

易方达上证 580 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
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合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53

7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达上证 580ETF
场内简称	上证 580、上证 580ETF 易方达
基金主代码	530100
交易代码	530100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 10 月 10 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	120,696,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 10 月 22 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588

传真	020-38798812	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510627；510623；519031	100140
法定代表人	吴欣荣	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金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	64,299,677.38
本期利润	67,469,800.41
加权平均基金份额本期利润	0.3493
本期加权平均净值利润率	29.81%
本期基金份额净值增长率	28.17%
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	41,257,234.45
期末可供分配基金份额利润	0.3418
期末基金资产净值	161,953,234.45
期末基金份额净值	1.3418
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	34.18%

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	24.02%	1.61%	22.36%	1.62%	1.66%	-0.01%
过去六个月	28.17%	1.64%	25.94%	1.65%	2.23%	-0.01%
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	34.18%	1.44%	27.71%	1.49%	6.47%	-0.05%

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

易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025 年 10 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日)



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

2.按基金合同和招募说明书的约定，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 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
李博扬	本基金的基金经理，易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证龙头企业指数（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 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	2025-10-10	-	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。

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、易方达上证科创板综合增强策略 ETF、易方达中证 A500 增强策略 ETF 的基金经理助理				
---	--	--	--	--

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

本基金跟踪上证 580 指数，该指数从沪市证券中选取市值规模较小、流动性较好的 580 只证券

作为样本，反映上海证券市场市值较小上市公司证券的整体表现。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2026 年上半年，中国经济延续总体平稳、向新向优的发展态势。根据国家统计局初步核算数据，上半年国内生产总值 695704 亿元，按不变价格计算同比增长 4.7%。外需方面，进出口高速增长，成为重要支撑。上半年，我国货物贸易进出口总额 25.47 万亿元，同比增长 16.9%，历史同期首次突破 25 万亿元大关，表现显著超出市场预期。消费方面，修复斜率平缓，服务消费相对亮眼。上半年，社会消费商品和服务零售总额同比增长 2.7%，其中服务零售额增长 5.3%，商品零售额增长 1.1%。投资方面，整体承压，结构分化明显。上半年，全国固定资产投资（不含农户）同比下降 5.7%，房地产开发投资下降 18.0%，而知识产权产品投资同比增长 9.4%。产业运行方面，工业生产稳中有进，新质生产力加速形成。上半年，全国规模以上工业增加值同比增长 5.4%，其中高技术制造业增加值同比增长 13.3%，产业转型升级成效显著，新动能成为工业增长核心引擎。物价水平方面，上半年，全国居民消费价格指数（CPI）同比上涨 1.0%，物价结束此前持续偏低的局面。总的来看，上半年国民经济运行在合理区间，新质生产力培育壮大，高质量发展向新向优。也要看到，外部不稳定不确定因素较多，国内供强需弱矛盾突出，经济向好基础还需巩固。

资本市场方面，2026 年上半年 A 股市场成交活跃，行情呈现极致结构性分化。在全球 AI 产业周期共振、国内新质生产力政策发力与流动性环境整体宽松的共同驱动下，市场交投热度显著抬升，但资金高度集中于科技成长赛道，传统经济相关板块持续承压，“K 型分化”成为上半年市场最核心的特征。受益于科技成长板块表现，2026 年上半年，上证 580 指数上涨 25.94%。

本报告期涵盖本基金的建仓期，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基金的建仓工作。在基金的正常运作期，本基金坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

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 1.3418 元，本报告期份额净值增长率为 28.17%，同期业绩比较基准收益率为 25.94%。年化跟踪误差 0.71%，在合同约定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，经济运行机遇与挑战并存。下半年，经济增速保持平稳运行具备充足的有利条件，包括存量政策持续显效，增量政策工具储备充足；新质生产力发展势头良好，产业升级红利持续释放；物价环境温和，货币政策空间充裕；PPI 回升带动企业盈利改善等，全年实现经济增长目

标具备坚实基础。基于上半年宏观数据呈现的结构性特征，可重点关注三条主线。一是产业升级主线。高技术制造业 13.3% 的高增速验证了新质生产力的发展趋势，人工智能、半导体、高端装备、新能源等赛道具备长期成长逻辑。二是盈利修复主线。PPI 转正带动工业企业利润增速回升至 18.7%，中游制造业盈利弹性逐步显现。三是政策受益主线。扩内需、稳地产、化债务等政策发力方向对应的受益领域值得关注，包括消费复苏、基建补短板、保障房建设等。

资本市场方面，A 股市场结构性行情的大格局预计仍将延续，但波动可能加大，行情将从“估值抬升”逐步转向“盈利验证”，产业景气度的真实兑现能力将成为决定行情走势的核心。主线方向上，AI 算力、半导体、高端装备等新质生产力核心赛道的长期产业逻辑未变，但也需关注边际变化带来的均衡机会，若下半年扩内需、稳地产政策加码，消费、地产链等深度调整板块可能迎来阶段性修复，PPI 回升带动的中游制造业盈利改善，也存在估值修复空间。

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 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 580 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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	907,197.81	1,326,439.75
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	161,104,857.72	460,335,494.43
其中：股票投资		160,932,850.71	460,230,104.26
基金投资		-	-
债券投资		172,007.01	105,390.17
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		162,072,548.16	461,661,934.18
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		20,808.75	171,391.10
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,816.19	88,368.46
应付托管费		6,938.73	29,456.16
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.23	2.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	70,749.81	12,000.00
负债合计		119,313.71	301,218.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	120,696,000.00	440,696,000.00
未分配利润	6.4.7.8	41,257,234.45	20,664,715.76
净资产合计		161,953,234.45	461,360,715.76
负债和净资产总计		162,072,548.16	461,661,934.18

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 10 月 10 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 10 月 10 日至 2025 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3418 元，基金份额总额 120,696,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		67,822,818.79
1.利息收入		1,295.29

其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,295.29
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）		64,649,083.17
其中：股票投资收益	6.4.7.10	63,342,028.52
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	544,005.21
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	763,049.44
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	3,170,123.03
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	2,317.30
减：二、营业总支出		353,018.38
1. 管理人报酬		170,766.96
2. 托管费		56,922.33
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		0.07
8. 其他费用	6.4.7.18	125,329.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		67,469,800.41
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		67,469,800.41
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		67,469,800.41

注：本基金合同生效日为 2025 年 10 月 10 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 580 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 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	440,696,000.00	20,664,715.76	461,360,715.76
二、本期期初净资产	440,696,000.00	20,664,715.76	461,360,715.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-320,000,000.00	20,592,518.69	-299,407,481.31
（一）、综合收益总额	-	67,469,800.41	67,469,800.41
（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）	-320,000,000.00	-46,877,281.72	-366,877,281.72
其中：1.基金申购款	16,000,000.00	4,383,942.88	20,383,942.88
2.基金赎回款	-336,000,000.00	-51,261,224.60	-387,261,224.60
（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	120,696,000.00	41,257,234.45	161,953,234.45

注：本基金合同生效日为 2025 年 10 月 10 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 580 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1414 号《关于准予易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基

金法》和《易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 10 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 212,696,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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 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

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 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	107,456.50
等于：本金	107,447.14
加：应计利息	9.36
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	799,741.31
等于：本金	799,679.78
加：应计利息	61.53
合计	907,197.81

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		136,579,297.29	-	160,932,850.71	24,353,553.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	171,999.42	7.59	172,007.01	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	171,999.42	7.59	172,007.01	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	136,751,296.71	7.59	161,104,857.72	24,353,553.42

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 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 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	65,458.65
其他应付款	5,291.16
合计	70,749.81

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	440,696,000.00	440,696,000.00
本期申购	16,000,000.00	16,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-336,000,000.00	-336,000,000.00
本期末	120,696,000.00	120,696,000.00

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	20,454,461.90	210,253.86	20,664,715.76
本期期初	20,454,461.90	210,253.86	20,664,715.76
本期利润	64,299,677.38	3,170,123.03	67,469,800.41
本期基金份额交易产生的变动数	-39,070,510.34	-7,806,771.38	-46,877,281.72
其中：基金申购款	4,034,935.33	349,007.55	4,383,942.88
基金赎回款	-43,105,445.67	-8,155,778.93	-51,261,224.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,683,628.94	-4,426,394.49	41,257,234.45

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	402.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	893.09
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,295.29

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 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	20,277,625.12
股票投资收益——赎回差价收入	43,064,403.40
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	63,342,028.52

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 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	107,117,441.05
减：卖出股票成本总额	86,757,596.92
减：交易费用	82,219.01
买卖股票差价收入	20,277,625.12

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 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	387,261,224.60
减：现金支付赎回款总额	1,928,548.60
减：赎回股票成本总额	342,268,272.60
减：交易费用	-
赎回差价收入	43,064,403.40

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1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	18.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	543,987.12
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	544,005.21

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	34,222,283.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,624,726.21
减：应计利息总额	52,218.70
减：交易费用	1,351.88
买卖债券差价收入	543,987.12

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	763,049.44
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	763,049.44

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1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	3,170,123.03
——股票投资	3,208,508.21
——债券投资	-38,385.18
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	3,170,123.03

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 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	2,317.30
合计	2,317.30

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1日至2026年6月30日
审计费用	5,951.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	363.00
其他	59,507.37
合计	125,329.02

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	170,766.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,238.27
应支付基金管理人的净管理费	168,528.69

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	56,922.33

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 3 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	99,998,765.00	82.8518%	407,383,200.00	92.4409%
广发证券股份有限公司	3,369,088.00	2.7914%	7,263,876.00	1.6483%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	107,456.50	402.20

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

约定利率计息。

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 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	963	15,176.88

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
601112	振石 股份	2026-0 1-21	6 个月	新股 流通 受限	11.18	17.59	334	3,734. 12	5,875. 06	-
60328 4	林平 发展	2026-0 2-03	6 个月	新股 流通 受限	37.88	34.87	46	1,742. 48	1,604. 02	-
60329 3	埃泰 克	2026-0 4-09	6 个月	新股 流通 受限	33.49	33.93	40	1,339. 60	1,357. 20	-
60335 2	至信 股份	2026-0 1-08	6 个月	新股 流通 受限	21.88	25.52	112	2,450. 56	2,858. 24	-
60343 5	嘉德 利	2026-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	15.76	46.71	97	1,528. 72	4,530. 87	-
60345	红板	2026-0	6 个月	新股	17.70	84.32	142	2,513.	11,973	-

9	科技	3-31		流通受限				40	.44	
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	85	3,483.30	26,196.15	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,341	23,494.32	48,168.72	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	450	10,206.00	21,424.50	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	95	8,757.10	43,999.25	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	246	28,112.88	166,527.24	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	71	3,163.76	33,275.57	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	51	4,175.88	80,800.83	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	676	4,333.16	16,311.88	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	181	4,756.68	31,148.29	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	127	7,105.65	7,251.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	914	8,655.58	64,107.96	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	321	6,317.28	45,418.29	-
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
11010	宝钛	2026-0	1 个月	新发	100.00	100.00	790	79,000	79,001	-

1	转债	6-25	内 (含)	流通 受限				.00	.04	
11370 3	翔 26 转债	2026-0 6-09	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.01	210	21,000 .00	21,002 .03	-
11370 5	豪 26 转债	2026-0 6-16	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.01	520	52,000 .00	52,003 .42	-
11807 2	鼎通 转债	2026-0 6-25	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.00	200	20,000 .00	20,000 .52	-

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
60136 9	陕鼓动 力	2026-06 -29	重大事 项停牌	9.05	2026-0 7-13	9.96	25,200	226,752.22	228,060.00	-

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，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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 0.11%(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 2026年6月30日	上年度末 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 2026年6月30日	上年度末 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 2026年6月30日	上年度末 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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	79,001.04	0.00
AAA 以下	93,005.97	105,390.17
未评级	0.00	0.00
合计	172,007.01	105,390.17

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

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	上年度末 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 2026年6月30日	上年度末 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 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	907,197.81	-	-	-	907,197.81
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	172,007.01	160,932,850.71	161,104,857.72
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	907,197.81	-	172,007.01	160,993,343.34	162,072,548.16
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	-	-	-	20,808.75	20,808.75
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	20,816.19	20,816.19
应付托管费	-	-	-	6,938.73	6,938.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.23	0.23
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	70,749.81	70,749.81
负债总计	-	-	-	119,313.71	119,313.71
利率敏感度缺口	907,197.81	-	172,007.01	160,874,029.63	161,953,234.4

					5
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,326,439.75	-	-	-	1,326,439.75
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	105,390.17	460,230,104.26	460,335,494.43
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,326,439.75	-	105,390.17	460,230,104.26	461,661,934.18
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	171,391.10	171,391.10
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	88,368.46	88,368.46
应付托管费	-	-	-	29,456.16	29,456.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2.70	2.70
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	12,000.00	12,000.00
负债总计	-	-	-	301,218.42	301,218.42
利率敏感度缺口	1,326,439.75	-	105,390.17	459,928,885.84	461,360,715.7

					6
--	--	--	--	--	---

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		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	160,932,850.71	99.37	460,230,104.26	99.75
交易性金融资产—债券投资	172,007.01	0.11	-	-
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	161,104,857.72	99.48	460,230,104.26	99.75

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	8,030,675.45	23,017,884.48
	2.业绩比较基准下降 5%	-8,030,675.45	-23,017,884.48

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	160,091,961.50
第二层次	400,067.01
第三层次	612,829.21
合计	161,104,857.72

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	160,932,850.71	99.30
	其中：股票	160,932,850.71	99.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	172,007.01	0.11
	其中：债券	172,007.01	0.11
	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	907,197.81	0.56
8	其他各项资产	60,492.63	0.04
9	合计	162,072,548.16	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

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	519,055.00	0.32
B	采矿业	1,526,832.00	0.94
C	制造业	120,646,758.39	74.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,132,198.20	2.55
E	建筑业	2,440,932.00	1.51

F	批发和零售业	2,842,768.00	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	4,436,160.32	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,954,399.22	8.62
J	金融业	3,078,939.93	1.90
K	房地产业	1,583,218.00	0.98
L	租赁和商务服务业	944,691.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	2,742,245.65	1.69
N	水利、环境和公共设施管理业	1,089,170.00	0.67
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	995,483.00	0.61
S	综合	-	-
	合计	160,932,850.71	99.37

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	688766	普冉股份	3,680	2,821,088.00	1.74
2	688048	长光华芯	4,277	2,147,054.00	1.33
3	601208	东材科技	29,300	2,074,147.00	1.28
4	688627	精智达	2,820	2,016,300.00	1.24
5	605376	博迁新材	6,700	1,817,710.00	1.12
6	600869	远东股份	48,300	1,616,601.00	1.00
7	688167	炬光科技	4,554	1,613,072.34	1.00
8	688519	南亚新材	4,038	1,534,601.52	0.95
9	688141	杰华特	9,916	1,522,106.00	0.94
10	688548	广钢气体	28,568	1,488,392.80	0.92
11	600206	有研新材	21,500	1,431,900.00	0.88
12	600330	天通股份	44,700	1,378,548.00	0.85
13	603306	华懋科技	12,000	1,244,280.00	0.77
14	688025	杰普特	2,492	1,171,240.00	0.72
15	688403	汇成股份	28,614	1,135,975.80	0.70
16	688362	甬矽电子	11,433	1,102,141.20	0.68
17	688668	鼎通科技	2,829	1,056,065.70	0.65
18	603629	利通电子	5,700	1,019,217.00	0.63

19	688503	聚和材料	7,166	950,928.20	0.59
20	603186	华正新材	4,100	923,730.00	0.57
21	688257	新锐股份	9,006	917,711.40	0.57
22	603061	金海通	1,800	903,996.00	0.56
23	600552	凯盛科技	27,400	892,692.00	0.55
24	688545	兴福电子	6,605	878,861.30	0.54
25	688372	伟测科技	4,651	865,086.00	0.53
26	688195	腾景科技	4,415	850,240.70	0.52
27	603929	亚翔集成	3,100	843,262.00	0.52
28	688300	联瑞新材	3,417	835,114.80	0.52
29	688596	正帆科技	10,501	830,209.06	0.51
30	600353	旭光电子	18,100	825,360.00	0.51
31	688549	中巨芯	21,510	791,783.10	0.49
32	688205	德科立	3,786	788,207.34	0.49
33	688233	神工股份	3,626	777,486.92	0.48
34	603663	三祥新材	7,600	731,880.00	0.45
35	600186	莲花控股	51,900	726,600.00	0.45
36	600226	亨通股份	75,400	723,086.00	0.45
37	688652	京仪装备	3,574	715,407.58	0.44
38	688392	骄成超声	3,132	711,527.76	0.44
39	688531	日联科技	3,970	706,024.80	0.44
40	600114	东睦股份	18,400	694,784.00	0.43
41	603738	泰晶科技	11,100	666,555.00	0.41
42	688102	斯瑞新材	14,067	663,681.06	0.41
43	603667	五洲新春	9,800	642,096.00	0.40
44	688268	华特气体	2,393	640,127.50	0.40
45	600410	华胜天成	39,800	630,034.00	0.39
46	600961	株冶集团	19,400	628,366.00	0.39
47	688559	海目星	7,354	617,147.68	0.38
48	603124	江南新材	3,200	598,336.00	0.37
49	688502	茂莱光学	858	595,108.80	0.37
50	688507	索辰科技	2,172	585,744.96	0.36
51	688028	沃尔德	3,756	585,447.72	0.36
52	688400	凌云光	8,658	573,159.60	0.35
53	688772	珠海冠宇	28,605	561,516.15	0.35
54	688535	华海诚科	2,989	558,943.00	0.35
55	600596	新安股份	34,100	544,236.00	0.34
56	600388	龙净环保	37,000	538,350.00	0.33
57	688432	有研硅	13,431	536,837.07	0.33
58	603026	石大胜华	5,900	527,283.00	0.33
59	603876	鼎胜新材	20,200	525,402.00	0.32
60	688059	华锐精密	2,622	523,639.62	0.32
61	688359	三孚新科	2,589	513,761.16	0.32
62	688150	莱特光电	7,478	513,140.36	0.32

63	603031	安孚科技	9,595	510,933.75	0.32
64	688097	博众精工	7,988	503,643.40	0.31
65	603936	博敏电子	18,800	502,148.00	0.31
66	603002	宏昌电子	20,500	495,485.00	0.31
67	688368	晶丰明源	2,288	495,397.76	0.31
68	601678	滨化股份	74,700	492,273.00	0.30
69	688380	中微半导	7,436	490,106.76	0.30
70	688515	裕太微	1,950	485,082.00	0.30
71	601918	新集能源	56,400	484,476.00	0.30
72	688158	优刻得	13,163	483,871.88	0.30
73	600201	生物股份	40,200	468,330.00	0.29
74	688327	云从科技	37,585	468,309.10	0.29
75	601778	晶科科技	108,200	465,260.00	0.29
76	688319	欧林生物	10,484	461,086.32	0.28
77	688401	路维光电	4,768	457,632.64	0.28
78	600531	豫光金铅	30,700	453,132.00	0.28
79	688661	和林微纳	2,844	452,139.12	0.28
80	605020	永和股份	11,000	447,920.00	0.28
81	600155	华创云信	80,400	443,808.00	0.27
82	601975	招商南油	118,800	443,124.00	0.27
83	600877	电科芯片	25,700	440,241.00	0.27
84	688003	天准科技	3,438	437,657.40	0.27
85	688279	峰岬科技	1,925	432,047.00	0.27
86	688001	华兴源创	5,020	430,214.00	0.27
87	688262	国芯科技	9,859	426,204.57	0.26
88	688206	概伦电子	9,577	424,931.49	0.26
89	688603	天承科技	2,027	421,514.65	0.26
90	688332	中科蓝讯	2,674	421,155.00	0.26
91	603011	合锻智能	12,600	416,808.00	0.26
92	688352	顾中科技	17,167	415,098.06	0.26
93	600366	宁波韵升	28,100	412,508.00	0.25
94	603078	江化微	8,300	410,186.00	0.25
95	603301	振德医疗	4,700	409,652.00	0.25
96	600151	航天机电	36,500	409,530.00	0.25
97	600179	安通控股	92,200	405,680.00	0.25
98	600063	皖维高新	52,500	399,000.00	0.25
98	601375	中原证券	100,000	399,000.00	0.25
100	688726	拉普拉斯	7,538	398,383.30	0.25
101	688275	万润新能	3,106	396,170.30	0.24
102	688593	新相微	10,145	394,843.40	0.24
103	603938	三孚股份	5,500	394,075.00	0.24
104	600345	长江通信	6,000	393,060.00	0.24
105	600550	保变电气	33,500	392,955.00	0.24
106	605289	罗曼股份	2,700	391,500.00	0.24

107	688757	胜科纳米	5,837	389,327.90	0.24
108	603950	长源东谷	4,600	388,378.00	0.24
109	600872	中炬高新	22,300	387,128.00	0.24
110	600343	航天动力	13,800	386,676.00	0.24
111	688518	联赢激光	12,442	384,457.80	0.24
112	600986	浙文互联	54,100	377,618.00	0.23
113	688605	先锋精科	3,589	373,327.78	0.23
114	603358	华达科技	8,500	369,750.00	0.23
115	600416	湘电股份	37,300	365,540.00	0.23
116	603203	快克智能	4,730	363,169.40	0.22
117	603800	洪田股份	4,400	357,676.00	0.22
118	600821	金开新能	57,200	357,500.00	0.22
119	603662	柯力传感	5,000	355,850.00	0.22
120	603009	北特科技	7,400	354,978.00	0.22
121	603601	再升科技	28,900	354,892.00	0.22
122	688258	卓易信息	2,975	352,656.50	0.22
123	688508	芯朋微	3,767	350,180.32	0.22
124	688353	华盛锂电	2,987	346,701.09	0.21
125	603859	能科科技	7,200	345,456.00	0.21
126	600867	通化东宝	42,800	344,112.00	0.21
127	688031	星环科技	2,975	342,660.50	0.21
128	605196	华通线缆	13,000	339,300.00	0.21
129	601333	广深铁路	122,900	337,975.00	0.21
130	601609	金田股份	31,200	336,960.00	0.21
131	600184	光电股份	10,500	336,105.00	0.21
132	600739	辽宁成大	33,200	335,652.00	0.21
133	600458	时代新材	20,200	334,310.00	0.21
134	688063	派能科技	6,266	333,789.82	0.21
135	600728	佳都科技	77,400	329,724.00	0.20
136	603997	继峰股份	27,800	328,874.00	0.20
137	603319	美湖股份	9,900	328,779.00	0.20
138	688239	航宇科技	5,474	327,509.42	0.20
139	600490	鹏欣资源	56,200	327,084.00	0.20
140	688556	高测股份	24,143	320,619.04	0.20
141	600619	海立股份	20,000	317,000.00	0.20
142	688625	呈和科技	3,732	315,018.12	0.19
143	688383	新益昌	1,673	314,590.92	0.19
144	688717	艾罗能源	3,808	314,426.56	0.19
145	688691	灿芯股份	2,697	312,663.21	0.19
146	603323	苏农银行	80,510	311,573.70	0.19
147	688088	虹软科技	8,703	309,391.65	0.19
148	600267	海正药业	30,600	309,366.00	0.19
149	600133	东湖高新	38,700	305,730.00	0.19
150	603989	艾华集团	5,800	304,500.00	0.19

151	688382	益方生物	16,676	300,168.00	0.19
152	600635	大众公用	70,100	300,028.00	0.19
153	601963	重庆银行	29,700	299,376.00	0.18
154	600702	舍得酒业	8,400	298,620.00	0.18
155	600320	振华重工	72,200	298,186.00	0.18
156	603698	航天工程	7,700	296,912.00	0.18
157	688376	美埃科技	2,533	294,587.90	0.18
158	600509	天富能源	34,800	294,060.00	0.18
159	688321	微芯生物	11,156	293,737.48	0.18
160	688798	艾为电子	3,995	292,913.40	0.18
161	603638	艾迪精密	12,444	291,811.80	0.18
162	688261	东微半导	2,755	289,082.15	0.18
163	603589	口子窖	15,200	283,936.00	0.18
164	600908	无锡银行	55,700	282,956.00	0.17
165	603858	步长制药	19,300	281,780.00	0.17
166	600456	宝钛股份	10,300	281,705.00	0.17
167	688108	赛诺医疗	15,195	281,563.35	0.17
168	688428	诺诚健华	9,840	280,144.80	0.17
169	688222	成都先导	8,690	279,035.90	0.17
170	688567	孚能科技	26,567	278,953.50	0.17
171	600391	航发科技	8,300	277,635.00	0.17
172	688612	威迈斯	9,147	270,659.73	0.17
173	688584	上海合晶	7,459	268,151.05	0.17
174	601005	重庆钢铁	230,400	267,264.00	0.17
175	688107	安路科技	5,796	264,297.60	0.16
176	600528	中铁工业	40,100	264,259.00	0.16
177	600959	江苏有线	90,600	261,834.00	0.16
178	600859	王府井	28,400	260,712.00	0.16
179	688191	智洋创新	7,296	260,467.20	0.16
180	603757	大元泵业	3,400	257,584.00	0.16
181	601860	紫金银行	106,200	257,004.00	0.16
182	600326	西藏天路	39,700	256,859.00	0.16
183	600461	洪城环境	28,100	254,586.00	0.16
184	603337	杰克科技	7,000	253,610.00	0.16
185	600113	浙江东日	7,600	252,168.00	0.16
186	600572	康恩贝	64,300	252,056.00	0.16
187	600629	华建集团	20,780	251,645.80	0.16
188	601133	柏诚股份	5,700	251,028.00	0.16
189	688686	奥普特	1,490	250,901.10	0.15
190	600718	东软集团	34,576	250,330.24	0.15
191	603220	中贝通信	11,700	250,029.00	0.15
192	600621	华鑫股份	19,300	249,356.00	0.15
193	603713	密尔克卫	3,500	249,095.00	0.15
194	600973	宝胜股份	34,700	246,023.00	0.15

195	600389	江山股份	12,600	245,952.00	0.15
196	688591	泰凌微	7,150	245,817.00	0.15
197	688062	迈威生物	8,664	244,758.00	0.15
198	688035	德邦科技	2,664	244,555.20	0.15
199	600478	科力远	48,500	244,440.00	0.15
200	600361	创新新材	67,700	243,720.00	0.15
201	688202	美迪西	3,019	243,663.49	0.15
202	600062	华润双鹤	15,100	242,204.00	0.15
203	600835	上海机电	11,718	241,390.80	0.15
204	600022	山东钢铁	194,200	240,808.00	0.15
205	600056	中国医药	27,200	238,000.00	0.15
206	600744	华银电力	37,000	237,910.00	0.15
207	600797	浙大网新	37,100	237,440.00	0.15
208	600864	哈投股份	45,400	235,626.00	0.15
209	688386	泛亚微透	2,612	234,662.08	0.14
210	603530	神马电力	4,600	234,140.00	0.14
211	603985	恒润股份	9,700	232,994.00	0.14
212	688049	炬芯科技	4,965	232,908.15	0.14
213	688325	赛微微电	1,772	231,086.52	0.14
214	688787	海天瑞声	1,716	230,716.20	0.14
215	600771	广誉远	17,800	230,510.00	0.14
216	688277	天智航	13,408	229,276.80	0.14
217	600645	中源协和	13,400	229,274.00	0.14
218	600255	鑫科材料	65,600	228,288.00	0.14
219	688418	震有科技	4,745	228,139.60	0.14
220	603683	晶华新材	7,400	228,068.00	0.14
221	601369	陕鼓动力	25,200	228,060.00	0.14
222	603328	依顿电子	18,200	228,046.00	0.14
223	600198	大唐电信	23,600	227,740.00	0.14
224	601619	嘉泽新能	52,800	227,040.00	0.14
225	688209	英集芯	7,723	224,584.84	0.14
226	688306	均普智能	22,066	222,866.60	0.14
227	603040	新坐标	3,525	222,321.75	0.14
228	605305	中际联合	5,300	222,176.00	0.14
229	600037	歌华有线	35,300	221,331.00	0.14
230	603977	国泰集团	13,400	221,234.00	0.14
231	688523	航天环宇	4,222	221,232.80	0.14
232	600623	华谊集团	27,400	221,118.00	0.14
233	600480	凌云股份	26,600	221,046.00	0.14
234	688125	安达智能	1,351	220,888.50	0.14
235	601101	昊华能源	20,900	220,704.00	0.14
236	603297	永新光学	1,500	220,425.00	0.14
237	600590	泰豪科技	21,800	220,180.00	0.14
238	603052	可川科技	2,700	218,673.00	0.14

239	688337	普源精电	2,905	217,671.65	0.13
240	600268	国电南自	18,500	214,970.00	0.13
241	600827	百联股份	29,000	214,890.00	0.13
242	688499	利元亨	4,080	214,404.00	0.13
243	688550	瑞联新材	3,706	214,392.10	0.13
244	600783	鲁信创投	10,700	213,144.00	0.13
245	688543	国科军工	5,388	212,556.60	0.13
246	688068	热景生物	2,432	210,611.20	0.13
247	603194	中力股份	5,760	210,585.60	0.13
248	603360	百傲化学	12,900	210,012.00	0.13
249	688486	龙迅股份	3,298	209,686.84	0.13
250	605507	国邦医药	14,140	209,272.00	0.13
251	603181	皇马科技	12,900	209,238.00	0.13
252	600587	新华医疗	17,600	209,088.00	0.13
253	600475	华光环能	13,700	208,925.00	0.13
254	600203	福日电子	17,100	207,765.00	0.13
255	603118	共进股份	17,100	207,081.00	0.13
256	688138	清溢光电	4,380	205,860.00	0.13
257	603887	城地香江	22,000	205,480.00	0.13
258	688611	杭州柯林	2,873	205,275.85	0.13
259	600315	上海家化	12,200	205,204.00	0.13
260	688789	宏华数科	3,850	204,704.50	0.13
261	603809	豪能股份	23,300	204,341.00	0.13
262	605060	联德股份	3,600	204,264.00	0.13
263	600779	水井坊	7,200	204,048.00	0.13
264	600651	飞乐音响	36,500	204,035.00	0.13
265	605123	派克新材	2,100	203,721.00	0.13
266	600717	天津港	52,300	203,447.00	0.13
267	600556	天下秀	46,000	203,320.00	0.13
268	688160	步科股份	1,868	203,182.36	0.13
269	688153	唯捷创芯	6,281	201,745.72	0.12
270	605133	嵘泰股份	5,100	200,787.00	0.12
271	603169	兰石重装	28,300	200,364.00	0.12
272	688685	迈信林	3,649	200,330.10	0.12
273	601890	亚星锚链	24,500	200,165.00	0.12
274	603039	泛微网络	5,540	199,827.80	0.12
275	688698	伟创电气	3,807	199,677.15	0.12
276	600103	青山纸业	65,000	199,550.00	0.12
277	601929	吉视传媒	88,600	197,578.00	0.12
278	605168	三人行	3,900	197,496.00	0.12
279	600787	中储股份	47,200	197,296.00	0.12
280	600770	综艺股份	28,100	196,700.00	0.12
281	601568	北元化工	57,800	196,520.00	0.12
282	603686	福龙马	15,100	195,092.00	0.12

283	688305	科德数控	2,987	194,961.49	0.12
284	603533	掌阅科技	9,600	194,784.00	0.12
285	688165	埃夫特	9,533	194,473.20	0.12
286	600420	国药现代	24,400	193,980.00	0.12
287	605016	百龙创园	7,500	193,875.00	0.12
288	605128	上海沿浦	7,940	192,465.60	0.12
289	605389	长龄液压	2,000	192,000.00	0.12
290	688155	先惠技术	2,368	191,547.52	0.12
291	600502	安徽建工	43,500	189,225.00	0.12
292	600996	贵广网络	27,200	188,768.00	0.12
293	600158	中体产业	28,000	188,720.00	0.12
294	600094	大名城	54,100	187,186.00	0.12
295	603496	恒为科技	8,100	186,138.00	0.11
296	600339	中油工程	60,600	186,042.00	0.11
297	603826	坤彩科技	7,200	184,032.00	0.11
298	600764	中国海防	10,500	183,015.00	0.11
299	600710	苏美达	19,100	182,596.00	0.11
300	600058	五矿发展	15,700	181,335.00	0.11
301	600789	鲁抗医药	26,500	180,465.00	0.11
302	600496	精工钢构	57,900	179,490.00	0.11
303	688182	灿勤科技	4,154	178,912.78	0.11
304	688710	益诺思	2,640	177,408.00	0.11
305	600266	城建发展	45,300	177,123.00	0.11
306	600686	金龙汽车	15,680	177,027.20	0.11
307	688190	云路股份	1,950	176,884.50	0.11
308	600106	重庆路桥	38,600	176,788.00	0.11
309	688788	科思科技	3,906	175,691.88	0.11
310	688510	航亚科技	7,355	175,637.40	0.11
311	603171	税友股份	4,400	175,340.00	0.11
312	688046	药康生物	7,234	175,062.80	0.11
313	688583	思看科技	2,037	174,713.49	0.11
314	688226	威腾电气	4,040	173,033.20	0.11
315	688091	上海谊众	4,302	172,940.40	0.11
316	688326	经纬恒润	2,437	172,734.56	0.11
317	601969	海南矿业	21,700	171,647.00	0.11
318	603100	川仪股份	9,400	169,670.00	0.10
319	600736	苏州高新	25,300	169,257.00	0.10
320	600269	赣粤高速	42,500	169,150.00	0.10
321	600059	古越龙山	23,100	169,092.00	0.10
322	603368	柳药集团	11,500	168,705.00	0.10
323	600125	铁龙物流	33,200	168,324.00	0.10
324	688707	振华新材	13,051	167,705.35	0.10
325	600108	亚盛集团	56,500	167,240.00	0.10
325	603477	巨星农牧	11,300	167,240.00	0.10

327	600017	日照港	66,800	167,000.00	0.10
328	600654	中安科	62,700	166,782.00	0.10
329	688795	摩尔线程	246	166,527.24	0.10
330	603112	华翔股份	9,900	165,627.00	0.10
331	600575	淮河能源	51,800	165,242.00	0.10
332	688660	电气风电	19,141	164,995.42	0.10
333	603668	天马科技	13,000	164,580.00	0.10
334	601326	秦港股份	51,900	164,004.00	0.10
335	600664	哈药股份	54,800	163,852.00	0.10
336	603227	雪峰科技	23,300	163,566.00	0.10
337	600751	海航科技	56,000	162,960.00	0.10
338	600775	南京熊猫	17,000	162,520.00	0.10
339	600757	长江传媒	22,200	162,282.00	0.10
340	688758	赛分科技	7,367	162,147.67	0.10
341	601200	上海环境	24,500	161,700.00	0.10
342	688621	阳光诺和	2,936	161,215.76	0.10
343	600033	福建高速	49,700	160,034.00	0.10
344	600928	西安银行	48,500	158,595.00	0.10
345	600307	酒钢宏兴	113,800	158,182.00	0.10
346	600055	万东医疗	15,400	157,388.00	0.10
347	688210	统联精密	3,884	157,340.84	0.10
348	600649	城投控股	45,600	157,320.00	0.10
349	603166	福达股份	11,700	156,429.00	0.10
350	688007	光峰科技	11,636	154,758.80	0.10
351	601686	友发集团	32,000	154,560.00	0.10
352	605599	莱百股份	11,200	153,440.00	0.09
353	600935	华塑股份	65,200	153,220.00	0.09
354	605488	福莱新材	5,400	153,144.00	0.09
355	600597	光明乳业	25,200	152,964.00	0.09
356	688185	康希诺	2,999	152,919.01	0.09
357	603072	天和磁材	3,900	152,880.00	0.09
358	603992	松霖科技	4,717	152,830.80	0.09
359	600305	恒顺醋业	24,100	152,071.00	0.09
360	603279	景津装备	12,600	151,200.00	0.09
361	600971	恒源煤电	21,900	151,110.00	0.09
362	603197	保隆科技	5,400	150,876.00	0.09
363	603033	三维股份	15,000	150,600.00	0.09
364	600611	大众交通	39,900	150,423.00	0.09
365	603508	思维列控	7,000	149,520.00	0.09
366	600882	妙可蓝多	9,300	148,707.00	0.09
367	600006	东风股份	28,900	148,257.00	0.09
368	688408	中信博	4,607	148,115.05	0.09
369	603416	信捷电气	2,800	148,036.00	0.09
370	600501	航天晨光	9,400	147,862.00	0.09

371	603125	常青科技	4,500	147,330.00	0.09
372	601163	三角轮胎	11,600	147,204.00	0.09
373	603050	科林电气	7,500	146,700.00	0.09
374	600557	康缘药业	12,400	145,948.00	0.09
375	600592	龙溪股份	10,300	145,848.00	0.09
376	600251	冠农股份	16,800	145,152.00	0.09
377	600855	航天长峰	10,400	144,664.00	0.09
378	688553	汇宇制药	13,531	143,834.53	0.09
379	600163	中闽能源	27,800	143,170.00	0.09
380	603128	华贸物流	28,300	142,915.00	0.09
381	600252	中恒集团	81,000	142,560.00	0.09
382	688252	天德钰	5,931	142,344.00	0.09
383	600510	黑牡丹	18,900	140,994.00	0.09
384	688093	世华科技	3,814	140,736.60	0.09
385	601900	南方传媒	12,900	140,094.00	0.09
386	605222	起帆电缆	6,000	139,920.00	0.09
387	688696	极米科技	2,166	139,793.64	0.09
388	688377	迪威尔	5,926	139,735.08	0.09
389	603969	银龙股份	19,107	138,907.89	0.09
390	600167	联美控股	24,800	138,632.00	0.09
391	600966	博汇纸业	29,000	138,620.00	0.09
392	600477	杭萧钢构	60,000	138,600.00	0.09
393	605598	上海港湾	3,600	138,348.00	0.09
394	605277	新亚电子	7,200	137,232.00	0.08
395	600138	中青旅	21,000	137,130.00	0.08
396	688513	苑东生物	3,105	136,495.80	0.08
397	601388	怡球资源	48,000	135,840.00	0.08
398	603223	恒通股份	10,400	135,720.00	0.08
399	688776	国光电气	2,202	135,070.68	0.08
400	603162	海通发展	14,956	134,155.32	0.08
401	601789	宁波建工	33,300	133,533.00	0.08
402	688586	江航装备	11,422	133,523.18	0.08
403	600425	青松建化	40,700	133,089.00	0.08
404	600812	华北制药	30,900	131,943.00	0.08
405	600313	农发种业	25,100	131,524.00	0.08
406	601886	江河集团	16,300	130,889.00	0.08
407	600571	信雅达	13,400	130,650.00	0.08
408	600708	光明地产	40,300	129,363.00	0.08
409	603271	永杰新材	2,900	128,905.00	0.08
410	603367	辰欣药业	10,000	128,300.00	0.08
411	603861	白云电器	9,900	127,809.00	0.08
412	601579	会稽山	8,700	127,803.00	0.08
413	688658	悦康药业	9,908	127,416.88	0.08
414	603131	上海沪工	7,477	127,258.54	0.08

415	600605	汇通能源	4,400	127,248.00	0.08
416	688697	纽威数控	9,348	127,039.32	0.08
417	605088	冠盛股份	4,500	126,810.00	0.08
418	601096	宏盛华源	29,100	126,294.00	0.08
419	600682	南京新百	24,500	126,175.00	0.08
420	688095	福昕软件	2,119	125,932.17	0.08
421	601500	通用股份	34,500	125,925.00	0.08
422	600748	上实发展	33,600	124,992.00	0.08
423	600693	东百集团	15,900	124,656.00	0.08
424	688522	纳睿雷达	6,178	123,683.56	0.08
425	688443	智翔金泰	5,266	122,434.50	0.08
426	600780	通宝能源	20,800	121,888.00	0.08
427	603093	南华期货	6,700	121,605.00	0.08
428	600810	神马股份	19,700	121,549.00	0.08
429	600284	浦东建设	24,800	120,528.00	0.07
430	603299	苏盐井神	13,700	120,423.00	0.07
431	605198	安德利	1,900	120,384.00	0.07
432	600020	中原高速	32,600	120,294.00	0.07
433	688365	光云科技	7,559	119,205.43	0.07
434	600468	百利电气	19,600	118,972.00	0.07
435	600742	富维股份	16,400	118,736.00	0.07
436	600610	中毅达	18,100	118,555.00	0.07
437	600713	南京医药	23,700	118,500.00	0.07
438	600874	创业环保	22,100	118,456.00	0.07
439	600894	广日股份	15,500	118,110.00	0.07
440	600975	新五丰	27,300	117,663.00	0.07
441	603229	奥翔药业	15,100	116,874.00	0.07
442	603383	顶点软件	4,400	116,864.00	0.07
443	600963	岳阳林纸	38,200	116,128.00	0.07
444	688577	浙海德曼	2,533	116,087.39	0.07
445	603636	南威软件	14,700	115,983.00	0.07
446	601107	四川成渝	23,500	114,680.00	0.07
447	603123	翠微股份	14,400	113,904.00	0.07
448	600576	祥源文旅	19,300	113,870.00	0.07
449	603132	金徽股份	7,300	113,734.00	0.07
450	688351	微电生理	5,008	113,481.28	0.07
451	605319	无锡振华	5,000	113,450.00	0.07
452	688750	金天钛业	6,811	113,266.93	0.07
453	600639	浦东金桥	12,400	113,088.00	0.07
454	600846	同济科技	11,300	113,000.00	0.07
455	600987	航民股份	18,600	112,530.00	0.07
456	688562	航天软件	7,428	111,865.68	0.07
457	603919	金徽酒	7,400	111,370.00	0.07
458	601515	衢州东峰	34,798	111,353.60	0.07

459	600903	贵州燃气	16,755	111,253.20	0.07
460	600640	国脉文化	11,500	111,205.00	0.07
461	601177	杭齿前进	8,900	110,449.00	0.07
462	688311	盟升电子	4,205	110,128.95	0.07
463	600195	中牧股份	18,600	109,740.00	0.07
464	600997	开滦股份	23,000	109,250.00	0.07
465	601921	浙版传媒	16,300	109,047.00	0.07
466	601339	百隆东方	16,100	108,997.00	0.07
467	600929	雪天盐业	23,800	108,052.00	0.07
468	688225	亚信安全	8,674	107,731.08	0.07
469	600508	上海能源	14,600	107,602.00	0.07
470	688228	开普云	1,390	107,502.60	0.07
471	603855	华荣股份	6,200	107,446.00	0.07
472	600643	爱建集团	28,813	106,896.23	0.07
473	688230	芯导科技	1,356	106,866.36	0.07
474	601226	华电科工	16,700	106,212.00	0.07
475	688626	翔宇医疗	2,397	106,091.22	0.07
476	601801	皖新传媒	21,400	105,502.00	0.07
477	688539	高华科技	3,281	104,598.28	0.06
478	600990	四创电子	5,900	104,017.00	0.06
479	601330	绿色动力	14,900	103,853.00	0.06
480	688639	华恒生物	6,428	103,747.92	0.06
481	600217	中再资环	36,200	102,084.00	0.06
482	603043	广州酒家	8,200	101,680.00	0.06
483	600335	国机汽车	21,700	101,556.00	0.06
484	603590	康辰药业	3,500	101,535.00	0.06
485	600604	市北高新	25,400	101,346.00	0.06
486	688552	航天南湖	3,588	100,930.44	0.06
487	600197	伊力特	10,500	100,800.00	0.06
488	600644	乐山电力	12,700	100,330.00	0.06
489	688656	浩欧博	1,032	99,866.64	0.06
490	688128	中国电研	4,192	99,518.08	0.06
491	600861	北京人力	8,100	98,820.00	0.06
492	688109	品茗科技	1,297	98,182.90	0.06
493	603057	紫燕食品	4,400	98,120.00	0.06
494	600368	五洲交通	29,100	97,485.00	0.06
495	601949	中国出版	20,700	96,255.00	0.06
496	603327	福蓉科技	11,300	95,824.00	0.06
497	601083	锦江航运	9,500	94,430.00	0.06
498	605056	咸亨国际	5,900	94,400.00	0.06
499	603257	中国瑞林	1,200	93,588.00	0.06
500	688648	中邮科技	2,547	93,092.85	0.06
501	600603	广汇物流	21,400	93,090.00	0.06
502	600223	福瑞达	18,500	93,055.00	0.06

503	600841	动力新科	15,200	92,720.00	0.06
504	600826	兰生股份	10,500	92,295.00	0.06
505	600403	大有能源	17,300	91,517.00	0.06
506	601968	宝钢包装	23,100	90,552.00	0.06
507	605183	确成股份	6,100	89,914.00	0.06
508	603567	珍宝岛	20,500	89,790.00	0.06
509	601008	连云港	22,300	89,646.00	0.06
510	605555	德昌股份	7,160	89,500.00	0.06
511	600897	厦门空港	6,100	89,060.00	0.05
512	688348	昱能科技	2,540	88,341.20	0.05
513	603418	友升股份	2,000	88,340.00	0.05
514	600825	新华传媒	19,100	86,332.00	0.05
515	603366	日出东方	11,800	85,786.00	0.05
516	603866	桃李面包	23,200	85,376.00	0.05
517	605116	奥锐特	4,500	85,140.00	0.05
518	688276	百克生物	6,007	83,737.58	0.05
519	603202	天有为	1,700	83,538.00	0.05
520	603193	润本股份	4,500	83,475.00	0.05
521	601512	中新集团	10,700	83,460.00	0.05
522	601089	福元医药	5,100	83,028.00	0.05
523	601038	一拖股份	7,800	82,602.00	0.05
524	603693	江苏新能	6,500	81,835.00	0.05
525	603983	丸美生物	2,900	81,606.00	0.05
526	600618	氯碱化工	8,100	81,405.00	0.05
527	603098	森特股份	7,700	81,235.00	0.05
528	688808	联讯仪器	51	80,800.83	0.05
529	600724	宁波富达	15,900	80,613.00	0.05
530	688232	新点软件	4,499	79,992.22	0.05
531	605368	蓝天燃气	13,100	79,910.00	0.05
532	603312	西典新能	2,300	78,154.00	0.05
533	603173	福斯达	2,300	77,970.00	0.05
534	601116	三江购物	7,800	76,986.00	0.05
535	603055	台华新材	9,800	76,342.00	0.05
536	600278	东方创业	12,600	74,088.00	0.05
537	688136	科兴制药	3,568	73,893.28	0.05
538	600981	苏豪汇鸿	32,500	73,125.00	0.05
539	603121	华培动力	6,200	72,850.00	0.04
540	688177	百奥泰	4,311	72,511.02	0.04
541	605009	豪悦护理	3,100	72,261.00	0.04
542	600657	信达地产	31,100	71,841.00	0.04
543	603069	海汽集团	5,700	71,535.00	0.04
544	603248	锡华科技	3,360	70,862.40	0.04
545	603489	八方股份	2,500	69,900.00	0.04
546	603402	陕西旅游	1,160	68,614.00	0.04

547	605050	福然德	7,300	68,328.00	0.04
548	601026	道生天合	4,600	67,068.00	0.04
549	600746	江苏索普	12,800	66,944.00	0.04
550	605296	神农集团	2,400	66,912.00	0.04
551	605118	力鼎光电	1,900	66,291.00	0.04
552	600429	三元股份	16,200	65,448.00	0.04
553	603219	富佳股份	4,200	65,436.00	0.04
554	601003	柳钢股份	19,300	65,041.00	0.04
555	688818	电科蓝天	914	64,107.96	0.04
556	603708	家家悦	7,100	60,918.00	0.04
557	603013	亚普股份	3,800	60,002.00	0.04
558	605179	一鸣食品	4,600	57,822.00	0.04
559	603275	众辰科技	1,500	57,105.00	0.04
560	688196	卓越新能	1,570	56,363.00	0.03
561	603395	红四方	2,800	56,000.00	0.03
562	603680	今创集团	5,700	55,917.00	0.03
563	688151	华强科技	3,670	54,572.90	0.03
564	600081	东风科技	6,000	54,480.00	0.03
565	603334	丰倍生物	1,500	53,295.00	0.03
566	605365	立达信	3,700	53,206.00	0.03
567	601279	英利汽车	17,200	52,460.00	0.03
568	603210	泰鸿万立	3,800	51,034.00	0.03
569	601086	国芳集团	7,400	49,062.00	0.03
570	601068	中铝国际	11,200	48,384.00	0.03
571	605099	共创草坪	1,500	48,300.00	0.03
572	688712	北芯生命	1,341	48,168.72	0.03
573	605005	合兴股份	2,900	45,849.00	0.03
574	603014	威高血净	1,400	45,822.00	0.03
575	600828	茂业商业	12,700	45,466.00	0.03
576	688820	盛合晶微	321	45,418.29	0.03
577	605011	杭州热电	2,900	44,834.00	0.03
578	688785	恒运昌	95	43,999.25	0.03
579	605286	同力天启	1,700	43,333.00	0.03
580	605188	国光连锁	3,700	43,253.00	0.03
581	603370	华新精科	1,200	43,176.00	0.03
582	603848	好太太	2,900	39,614.00	0.02
583	603352	至信股份	1,512	39,300.24	0.02
584	603103	横店影视	2,700	38,637.00	0.02
585	603406	天富龙	1,400	36,330.00	0.02
586	688797	臻宝科技	71	33,275.57	0.02
587	688813	泰金新能	181	31,148.29	0.02
588	603376	大明电子	1,200	29,736.00	0.02
589	688635	长进光子	85	26,196.15	0.02
590	688781	视涯科技	450	21,424.50	0.01

591	688811	有研新材	676	16,311.88	0.01
592	603459	红板科技	142	11,973.44	0.01
593	688816	易思维	127	7,251.70	0.00
594	601112	振石股份	334	5,875.06	0.00
595	603435	嘉德利	97	4,530.87	0.00
596	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
597	603293	埃泰克	40	1,357.20	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	688372	伟测科技	7,785,523.27	1.69
2	688403	汇成股份	7,149,223.88	1.55
3	688362	甬矽电子	5,350,749.54	1.16
4	688268	华特气体	5,261,182.88	1.14
5	601778	晶科科技	4,239,205.16	0.92
6	688001	华兴源创	2,451,414.45	0.53
7	688766	普冉股份	2,091,625.44	0.45
8	688195	腾景科技	1,607,308.82	0.35
9	688311	盟升电子	1,300,522.75	0.28
10	688536	思瑞浦	1,236,866.47	0.27
11	688519	南亚新材	1,053,418.65	0.23
12	688205	德科立	996,787.11	0.22
13	603638	艾迪精密	870,332.73	0.19
14	688048	长光华芯	868,807.54	0.19
15	688257	新锐股份	839,816.83	0.18
16	603992	松霖科技	822,958.66	0.18
17	688652	京仪装备	817,474.71	0.18
18	688545	兴福电子	790,816.58	0.17
19	603186	华正新材	782,643.00	0.17
20	603131	上海沪工	751,236.29	0.16

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	9,497,630.64	2.06
2	688403	汇成股份	6,908,337.65	1.50
3	688372	伟测科技	6,782,400.55	1.47
4	688268	华特气体	5,609,608.91	1.22

5	688362	甬矽电子	5,187,578.55	1.12
6	601778	晶科科技	4,222,475.95	0.92
7	600105	永鼎股份	2,436,057.00	0.53
8	688001	华兴源创	1,991,086.18	0.43
9	688313	仕佳光子	1,907,676.60	0.41
10	688146	中船特气	1,833,725.24	0.40
11	688627	精智达	1,814,488.39	0.39
12	688167	炬光科技	1,545,833.46	0.34
13	688585	上纬新材	1,521,660.40	0.33
14	603256	宏和科技	1,486,740.00	0.32
15	688025	杰普特	1,164,870.24	0.25
16	688270	ST 臻镭	1,152,051.08	0.25
17	603308	应流股份	1,141,117.00	0.25
18	688536	思瑞浦	1,139,906.41	0.25
19	688668	鼎通科技	1,117,319.23	0.24
20	688409	富创精密	1,102,566.74	0.24

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	106,696,757.76
卖出股票收入（成交）总额	107,117,441.05

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）	172,007.01	0.11

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	172,007.01	0.11

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	110101	宝钛转债	790	79,001.04	0.05
2	113705	豪 26 转债	520	52,003.42	0.03
3	113703	翔 26 转债	210	21,002.03	0.01
4	118072	鼎通转债	200	20,000.52	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

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		中国工商银行股份有限 公司—易方达上证 580 交易型开放式指数证券 投资基金联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例		
607	198,840.2 0	107,735,550 .00	89.26%	12,960,450. 00	10.74%	99,998,765. 00	82.85%

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

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（2025 年 10 月 10 日）基金份额总额	212,696,000.00
本报告期期初基金份额总额	440,696,000.00
本报告期基金总申购份额	16,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	336,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	120,696,000.00

§ 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。

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、基金财产的诉讼事项；本报告期内无基金托管业务需要承担

民事或刑事责任的诉讼事项。

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

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大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	179,107,742.99	100.00%	17,176.77	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	33,782,970.52	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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	证券日报	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	证券日报	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	证券日报	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	易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-15
8	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加	证券日报、基金管理人网	2026-06-15

	华源证券为一级交易商的公告	站及中国证监会基金电 子披露网站	
--	---------------	---------------------	--

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基 金情况	
	序号	持有基金份额比例 达到或者超过20% 的时间区间	期 初 份 额	申 购 份 额	赎 回 份 额	持有份 额	份额占 比
中国工商银行股份有 限公司－易方达上证 580 交易型开放式指 数证券投资基金联接 基金	1	2026 年 01 月 01 日 ~2026 年 06 月 30 日	407,383, 200.00	225,410, 565.00	532,795, 000.00	99,998,7 65.00	82.85 %
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 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 580 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达上证 580 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件、营业执照。

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