易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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：招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。

基金托管人招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 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
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 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
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 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 期末投资目标基金明细 39
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
7.4 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 40
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合 42
7.7 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 42
7.8 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 42
7.9 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 42
7.10 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 42
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 42

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 42
7.13 投资组合报告附注 42
§8 基金份额持有人信息 44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 44
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 44
§9 开放式基金份额变动 45
§10 重大事件揭示 45
10.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
10.4 基金投资策略的改变 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 45
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 46
10.8 其他重大事件 49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 50
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 50
§12 备查文件目录 50
12.1 备查文件目录 50
12.2 存放地点 50
12.3 查阅方式 50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	易方达中证全指证券公司 ETF 联接	
基金主代码	012590	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 2 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,126,306,372.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	012590	012700
报告期末下属分级基金的份额总额	430,118,521.36 份	1,696,187,851.36 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	512570
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 27 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2017 年 8 月 11 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达中证全指证券公司 ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达中证全指证券公司 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内。本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回的方式或二级市场方式进行目标 ETF 的投资。本基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪业绩比较基准。同时，在条件允许的情况下还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以申购目标 ETF。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、股票期权。为更好地实现投资目标，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。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于易方达中证全指证券公司 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证全指证券公司指数的表现密切相关。

2.2.1 目标基金产品说明

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抽样复制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。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品，如权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王玉	张姗
	联系电话	020-85102688	400-61-95555
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	400-61-95555

传真	020-38798812	0755-83195201
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	510627；510623；519031	518040
法定代表人	吴欣荣	缪建民

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	易方达基金管理有限公司	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

§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）**	
	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C
本期已实现收益	-1,604,086.94	-7,415,391.30
本期利润	-13,746,609.12	-66,523,452.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0476	-0.0573
本期加权平均净值利润率	-4.15%	-5.02%
本期基金份额净值增长率	-6.97%	-7.02%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C
期末可供分配利润	-46,349.43	-8,591,291.10
期末可供分配基金份额利润	-0.0001	-0.0051

期末基金资产净值	501,403,314.39	1,967,995,676.46
期末基金份额净值	1.1657	1.1602
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C
基金份额累计净值增长率	16.57%	16.02%

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

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A

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	8.69%	1.70%	8.27%	1.72%	0.42%	-0.02%
过去六个月	-6.97%	1.50%	-7.42%	1.51%	0.45%	-0.01%
过去一年	-0.41%	1.38%	-2.01%	1.39%	1.60%	-0.01%
过去三年	25.10%	1.59%	22.27%	1.66%	2.83%	-0.07%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.57%	1.53%	3.30%	1.61%	13.27%	-0.08%

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C

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	8.65%	1.70%	8.27%	1.72%	0.38%	-0.02%
过去六个月	-7.02%	1.50%	-7.42%	1.51%	0.40%	-0.01%
过去一年	-0.51%	1.38%	-2.01%	1.39%	1.50%	-0.01%
过去三年	24.73%	1.59%	22.27%	1.66%	2.46%	-0.07%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.02%	1.53%	3.30%	1.61%	12.72%	-0.08%

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

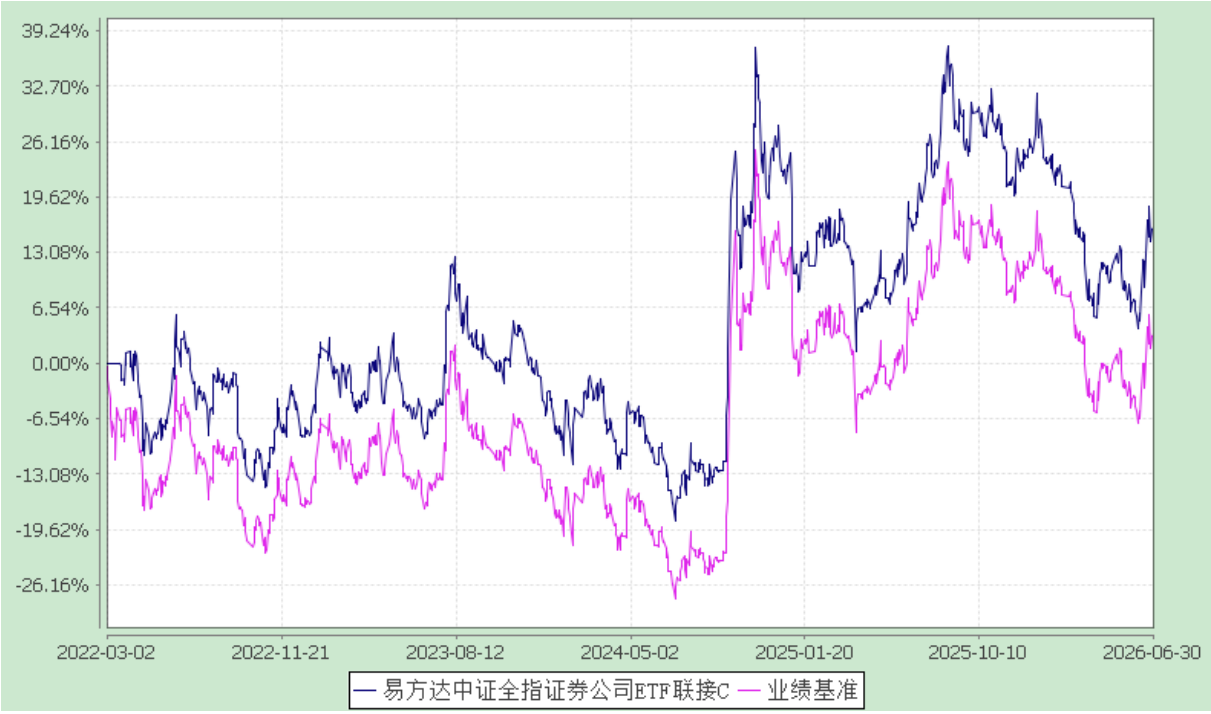
较

易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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

（2022 年 3 月 2 日至 2026 年 6 月 30 日）

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C



§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		
张湛	本基金的基金经理，易方达中证科技 50ETF、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万得生物科技指数（LOF）、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50ETF 联接、易方达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF（QDII）、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接、易方达中证医疗 ETF 联接、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、易方达国证港股通科技 ETF 的基金经理，易方达中证港股通中国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）、易方达上证科创板 100ETF（自 2023 年 12 月 02 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达中证港股通中国 100ETF 联接发起式、易方达上证 50 增强策略 ETF、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式（自 2024 年 08 月 31 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达创业板 ETF、易方达中证 A500ETF 联接、易方达	2022-03-02	-	17 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数量化投资研究员、量化研究员、投资经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证券公司指数（LOF）、易方达中证新能源 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证新能源 ETF 联接发起式的基金经理。

	中证 A500ETF、易方达中证 A50 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

本基金为易方达中证全指证券公司 ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资于易方达中证全指证券公司 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达中证全指证券公司 ETF 跟踪中证全指证券公司指数，该指数在中证全指指数样本中选取中证行业分类为证券公司的全部证券作为样本，反映证券公司行业上市公司证券的整体表现。

2026 年上半年，中国经济在外部环境更趋复杂严峻、全球供应链深度重构与国内结构调整持续

深化的大背景下，保持战略定力，宏观政策加力提效、靠前发力，存量政策与增量政策协同共振，推动“两重”“两新”政策扩围落地，加快超长期特别国债与专项债实物工作量形成，经济运行整体延续回升向好、质效双升的良好态势。面对全球贸易壁垒持续升级、地缘政治博弈复杂化，以及国内房地产市场延续筑底调整、部分传统行业经营压力犹存等困难挑战，中国政府坚持稳中求进工作总基调，统筹扩大内需和深化供给侧结构性改革，工业生产保持较强韧性，就业物价总体平稳，消费市场渐进回暖，有效投资稳步扩大，出口结构持续优化，新质生产力加速培育壮大，经济结构优化升级步伐加快。上半年我国 GDP 为 69.6 万亿元，按不变价格计算，同比增长 4.7%，上半年经济增速延续了稳中向好的发展态势，经济高质量发展取得新进展，充分彰显了中国经济的韧性与潜力。上半年宏观经济的平稳运行有效夯实了资本市场的基本面，为 A 股市场平稳运行筑牢了根基，有效提振了市场长期发展信心，为资本市场估值修复、结构优化提供了坚实支撑。同时，国内人工智能、高端芯片、先进制造等领域技术突破持续落地，科技创新产业集群加速成型，海内外投资者对中国硬核科技实力、产业升级潜力的认知持续深化，推动优质中国资产迎来系统性价值重估。

资本市场方面，上半年 A 股市场整体呈现“先抑后扬、震荡上行、结构分化显著”的运行特征，投资者情绪在政策托底与科技突破的双重提振下逐步修复。一季度地缘冲突成为市场最大外部变量，能源与安全主线领涨、高估值成长板块承压；二季度受益于人工智能大模型商业化加速落地及算力基建政策持续催化，科技成长主线持续领涨，人工智能、算力芯片、数字经济、高端装备等科技板块持续走强，成长风格占据市场主导。报告期内，从市场主流指数表现来看，代表科技创新方向的科创 50、科创创业 50、创业板指等成长风格指数在科技行情驱动下表现领先，中证 500、中证 1000 等中小盘指数亦有较好表现，沪深 300 指数表现稳健，而上证 50、中证红利等价值风格指数表现则相对落后。行业层面，受益于 AI 硬件及应用等产业政策密集催化、景气度持续向好的电子、通信等板块表现亮眼；而商贸零售、保险、农林牧渔、食品饮料、房地产链、社会服务等板块受制于需求恢复偏缓及行业周期下行压力，整体表现相对落后。报告期内证券行业在宏观经济温和复苏、资本市场改革深化的驱动下，行业经营韧性显著增强，但受地缘冲突与海外流动性收紧等外部因素扰动，板块呈现业绩增长、估值修复但波动加剧的特征。报告期内中证全指证券公司指数下跌 7.87%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，依据基金申赎变动等情况进行日常组合管理，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.1657 元，本报告期份额净值增长率为-6.97%，同期业绩比较基准收益率为-7.42%；C 类基金份额净值为 1.1602 元，本报告期份额净值增长率为-7.02%，同期业绩比较基准收益率为-7.42%。年化跟踪误差 0.63%，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

2026 年上半年，中国经济增速延续了稳中向好的发展态势，经济高质量发展取得新进展，彰显了中国经济的强大韧性。上半年宏观经济的平稳运行为下半年持续健康发展奠定了坚实基础，新质生产力加速培育壮大，人工智能、商业航天、低空经济、人形机器人等前沿领域加速突破，高技术制造业与装备制造业持续领跑，经济转型升级和产业结构优化向纵深推进，为“十五五”良好开局积蓄了充沛动能。展望 2026 年下半年，中国经济高质量发展的态势有望持续巩固，经济增速将继续在全球主要经济体中保持领先。随着宏观政策逆周期与跨周期调节协同发力，已出台的一揽子存量政策和增量政策效果将进一步显现，超长期特别国债与专项债资金加速落地见效，预计下半年基建投资和制造业投资将保持较强韧性，消费市场在居民收入改善与促消费政策扩围加力的双重支撑下有望持续回暖，出口在产业链优势与新兴市场开拓的共同作用下将保持较强竞争力。国内物价水平有望在需求持续修复与基数效应的叠加下实现温和回升，企业盈利空间逐步改善，经济有望彻底走出价格收缩区间。尽管外部环境不确定性依然突出，全球经济复苏乏力、地缘政治博弈复杂化、贸易摩擦反复等因素仍构成扰动，但中国政策“工具箱”储备充足，财政政策、货币政策、产业政策协同发力空间较大，预计下半年宏观政策将继续精准发力、靠前发力，有效对冲外部风险挑战，为经济稳定运行提供坚实保障。新质生产力加速释放也将持续催生新产业、新业态、新经济增长点，为经济高质量发展注入源源不断的内生动力。

资本市场方面，A 股市场在基本面持续修复、政策红利密集释放、流动性环境整体充裕的多重共振下，有望延续震荡上行格局。下半年，随着美联储降息周期可能开启、全球流动性环境趋于改善，外资回流 A 股市场的动能有望增强，叠加国内中长期资金持续入市，市场资金面整体偏宽松。从结构上看，A 股市场或将延续结构性行情特征，成长与价值风格轮动有望更加均衡。科技成长板块在人工智能商业化加速落地、算力基建持续投入、半导体国产替代深化等因素驱动下，仍有较大演绎空间，但板块内部分化可能加大，具备核心技术突破和真实业绩支撑的优质标的有望胜出；受益于经济复苏预期升温及物价水平温和回升，消费板块中的新消费、医药等细分领域配置价值凸显；顺周期方向，随着稳增长政策持续加码，银行、非银金融等板块估值修复行情仍有空间；高股息红利资产在利率低位环境下仍将受到长期资金青睐。整体而言，在宏观经济平稳运行、产业升级趋势明确、资本市场改革深化推进的背景下，优质赛道与行业龙头企业的配置优势将进一步凸显，A 股市场有望在下半年走出更加稳健的结构性上涨行情。国内宏观经济稳中有进、资本市场改革持续深化、中长期资金入市提速，为证券行业发展提供了良好的政策与市场环境。下半年证券行业处于业绩向上、估值底部、政策友好的三重共振窗口，为券商板块提供了更强的业绩弹性和进攻属性。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对业绩比较基

准的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具。

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

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C: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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	139,773,865.56	75,661,838.38
结算备付金		2,315,682.77	754,998.27
存出保证金		179,514.23	183,071.82
交易性金融资产	6.4.7.2	2,327,694,051.53	1,371,877,561.48
其中：股票投资		72,915,007.24	-
基金投资		2,254,779,044.29	1,371,877,561.48
债券投资		-	-
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		84,771,468.53	28,084,267.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	2,275,811.00	393,234.36
资产总计		2,557,010,393.62	1,476,954,971.76
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		73,912,933.50	8,945,435.08

应付赎回款		13,360,253.42	8,955,294.87
应付管理人报酬		67,192.03	32,801.22
应付托管费		13,438.39	6,560.26
应付销售服务费		130,762.10	96,579.92
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	16,019.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	126,823.33	154,312.45
负债合计		87,611,402.77	18,207,003.57
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,126,306,372.72	1,168,060,441.34
未分配利润	6.4.7.8	343,092,618.13	290,687,526.85
净资产合计		2,469,398,990.85	1,458,747,968.19
负债和净资产总计		2,557,010,393.62	1,476,954,971.76

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1657 元，C 类基金份额净值 1.1602 元；基金份额总额 2,126,306,372.72 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 430,118,521.36 份，C 类基金份额总额 1,696,187,851.36 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-79,239,881.88	-20,225,645.68
1.利息收入		155,173.66	56,611.40
其中：存款利息收入	6.4.7.9	155,173.66	56,611.40
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）		-8,846,500.09	-4,208,704.01
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,168,769.19	-298,382.88
基金投资收益	6.4.7.11	-13,356,866.28	-3,910,321.13
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	341,597.00	-

其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-71,250,583.31	-16,188,545.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	702,027.86	114,992.13
减：二、营业总支出		1,030,179.67	381,571.28
1．管理人报酬		245,602.05	78,843.05
2．托管费		49,120.43	15,768.54
3．销售服务费		655,261.33	219,239.49
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	6.4.7.18	-	-
7．税金及附加		4,713.49	-
8．其他费用	6.4.7.19	75,482.37	67,720.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-80,270,061.55**	**-20,607,216.96**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-80,270,061.55**	**-20,607,216.96**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		**-80,270,061.55**	**-20,607,216.96**

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	1,168,060,441.34	290,687,526.85	1,458,747,968.19
二、本期期初净资产	1,168,060,441.34	290,687,526.85	1,458,747,968.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	958,245,931.38	52,405,091.28	1,010,651,022.66
（一）、综合收益总额	-	-80,270,061.55	-80,270,061.55
（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	958,245,931.38	132,675,152.83	1,090,921,084.21

填列）			
其中：1.基金申购款	2,690,232,519.27	390,782,706.48	3,081,015,225.75
2.基金赎回款	-1,731,986,587.89	-258,107,553.65	-1,990,094,141.54
（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	2,126,306,372.72	343,092,618.13	2,469,398,990.85
项目	**上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	539,378,203.95	105,805,111.71	645,183,315.66
二、本期期初净资产	539,378,203.95	105,805,111.71	645,183,315.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,966,421.38	-20,141,986.81	-47,108,408.19
（一）、综合收益总额	-	-20,607,216.96	-20,607,216.96
（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）	-26,966,421.38	465,230.15	-26,501,191.23
其中：1.基金申购款	517,679,629.72	67,776,368.69	585,455,998.41
2.基金赎回款	-544,646,051.10	-67,311,138.54	-611,957,189.64
（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	512,411,782.57	85,663,124.90	598,074,907.47

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

易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2021]1916 号《关于准予易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》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《易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2022 年 3 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 256,136,294.69 份基金份额，其中认购资金利息折合 24,468.86 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为招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	139,773,865.56
等于：本金	139,762,448.78
加：应计利息	11,416.78
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	139,773,865.56

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		72,263,025.35	-	72,915,007.24	651,981.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		2,303,454,330.69	-	2,254,779,044.29	-48,675,286.40
其他		-	-	-	-
合计		2,375,717,356.04	-	2,327,694,051.53	-48,023,304.51

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	2,275,811.00
待摊费用	-
合计	2,275,811.00

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	1,701.64
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	63,134.62
其中：交易所市场	63,134.62
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	61,987.07

合计	126,823.33

6.4.7.7 实收基金

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A

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	229,053,996.08	229,053,996.08
本期申购	347,932,510.12	347,932,510.12
本期赎回（以“-”号填列）	-146,867,984.84	-146,867,984.84
本期末	430,118,521.36	430,118,521.36

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C

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	939,006,445.26	939,006,445.26
本期申购	2,342,300,009.15	2,342,300,009.15
本期赎回（以“-”号填列）	-1,585,118,603.05	-1,585,118,603.05
本期末	1,696,187,851.36	1,696,187,851.36

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A

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	1,271,217.57	56,703,867.14	57,975,084.71
本期期初	1,271,217.57	56,703,867.14	57,975,084.71
本期利润	-1,604,086.94	-12,142,522.18	-13,746,609.12
本期基金份额交易产生的变动数	286,519.94	26,769,797.50	27,056,317.44
其中：基金申购款	722,748.72	49,749,805.84	50,472,554.56
基金赎回款	-436,228.78	-22,980,008.34	-23,416,237.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-46,349.43	71,331,142.46	71,284,793.03

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C

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	1,067,518.18	231,644,923.96	232,712,442.14
本期期初	1,067,518.18	231,644,923.96	232,712,442.14
本期利润	-7,415,391.30	-59,108,061.13	-66,523,452.43
本期基金份额交易产生的变动数	-2,243,417.98	107,862,253.37	105,618,835.39
其中：基金申购款	-4,778,167.67	345,088,319.59	340,310,151.92
基金赎回款	2,534,749.69	-237,226,066.22	-234,691,316.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,591,291.10	280,399,116.20	271,807,825.10

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	152,897.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,777.44
其他	498.45
合计	155,173.66

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	-32,597.59
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	4,201,366.78
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	4,168,769.19

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	139,115.02
减：卖出股票成本总额	36,876.36
减：交易费用	134,836.25
买卖股票差价收入	-32,597.59

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	1,096,456,900.00
减：现金支付申购款总额	343,498,629.94
减：申购股票成本总额	748,756,903.28
减：交易费用	-
申购差价收入	4,201,366.78

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	157,632,197.10
减：卖出/赎回基金成本总额	170,926,330.42
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	39,279.11
减：交易费用	23,453.85
基金投资收益	-13,356,866.28

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 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	341,597.00
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	341,597.00

6.4.7.16 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	-71,250,583.31
——股票投资	651,981.89

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-71,902,565.20
——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	-71,250,583.31

6.4.7.17 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	702,027.86
合计	702,027.86

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 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	2,479.70
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	13,495.30
合计	75,482.37

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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	245,602.05	78,843.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,811,560.38	605,430.61
应支付基金管理人的净管理费	-1,565,958.33	-526,587.56

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值＝前一日基金资产净值－前

一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2.对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

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	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	49,120.43	15,768.54

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 公允价值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值＝前一日基金资产净值－前一日本基金持有的目标 ETF 公允价值，金额为负时以零计

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	易方达中证全指证券公司ETF联接A	易方达中证全指证券公司ETF联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	33,259.70	33,259.70
招商银行	-	50,770.97	50,770.97
广发证券	-	537.89	537.89
易方达财富	-	5,167.63	5,167.63
合计	-	89,736.19	89,736.19

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达中证全指证券公司ETF联接A	易方达中证全指证券公司ETF联接C	合计
易方达基金管理有限公司	-	20,732.42	20,732.42
招商银行	-	11,090.55	11,090.55
广发证券	-	243.88	243.88
合计	-	32,066.85	32,066.85

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.10%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.10%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本报告期内和上年度可比期间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

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A

无。

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	139,773,865.56	152,897.77	34,547,764.74	55,306.32

注：本基金的上述银行存款由基金托管人招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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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

于本报告期末及上年度末，本基金分别持有 1,997,147,072 份和 1,128,374,372 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 59.35%和 59.80%。

6.4.11 利润分配情况

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于易方达中证全指证券公司 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证全指证券公司指数的表现密切相关。

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 0.00%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

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	0.00	0.00
AAA 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	139,773,865.56	-	-	-	139,773,865.56
结算备付金	2,315,682.77	-	-	-	2,315,682.77
存出保证金	179,514.23	-	-	-	179,514.23
交易性金融资产	-	-	-	2,327,694,051.53	2,327,694,051.53
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	-	-	-	84,771,468.53	84,771,468.53
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,275,811.00	2,275,811.00
资产总计	142,269,062.56	-	-	2,414,741,331.06	2,557,010,393.62
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	-	-	-	73,912,933.50	73,912,933.50
应付赎回款	-	-	-	13,360,253.42	13,360,253.42
应付管理人报酬	-	-	-	67,192.03	67,192.03
应付托管费	-	-	-	13,438.39	13,438.39
应付销售服务费	-	-	-	130,762.10	130,762.10
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	126,823.33	126,823.33
负债总计	-	-	-	87,611,402.77	87,611,402.77
利率敏感度缺口	142,269,062.56	-	-	2,327,129,928.29	2,469,398,990.85
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	75,661,838.38	-	-	-	75,661,838.38
结算备付金	754,998.27	-	-	-	754,998.27
存出保证金	183,071.82	-	-	-	183,071.82
交易性金融资产	-	-	-	1,371,877,561.48	1,371,877,561.48
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	-	-	-	28,084,267.45	28,084,267.45
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	393,234.36	393,234.36
资产总计	76,599,908.47	-	-	1,400,355,063.29	1,476,954,971.76
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	-	-	-	8,945,435.08	8,945,435.08
应付赎回款	-	-	-	8,955,294.87	8,955,294.87
应付管理人报酬	-	-	-	32,801.22	32,801.22
应付托管费	-	-	-	6,560.26	6,560.26
应付销售服务费	-	-	-	96,579.92	96,579.92
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	16,019.77	16,019.77
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	154,312.45	154,312.45
负债总计	-	-	-	18,207,003.57	18,207,003.57
利率敏感度缺口	76,599,908.47	-	-	1,382,148,059.72	1,458,747,968.19

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。本基金主要投资于跟踪的目标 ETF、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	公允价值	占基金

		资产净值比例（%）		资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	72,915,007.24	2.95	-	-
交易性金融资产－基金投资	2,254,779,044.29	91.31	1,371,877,561.48	94.04
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	2,327,694,051.53	94.26	1,371,877,561.48	94.04

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%	122,330,043.88	72,630,967.44
	2.业绩比较基准下降 5%	-122,330,043.88	-72,630,967.44

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	2,327,694,051.53
第二层次	-
第三层次	-
合计	2,327,694,051.53

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。对于目标 ETF，若本基金因上述事项在目标 ETF 当日份额净值的基础上，对目标 ETF 的公允价值进行调整，则本基金在调整期间内将目标 ETF 的公允价值从第一层次转出。

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	72,915,007.24	2.85
	其中：股票	72,915,007.24	2.85
2	基金投资	2,254,779,044.29	88.18
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	142,089,548.33	5.56
8	其他各项资产	87,226,793.76	3.41
9	合计	2,557,010,393.62	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	2,254,779,044.29	91.31

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	72,915,007.24	2.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	72,915,007.24	2.95

7.4 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	600030	中信证券	484,500	13,919,685.00	0.56
2	601211	国泰海通	561,000	10,210,200.00	0.41
3	601688	华泰证券	289,000	5,959,180.00	0.24
4	600999	招商证券	187,000	3,945,700.00	0.16
5	300059	东方财富	142,000	2,893,960.00	0.12
6	600958	东方证券	263,496	2,487,402.24	0.10
7	601995	中金公司	59,500	2,150,925.00	0.09
8	601377	兴业证券	340,000	2,053,600.00	0.08
9	601066	中信建投	68,000	1,976,760.00	0.08
10	600909	华安证券	153,000	1,699,830.00	0.07
11	601555	东吴证券	195,500	1,548,360.00	0.06
12	601901	方正证券	204,000	1,468,800.00	0.06
13	601108	财通证券	161,500	1,396,975.00	0.06
14	601881	中国银河	110,500	1,388,985.00	0.06
15	601456	国联民生	153,000	1,352,520.00	0.05
16	601788	光大证券	93,500	1,349,205.00	0.05
17	601878	浙商证券	136,000	1,292,000.00	0.05
18	601198	东兴证券	93,500	1,270,665.00	0.05
19	601162	天风证券	348,500	1,174,445.00	0.05
20	601099	太平洋	340,000	1,145,800.00	0.05
21	600109	国金证券	127,500	1,119,450.00	0.05
22	601696	中银证券	85,000	1,075,250.00	0.04
23	600061	国投资本	127,500	835,125.00	0.03
24	601059	信达证券	51,000	825,690.00	0.03
25	600918	中泰证券	153,000	813,960.00	0.03
26	600369	西南证券	195,500	785,910.00	0.03
27	601990	南京证券	110,500	725,985.00	0.03
28	600155	华创云信	110,500	609,960.00	0.02
29	601375	中原证券	136,000	542,640.00	0.02
30	600906	财达证券	68,000	507,280.00	0.02
31	601236	红塔证券	68,000	463,760.00	0.02
32	600095	湘财股份	59,500	448,035.00	0.02

33	000166	申万宏源	101,300	445,720.00	0.02
34	000783	长江证券	37,300	363,675.00	0.01
35	601136	首创证券	25,500	355,725.00	0.01
36	002736	国信证券	34,500	344,655.00	0.01
37	600621	华鑫股份	25,500	329,460.00	0.01
38	002797	第一创业	47,200	310,104.00	0.01
39	000728	国元证券	29,400	220,206.00	0.01
40	002673	西部证券	30,100	195,349.00	0.01
41	000750	国海证券	50,200	184,736.00	0.01
42	002939	长城证券	18,100	150,954.00	0.01
43	002926	华西证券	17,700	144,609.00	0.01
44	000686	东北证券	15,800	132,720.00	0.01
45	002500	山西证券	24,100	124,356.00	0.01
46	002670	国盛证券	6,500	71,500.00	0.00
47	000712	锦龙股份	7,100	62,906.00	0.00
48	002945	华林证券	3,000	40,290.00	0.00

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 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	600030	中信证券	166,373,892.12	11.41
2	601211	国泰海通	123,511,543.27	8.47
3	601688	华泰证券	73,668,336.14	5.05
4	600999	招商证券	41,705,656.00	2.86
5	600958	东方证券	28,159,745.32	1.93
6	601377	兴业证券	26,942,389.90	1.85
7	601995	中金公司	25,928,112.00	1.78
8	601066	中信建投	21,459,374.00	1.47
9	601555	东吴证券	19,960,498.86	1.37
10	601901	方正证券	18,486,331.00	1.27
11	601881	中国银河	18,304,702.00	1.25
12	601788	光大证券	18,046,329.00	1.24
13	601108	财通证券	16,980,288.00	1.16
14	601878	浙商证券	16,821,354.20	1.15
15	601162	天风证券	16,037,428.00	1.10
16	601198	东兴证券	15,675,326.01	1.07
17	601099	太平洋	15,635,319.64	1.07
18	600909	华安证券	14,891,919.00	1.02
19	600109	国金证券	14,206,136.98	0.97
20	601696	中银证券	13,501,246.36	0.93

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。

7.5.2 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	920186	中科仪	118,464.70	0.01
2	920072	科莱瑞迪	20,650.32	0.00

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。

7.5.3 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	821,056,804.99
卖出股票收入（成交）总额	139,115.02

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。

7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，广发证券股份有限公司在报告编制日前

一年内曾受到深圳证券交易所的公开谴责。

本基金为目标 ETF 的联接基金，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目标 ETF 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。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，华安证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行安徽省分行的处罚。

本基金对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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	179,514.23
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	84,771,468.53
6	其他应收款	2,275,811.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,226,793.76

7.13.4 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。

7.13.5 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

份额级别	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
易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A	22,139	19,428.09	525,238.85	0.12%	429,593,282.51	99.88%
易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C	95,613	17,740.14	6,097,772.43	0.36%	1,690,090,078.93	99.64%
合计	117,752	18,057.50	6,623,011.28	0.31%	2,119,683,361.44	99.69%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A	225,826.55	0.0525%
	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C	347,164.40	0.0205%
	合计	572,990.95	0.0269%

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	份额级别	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	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A	0
	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A	0
	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 A	易方达中证全指证券公司 ETF 联接 C
基金合同生效日（2022 年 3 月 2 日）基金份额总额	8,629,380.95	247,506,913.74
本报告期期初基金份额总额	229,053,996.08	939,006,445.26
本报告期基金总申购份额	347,932,510.12	2,342,300,009.15
减：本报告期基金总赎回份额	146,867,984.84	1,585,118,603.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	430,118,521.36	1,696,187,851.36

§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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	821,019,928.63	99.98%	82,102.12	99.98%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	139,115.02	0.02%	13.92	0.02%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为财通证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华西证券股份有限公司。

b）本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。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。

c）本报告期内基金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交易单元的证券经营机构。

2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	186,413,644.70	100.00%
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-01-08
3	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	证券时报	2026-01-22
4	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-02-24
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-03-23
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 2025 年年度报告提示性公告	证券时报	2026-03-31
8	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
9	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-04-23
10	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
11	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-05-23
12	易方达基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	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	2026-05-29
13	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	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	2026-06-23

§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中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的文件；

2.《易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3.《易方达中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

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