河微电	2,551	165,100.72	0.06
398	688522	纳睿雷达	8,203	164,224.06	0.06
399	603065	宿迁联盛	8,100	164,106.00	0.06
400	603883	老百姓	14,900	163,304.00	0.06
401	600061	国投资本	24,700	161,785.00	0.06
402	688787	海天瑞声	1,195	160,667.75	0.06
403	600266	城建发展	40,700	159,137.00	0.06
404	688548	广钢气体	3,052	159,009.20	0.06
405	600570	恒生电子	7,500	158,925.00	0.06
406	603809	豪能股份	18,100	158,737.00	0.06
407	688472	阿特斯	14,460	156,457.20	0.06
408	603013	亚普股份	9,900	156,321.00	0.06
409	601038	一拖股份	14,500	153,555.00	0.06
410	605333	沪光股份	9,000	153,450.00	0.06
411	688173	希荻微	7,963	152,411.82	0.06
412	600955	维远股份	10,300	151,616.00	0.06
413	601089	福元医药	9,300	151,404.00	0.06
414	688146	中船特气	429	150,145.71	0.06
415	603135	中重科技	12,400	150,040.00	0.06
416	600654	中安科	56,400	150,024.00	0.06
417	603226	菲林格尔	2,800	149,912.00	0.06
418	688108	赛诺医疗	8,042	149,018.26	0.06
419	601058	赛轮轮胎	12,900	148,737.00	0.06
420	603515	欧普照明	9,100	148,694.00	0.06
421	688750	金天钛业	8,939	148,655.57	0.06
422	600094	大名城	42,900	148,434.00	0.06
423	601238	广汽集团	29,200	148,336.00	0.06
424	601828	美凯龙	72,600	148,104.00	0.06
425	688303	大全能源	8,492	148,015.56	0.06
426	600400	红豆股份	44,900	147,721.00	0.06
426	603978	深圳新星	4,700	147,721.00	0.06

428	605277	新亚电子	7,680	146,380.80	0.06
429	603053	成都燃气	17,400	145,464.00	0.06
430	601136	首创证券	10,300	143,685.00	0.05
431	688018	乐鑫科技	1,122	143,526.24	0.05
432	688653	康希通信	8,205	142,602.90	0.05
433	603685	晨丰科技	5,000	142,500.00	0.05
434	600770	综艺股份	20,200	141,400.00	0.05
435	605008	长鸿高科	12,700	141,097.00	0.05
436	605298	必得科技	2,700	140,265.00	0.05
437	600845	宝信软件	8,400	139,692.00	0.05
438	603308	应流股份	2,300	138,920.00	0.05
439	601212	白银有色	27,100	137,668.00	0.05
440	601686	友发集团	28,400	137,172.00	0.05
441	600682	南京新百	26,400	135,960.00	0.05
442	600600	青岛啤酒	2,600	135,798.00	0.05
443	688168	安博通	1,974	135,712.50	0.05
444	688593	新相微	3,475	135,247.00	0.05
445	688205	德科立	648	134,907.12	0.05
446	603392	万泰生物	5,000	134,850.00	0.05
447	605018	长华集团	9,000	134,190.00	0.05
448	600596	新安股份	8,400	134,064.00	0.05
449	600085	同仁堂	5,800	134,038.00	0.05
450	605319	无锡振华	5,900	133,871.00	0.05
451	688577	浙海德曼	2,905	133,136.15	0.05
452	600323	瀚蓝环境	4,800	131,808.00	0.05
453	600117	西宁特钢	64,400	131,376.00	0.05
454	600251	冠农股份	15,200	131,328.00	0.05
455	603091	众鑫股份	2,680	130,703.60	0.05
456	688553	汇宇制药	12,117	128,803.71	0.05
457	600059	古越龙山	17,500	128,100.00	0.05
458	601236	红塔证券	18,500	126,170.00	0.05
459	688188	柏楚电子	1,176	125,479.20	0.05
460	601808	中海油服	11,600	125,396.00	0.05
461	605005	合兴股份	7,900	124,899.00	0.05
461	605228	神通科技	9,300	124,899.00	0.05
463	603668	天马科技	9,800	124,068.00	0.05
464	600515	海南机场	45,000	123,300.00	0.05
465	600255	鑫科材料	35,400	123,192.00	0.05
466	600588	用友网络	13,400	123,012.00	0.05
467	600846	同济科技	12,300	123,000.00	0.05
468	688620	安凯微	7,578	122,763.60	0.05
469	688202	美迪西	1,518	122,517.78	0.05
470	601388	怡球资源	43,200	122,256.00	0.05
471	603071	物产环能	11,000	121,660.00	0.05

472	603277	银都股份	12,100	120,758.00	0.05
473	603901	永创智能	11,100	120,657.00	0.05
474	605183	确成股份	8,100	119,394.00	0.05
475	688001	华兴源创	1,388	118,951.60	0.05
476	605555	德昌股份	9,400	117,500.00	0.04
477	600375	汉马科技	31,500	116,235.00	0.04
478	603369	今世缘	4,900	116,179.00	0.04
479	600499	科达制造	8,400	115,920.00	0.04
480	603983	丸美生物	4,100	115,374.00	0.04
481	600520	三佳科技	2,900	115,159.00	0.04
482	603507	振江股份	3,500	115,115.00	0.04
483	603368	柳药集团	7,800	114,426.00	0.04
484	600288	大恒科技	8,600	114,380.00	0.04
485	603045	福达合金	1,600	114,224.00	0.04
486	600862	中航高科	6,300	113,589.00	0.04
487	601500	通用股份	31,100	113,515.00	0.04
488	600035	楚天高速	33,300	112,221.00	0.04
489	688045	必易微	1,383	111,718.74	0.04
490	688195	腾景科技	568	109,385.44	0.04
491	688115	思林杰	1,320	108,570.00	0.04
492	600143	金发科技	7,000	108,150.00	0.04
493	688293	奥浦迈	2,590	107,977.10	0.04
494	688232	新点软件	5,932	105,470.96	0.04
495	600230	沧州大化	8,100	105,462.00	0.04
496	600189	泉阳泉	14,000	105,420.00	0.04
497	603681	永冠新材	4,600	105,110.00	0.04
498	688249	晶合集成	1,759	103,833.77	0.04
499	688199	久日新材	3,005	103,762.65	0.04
500	603489	八方股份	3,700	103,452.00	0.04
501	688167	炬光科技	290	102,720.90	0.04
502	688505	复旦张江	13,862	102,301.56	0.04
503	603587	地素时尚	9,200	102,212.00	0.04
504	688312	燕麦科技	1,216	102,131.84	0.04
505	600223	福瑞达	19,900	100,097.00	0.04
506	600278	东方创业	16,800	98,784.00	0.04
507	603659	璞泰来	3,400	98,362.00	0.04
508	603173	福斯达	2,900	98,310.00	0.04
509	600868	梅雁吉祥	37,200	97,836.00	0.04
510	601700	风范股份	22,400	97,664.00	0.04
511	600703	三安光电	4,600	97,612.00	0.04
512	688169	石头科技	1,025	97,344.25	0.04
513	688253	英诺特	1,606	96,809.68	0.04
514	600881	亚泰集团	63,900	96,489.00	0.04
515	601968	宝钢包装	24,600	96,432.00	0.04

516	688615	合合信息	845	95,569.50	0.04
517	688095	福昕软件	1,608	95,563.44	0.04
518	603111	康尼机电	16,800	95,088.00	0.04
519	603336	宏辉果蔬	12,000	95,040.00	0.04
520	688237	超卓航科	1,777	94,927.34	0.04
521	601279	英利汽车	31,100	94,855.00	0.04
522	688025	杰普特	200	94,000.00	0.04
523	603110	东方材料	4,000	92,680.00	0.04
524	603933	睿能科技	4,100	92,455.00	0.04
525	688350	富淼科技	2,672	92,264.16	0.03
526	600510	黑牡丹	12,300	91,758.00	0.03
527	603511	爱慕股份	7,900	90,850.00	0.03
528	600161	天坛生物	7,800	90,324.00	0.03
529	601068	中铝国际	20,900	90,288.00	0.03
530	603848	好太太	6,600	90,156.00	0.03
531	603800	洪田股份	1,100	89,419.00	0.03
532	603629	利通电子	500	89,405.00	0.03
533	603868	飞科电器	2,900	89,320.00	0.03
534	603170	宝立食品	7,900	89,270.00	0.03
535	603980	吉华集团	13,300	88,312.00	0.03
536	600295	鄂尔多斯	8,200	87,904.00	0.03
537	601086	国芳集团	13,100	86,853.00	0.03
538	688679	通源环境	2,054	86,452.86	0.03
539	600558	大西洋	17,500	86,450.00	0.03
540	688148	芳源股份	10,062	86,331.96	0.03
541	688006	杭可科技	2,327	85,051.85	0.03
542	600279	重庆港	23,200	84,680.00	0.03
543	605338	巴比食品	4,700	84,130.00	0.03
544	603127	昭衍新药	2,200	84,084.00	0.03
545	688708	佳驰科技	1,646	83,616.80	0.03
546	688600	皖仪科技	2,503	83,299.84	0.03
547	603018	华设集团	16,200	83,268.00	0.03
548	605300	佳禾食品	8,500	82,875.00	0.03
549	603988	中电电机	5,100	82,722.00	0.03
550	601399	国机重装	23,600	82,600.00	0.03
551	603611	诺力股份	5,100	82,569.00	0.03
552	603255	鼎际得	2,500	82,175.00	0.03
553	601106	中国一重	24,800	81,840.00	0.03
554	600101	明星电力	10,300	81,267.00	0.03
555	603519	立霸股份	5,300	81,090.00	0.03
556	688389	普门科技	8,282	81,080.78	0.03
557	600617	国新能源	30,200	80,936.00	0.03
558	603516	淳中科技	600	80,766.00	0.03
559	600425	青松建化	24,500	80,115.00	0.03

560	603139	康惠股份	1,900	80,009.00	0.03
561	603669	灵康药业	14,100	79,947.00	0.03
562	600609	金杯汽车	25,600	79,872.00	0.03
563	603421	鼎信通讯	12,800	78,720.00	0.03
564	600843	上工申贝	9,100	78,260.00	0.03
565	603167	渤海轮渡	9,100	77,987.00	0.03
566	603998	方盛制药	8,600	77,658.00	0.03
567	603615	茶花股份	4,800	77,520.00	0.03
568	600505	西昌电力	7,200	76,968.00	0.03
569	603107	上海汽配	6,700	76,045.00	0.03
570	605577	龙版传媒	8,600	75,766.00	0.03
571	688081	兴图新科	1,837	75,096.56	0.03
572	688175	高凌信息	2,907	73,111.05	0.03
573	688717	艾罗能源	884	72,991.88	0.03
574	600750	华润江中	3,300	72,831.00	0.03
575	603948	建业股份	3,000	72,300.00	0.03
576	603276	恒兴新材	4,700	71,957.00	0.03
577	688171	纬德信息	1,626	71,478.96	0.03
578	600980	北矿科技	3,800	71,250.00	0.03
578	603006	联明股份	5,000	71,250.00	0.03
580	603689	皖天然气	10,200	70,686.00	0.03
581	601368	绿城水务	17,200	70,348.00	0.03
582	688588	凌志软件	7,731	70,274.79	0.03
583	603106	恒银科技	10,100	70,195.00	0.03
584	688098	申联生物	8,138	69,905.42	0.03
585	603928	兴业股份	4,720	69,856.00	0.03
586	688215	瑞晟智能	1,730	69,476.80	0.03
587	603396	金辰股份	2,600	68,900.00	0.03
588	603676	卫信康	8,500	68,425.00	0.03
589	603719	良品铺子	7,900	68,335.00	0.03
590	603918	金桥信息	7,200	68,256.00	0.03
591	600824	益民集团	20,700	68,103.00	0.03
592	603579	荣泰健康	4,000	67,880.00	0.03
593	688238	和元生物	12,513	67,820.46	0.03
594	688247	宣泰医药	8,963	67,401.76	0.03
595	603042	华脉科技	4,680	67,392.00	0.03
596	603207	小方制药	3,000	67,080.00	0.03
597	600805	悦达投资	16,600	66,898.00	0.03
598	603639	海利尔	6,700	66,464.00	0.03
599	603350	安乃达	2,100	66,255.00	0.03
600	603231	索宝蛋白	4,400	65,120.00	0.02
601	603330	天洋新材	8,400	65,016.00	0.02
602	603309	维力医疗	5,700	63,954.00	0.02
603	688722	同益中	4,187	63,516.79	0.02

604	600908	无锡银行	12,500	63,500.00	0.02
605	688569	铁科轨道	3,927	63,421.05	0.02
606	603722	阿科力	1,600	63,360.00	0.02
607	603577	汇金通	6,700	63,114.00	0.02
608	603035	常熟汽饰	5,800	61,596.00	0.02
609	600571	信雅达	6,300	61,425.00	0.02
610	600333	长春燃气	12,200	61,244.00	0.02
611	603351	威尔药业	2,500	61,025.00	0.02
612	600229	城市传媒	13,000	60,320.00	0.02
613	688808	联讯仪器	38	60,204.54	0.02
614	600546	山煤国际	5,500	60,115.00	0.02
615	688636	智明达	1,659	60,105.57	0.02
616	603823	百合花	1,100	60,027.00	0.02
617	603656	泰禾智能	3,400	59,772.00	0.02
618	600322	津投城开	21,800	59,732.00	0.02
619	600822	上海物贸	7,800	59,358.00	0.02
620	605398	新炬网络	3,000	59,250.00	0.02
621	688198	佰仁医疗	663	59,166.12	0.02
622	600567	山鹰国际	42,500	58,225.00	0.02
623	688755	汉邦科技	2,108	58,096.48	0.02
624	600638	新黄浦	13,200	57,684.00	0.02
625	603600	永艺股份	6,500	57,655.00	0.02
626	603739	蔚蓝生物	5,000	57,650.00	0.02
627	688325	赛微微电	441	57,510.81	0.02
628	603630	拉芳家化	4,500	57,510.00	0.02
629	688373	盟科药业	12,636	57,241.08	0.02
630	600827	百联股份	7,700	57,057.00	0.02
631	600467	好当家	28,900	56,933.00	0.02
632	688557	兰剑智能	1,832	56,846.96	0.02
633	601956	东贝集团	12,200	56,364.00	0.02
634	600731	湖南海利	11,000	56,320.00	0.02
635	688178	万德斯	1,648	55,718.88	0.02
636	603863	松炀资源	4,500	55,350.00	0.02
637	603987	康德莱	8,000	55,200.00	0.02
638	603819	神力股份	4,800	54,960.00	0.02
639	601599	浙文影业	19,600	54,684.00	0.02
640	600579	中化装备	6,600	54,516.00	0.02
641	603273	天元智能	4,200	54,390.00	0.02
642	600105	永鼎股份	800	53,984.00	0.02
643	603285	键邦股份	1,200	53,772.00	0.02
644	603030	全筑股份	26,800	53,332.00	0.02
645	688370	丛麟科技	2,549	53,325.08	0.02
646	603979	金诚信	900	53,127.00	0.02
647	688030	山石网科	3,359	53,038.61	0.02

648	603680	今创集团	5,400	52,974.00	0.02
649	688265	南模生物	1,527	52,818.93	0.02
650	603192	汇得科技	3,100	52,514.00	0.02
651	688155	先惠技术	648	52,416.72	0.02
652	688285	高铁电气	7,273	52,147.41	0.02
653	688526	科前生物	4,287	51,872.70	0.02
654	688353	华盛锂电	446	51,767.22	0.02
655	605060	联德股份	900	51,066.00	0.02
656	603970	中农立华	5,300	51,039.00	0.02
657	603602	纵横通信	4,600	50,692.00	0.02
658	601798	蓝科高新	7,000	50,680.00	0.02
659	688152	麒麟信安	1,835	50,425.80	0.02
660	603079	圣达生物	4,400	49,808.00	0.02
661	600356	恒丰纸业	6,600	48,906.00	0.02
662	600712	南宁百货	10,500	48,300.00	0.02
663	603237	五芳斋	3,900	48,282.00	0.02
664	603048	浙江黎明	2,700	47,898.00	0.02
665	603188	亚邦股份	12,000	47,520.00	0.02
666	600419	天润乳业	6,200	46,934.00	0.02
667	600439	瑞贝卡	22,200	46,842.00	0.02
668	603137	恒尚节能	3,600	46,584.00	0.02
669	688150	莱特光电	675	46,318.50	0.02
670	601121	宝地矿业	8,200	46,248.00	0.02
671	603059	倍加洁	1,900	46,075.00	0.02
672	600463	空港股份	6,000	45,780.00	0.02
673	600232	金鹰股份	7,200	45,360.00	0.02
674	603089	正裕工业	5,400	45,090.00	0.02
675	688560	明冠新材	3,753	44,473.05	0.02
676	603839	安正时尚	7,700	44,429.00	0.02
677	603086	先达股份	8,500	44,115.00	0.02
678	603797	联泰环保	11,600	43,500.00	0.02
679	688283	坤恒顺维	1,310	43,374.10	0.02
680	603768	常青股份	4,700	42,911.00	0.02
681	605266	健之佳	2,900	42,456.00	0.02
682	605001	威奥股份	7,700	41,965.00	0.02
683	605179	一鸣食品	3,300	41,481.00	0.02
684	603536	惠发食品	5,300	41,287.00	0.02
685	603506	南都物业	4,400	41,096.00	0.02
686	600257	大湖股份	9,400	40,702.00	0.02
687	600281	华阳新材	9,900	40,590.00	0.02
688	688244	永信至诚	2,814	40,127.64	0.02
689	603818	曲美家居	13,500	40,095.00	0.02
690	600833	第一医药	4,400	39,688.00	0.02
691	600619	海立股份	2,500	39,625.00	0.02

692	603321	梅轮电梯	6,900	39,468.00	0.01
693	603176	汇通集团	9,200	39,376.00	0.01
694	600099	林海股份	4,900	39,102.00	0.01
695	600661	昂立教育	5,600	38,696.00	0.01
696	600692	亚通股份	7,000	38,010.00	0.01
697	600128	苏豪弘业	5,000	37,950.00	0.01
698	603102	百合股份	1,200	37,884.00	0.01
699	600540	新赛股份	11,400	37,734.00	0.01
700	688203	海正生材	3,779	37,714.42	0.01
701	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.01
702	603096	新经典	2,800	37,464.00	0.01
703	603022	新通联	4,600	36,754.00	0.01
703	605567	春雪食品	4,600	36,754.00	0.01
705	688781	视涯科技	837	35,287.92	0.01
706	600272	开开实业	3,400	34,476.00	0.01
707	688307	中润光学	430	34,378.50	0.01
708	600051	宁波联合	6,100	34,343.00	0.01
709	688797	臻宝科技	73	34,212.91	0.01
710	603183	建研院	9,600	34,080.00	0.01
711	600797	浙大网新	5,300	33,920.00	0.01
712	603810	丰山集团	3,000	33,390.00	0.01
713	600497	驰宏锌锗	2,700	32,697.00	0.01
714	603879	永悦科技	7,100	32,092.00	0.01
715	600929	雪天盐业	7,000	31,780.00	0.01
716	605133	嵘泰股份	700	27,559.00	0.01
717	600689	上海三毛	2,800	27,160.00	0.01
718	603758	秦安股份	3,000	26,820.00	0.01
719	688681	科汇股份	1,918	26,813.64	0.01
720	688820	盛合晶微	185	26,175.65	0.01
721	688365	光云科技	1,637	25,815.49	0.01
722	688166	博瑞医药	712	24,927.12	0.01
723	601608	中信重工	5,000	23,850.00	0.01
724	603982	泉峰汽车	4,100	22,919.00	0.01
725	603926	铁流股份	1,200	21,228.00	0.01
726	600663	陆家嘴	3,300	20,724.00	0.01
727	600319	亚星化学	3,100	19,313.00	0.01
728	603026	石大胜华	200	17,874.00	0.01
729	601375	中原证券	4,300	17,157.00	0.01
730	688635	长进光子	51	15,717.69	0.01
731	603518	锦泓集团	2,000	14,300.00	0.01
732	688011	新光光电	200	13,974.00	0.01
733	603115	海星股份	100	12,247.00	0.00
734	688813	泰金新能	66	11,357.94	0.00
735	603032	德新科技	300	8,070.00	0.00

736	688811	有研复材	302	7,287.26	0.00
737	603459	红板科技	61	5,143.52	0.00
738	600203	福日电子	400	4,860.00	0.00
739	603435	嘉德利	61	2,849.31	0.00
740	603293	埃泰克	23	780.39	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	18,227,167.00	6.91
2	601288	农业银行	12,113,549.00	4.59
3	601398	工商银行	11,656,366.00	4.42
4	601857	中国石油	9,693,831.00	3.68
5	600036	招商银行	7,134,885.00	2.71
6	601138	工业富联	7,030,849.00	2.67
7	688041	海光信息	7,027,293.99	2.66
8	688256	寒武纪	6,357,236.07	2.41
9	601628	中国人寿	5,316,466.50	2.02
10	601899	紫金矿业	4,221,942.00	1.60
11	601088	中国神华	3,907,023.00	1.48
12	601318	中国平安	3,754,093.00	1.42
13	600900	长江电力	3,615,710.00	1.37
14	600028	中国石化	3,469,668.00	1.32
15	600000	浦发银行	3,426,971.00	1.30
16	688498	源杰科技	3,304,680.89	1.25
17	601166	兴业银行	3,236,760.00	1.23
18	688072	拓荆科技	3,099,240.57	1.18
19	601963	重庆银行	2,959,155.00	1.12
20	601658	邮储银行	2,906,038.00	1.10

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	6,689,727.00	2.54
2	688256	寒武纪	4,108,919.14	1.56
3	688041	海光信息	3,342,770.58	1.27
4	688498	源杰科技	2,908,409.12	1.10
5	688072	拓荆科技	2,759,579.36	1.05
6	601963	重庆银行	2,742,555.00	1.04

7	688322	奥比中光	2,434,801.07	0.92
8	688981	中芯国际	2,126,273.90	0.81
9	600036	招商银行	1,884,380.00	0.71
10	688183	生益电子	1,761,530.11	0.67
11	688469	芯联集成	1,723,992.40	0.65
12	688002	睿创微纳	1,541,327.13	0.58
13	603986	兆易创新	1,537,619.00	0.58
14	688012	中微公司	1,522,627.23	0.58
15	601138	工业富联	1,508,082.00	0.57
16	688008	澜起科技	1,492,327.19	0.57
17	688027	国盾量子	1,451,682.56	0.55
18	601288	农业银行	1,402,353.00	0.53
19	688036	传音控股	1,334,792.71	0.51
20	600000	浦发银行	1,196,110.12	0.45

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	547,025,013.92
卖出股票收入（成交）总额	224,747,624.88

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）	59,002.69	0.02
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	59,002.69	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	113705	豪 26 转债	350	35,002.30	0.01
2	111025	圣泉转债	100	10,000.11	0.00
3	118072	鼎通转债	70	7,000.18	0.00
4	118071	华峰转债	70	7,000.10	0.00

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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，按照相关法律法规的有关规定，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约来进行投资。为更有效地进行流动性管理，本基金在出现需要及时调整组合市场暴露情况时，通过股指期货套保交易满足基金的投资替代需求和风险管理需求。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金

融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局的处罚。中国神华能源股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京铁路督察室、鄂尔多斯市生态环境局、鄂尔多斯市伊金霍洛旗住房和城乡规划建设局、鄂尔多斯市应急管理局、国家矿山安全监察局陕西局、忻州市应急管理局（忻州市地方煤矿安全监督管理局）、伊金霍洛旗乌兰木伦镇人民政府、伊金霍洛旗自然资源局、榆林市能源局、榆林市生态环境局的处罚。

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

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

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	631,564.80
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	65,714.72
8	其他	-
9	合计	697,279.52

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
10,023	25,760.05	59,046,900.00	22.87%	199,146,100.00	77.13%

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（2026 年 1 月 30 日）基金份额总额	321,193,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	531,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	594,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	258,193,000.00

注：本基金合同生效日为 2026 年 1 月 30 日。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及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，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

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，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

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	
中泰证券	5	770,411,260.73	100.00%	73,883.58	100.00%	-

注：a）本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《公开募集证券投资基金证券交易费用

管理规定》中关于交易佣金分仓的规定。

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

c）本报告期本基金的平均佣金费率为：股票 0.00959%。

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
中泰证券	1,605,873.44	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	易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-31
2	易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-05
3	易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-05
4	易方达上证综合交易型开放式指数证券投资	证券时报	2026-02-05

	基金上市交易公告书提示性公告		
5	易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-10
6	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
7	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	证券时报	2026-04-22
8	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16

§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综合交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

2.《易方达上证综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3.《易方达上证综合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