易方达创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 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 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
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 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 37
7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45
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 45
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 45
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 45
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 45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 45

7.12 投资组合报告附注 46
§8 基金份额持有人信息 46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 47
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 47
§9 开放式基金份额变动 47
§10 重大事件揭示 47
10.1 基金份额持有人大会决议 47
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 48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 48
10.4 基金投资策略的改变 48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 48
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 48
10.8 其他重大事件 50
§11 影响投资者决策的其他重要信息 51
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 51
§12 备查文件目录 51
12.1 备查文件目录 51
12.2 存放地点 51
12.3 查阅方式 51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达创业板 200ETF
场内简称	创业板 200ETF 易方达
基金主代码	159572
交易代码	159572
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 15 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	175,749,107.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023 年 12 月 25 日

注：根据 2026 年 5 月 15 日深圳证券交易所、深圳证券信息有限公司发布的《关于修订创业板中盘 200 等 3 条指数编制方案的公告》，“创业板中盘 200 指数”名称于 2026 年 6 月 15 日变更为“创业板 200 指数”。自 2026 年 6 月 15 日起，本基金名称相应变更为“易方达创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金”，基金简称变更为“易方达创业板 200ETF”，业绩比较基准变更为“创业板 200 指数收益率”,场内简称及基金代码不变。

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	创业板 200 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38798812	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510627；510623；519031	100818
法定代表人		吴欣荣	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	86,217,952.65
本期利润	51,526,074.71
加权平均基金份额本期利润	0.2085
本期加权平均净值利润率	13.31%
本期基金份额净值增长率	15.37%
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	121,529,831.43
期末可供分配基金份额利润	0.6915

期末基金资产净值	297,278,938.43
期末基金份额净值	1.6915
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	69.15%

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

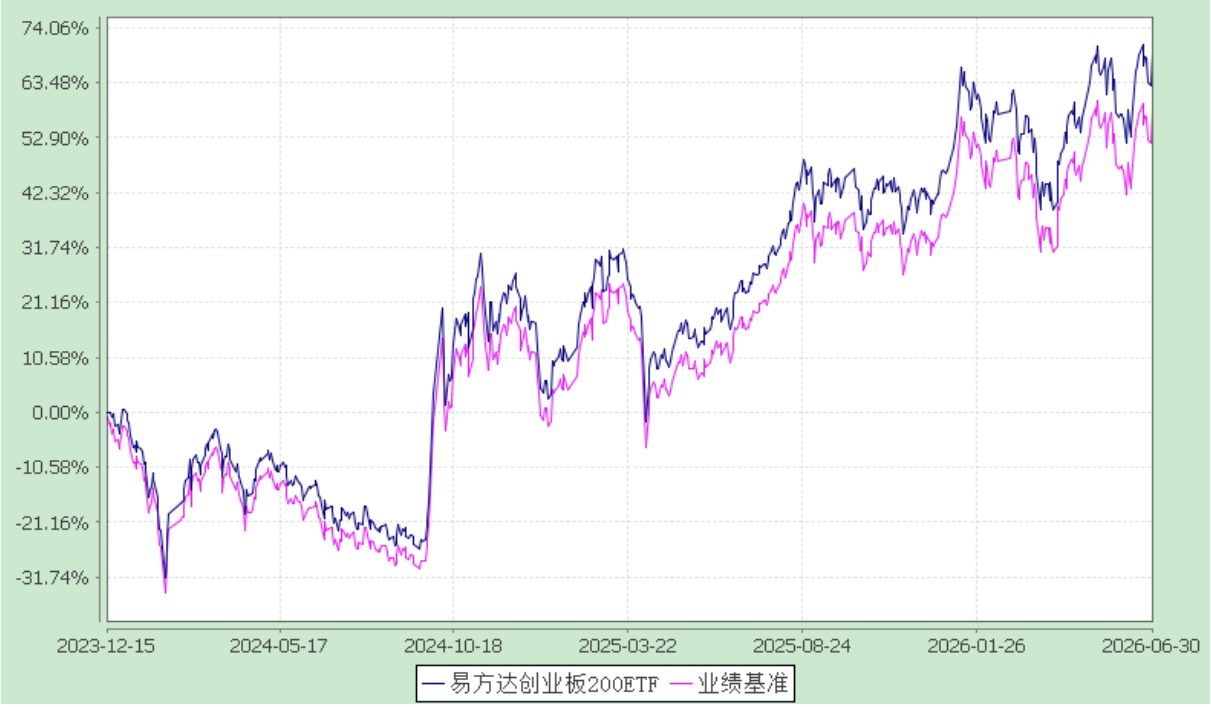
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	20.12%	2.04%	19.13%	2.05%	0.99%	-0.01%
过去六个月	15.37%	2.02%	14.37%	2.03%	1.00%	-0.01%
过去一年	34.88%	1.71%	33.30%	1.72%	1.58%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	69.15%	2.34%	57.85%	2.36%	11.30%	-0.02%

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

易方达创业板 200 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

（2023 年 12 月 15 日至 2026 年 6 月 30 日）



§ 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		
李树建	本基金的基金经理，易方达上证科创板成长 ETF 联接发起式（自 2024 年 01 月 04 日至 2026 年 02 月 06 日）、易方达国证信息技术创新主题 ETF 联接发起式（自 2024 年 01 月 05 日至 2026 年 02 月 06 日）、易方达国证机器人产业 ETF 联接发起式、易方达创业板中盘 200ETF 联接（自 2024 年 06 月 26 日至 2026	2023-12-15	2026-02-07	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究助理、分析师，易方达基金管理有限公司基金经理助理，易方达中证消费 50ETF、易方达中证石化产业 ETF 联接发起式、易方达中证家电龙头 ETF 的基金经理。

	年 02 月 06 日）、易方达黄金股指数发起式、易方达中证半导体材料设备主题 ETF 联接发起式（自 2024 年 11 月 26 日至 2026 年 02 月 06 日）、易方达国证机器人产业 ETF、易方达国证价值 100ETF、易方达国证成长 100ETF、易方达中证金融科技主题 ETF、易方达国证价值 100ETF 联接发起式、易方达中证金融科技主题 ETF 联接的基金经理，指数研究发展部总经理助理、研究员				
常锐	本基金的基金经理，易方达恒生 ETF（QDII）、易方达创业板成长 ETF 联接发起式、易方达创业板成长 ETF、易方达上证科创板成长 ETF 联接发起式、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式、易方达创业板 200ETF 联接、易方达上证科创板成长 ETF、易方达上证科创板 100ETF、易方达创业板新能源 ETF 的基金经理，研究员	2026-02-07	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华安基金管理有限公司助理研究员、研究员。
刘树荣	本基金的基金经理助理，易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达香港恒生综合小型股指数（QDII-LOF）、易方达中证 800ETF、易方达中证 800ETF 联接、易方达中证国企一带一路 ETF 联接、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达中证银行 ETF 联接（LOF）、易方达中证银行 ETF、易方达中证 1000ETF、易方达中证 1000ETF 联接、易方达中证港股通消费主题 ETF 联接、易方达中证港股通消费主题 ETF 的基金经理，易方达中证国新央企科技引领 ETF、易方达中证国新央企科技引领 ETF 联接、易方达创业板成长 ETF、易方达创业板 200ETF 联接、易方达创业板成长 ETF 联接发起式、易方达中证国资央企 50ETF、易方达中证金融科技主题 ETF、易方达中证国资央企 50ETF 联接发起式、易方达中证金融科技主题 ETF 联接的基	2024-01-06	-	19 年	硕士，具有基金从业资格。曾任招商银行资产托管部基金会计，易方达基金管理有限公司核算部基金核算专员、指数与量化投资部运作支持专员，易方达深证成指 ETF 联接、易方达深证成指 ETF、易方达中小企业 100 指数（LOF）、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达中证万得并购重组指数（LOF）、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达标普 500 指数（QDII-LOF）、易方达标普医疗保健指数（QDII-LOF）、易方达标普生物科技指数（QDII-LOF）、易方达标普信息科技指数（QDII-LOF）、易方达上证中盘 ETF、易方达中证浙江新动能 ETF 联接(QDII)、易方达中证浙江新动能 ETF(QDII)、易方达中证长江保护主题 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF 联接发起式的基金经理。

	金经理助理				

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统中的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共 64 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪创业板 200 指数，反映创业板市值规模中等、流动性较好的 200 家公司股价变化情况。报告期内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，全球宏观环境延续高波动格局，地缘冲突、能源价格波动以及主要经济体货币政策预期反复成为影响市场的重要因素。二月底，受海外地缘事件及部分能源海运通道受阻影响，

原油价格短期大幅上涨，能源通胀预期升温；进入二季度，受海外通胀数据超预期、劳动力市场保持强劲等因素影响，美联储宽松预期进一步收敛，全球大类资产波动有所加大。面对复杂的外部环境，国内经济总体保持平稳运行，新旧动能转换持续推进，以科技创新和先进制造为代表的新质生产力加快成长，进出口等领域也保持良好增势。根据国家统计局发布的数据，2026 年上半年国内生产总值为 69.57 万亿元，按不变价格计算同比增长 4.7%；货物进出口总额同比增长 16.9%，规模以上工业增加值同比增长 5.4%，国内经济整体保持较强韧性。

上半年 A 股市场整体呈现出“成交活跃、结构分化、科技成长占优”的特征。年初市场风险偏好明显回升，主要指数普遍上涨；此后受外部地缘冲突和通胀预期扰动，市场一度有所调整，煤炭、石油石化、公用事业等板块阶段性表现较好。进入二季度，随着全球 AI 资本开支持续扩大、算力及半导体产业链景气度保持高位，市场主线进一步向相关科技成长方向集中。上半年结构性行情较为显著，电子、通信等科技板块表现较好，商贸零售、农林牧渔、食品饮料等板块表现相对落后。2026 年上半年，在风险偏好改善和盈利预期修复的共同推动下，创业板 200 指数上涨 14.37%。

创业板 200 指数作为反映中小型创业板公司整体表现的核心指数，指数成份股聚焦新兴产业发展，对人工智能、生物制造、低空经济等前沿领域具有较好表征性，有望持续受益于中国现代化产业体系的建设。作为工具型产品，本基金具有规则透明、风格稳定、成本低廉和充分分散个股风险的优势，有助于投资者高效、便捷地跟踪新兴产业方向高成长投资机会。

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，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，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，本基金份额净值为 1.6915 元，本报告期份额净值增长率为 15.37%，同期业绩比较基准收益率为 14.37%。年化跟踪误差 0.38%，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 2026 年下半年，尽管外部扰动仍可能反复，但国内政策储备较为充足，财政支出提速、产业升级与出口韧性有望形成合力，支撑下半年国内经济延续平稳运行态势，并推动经济结构和增长质量进一步改善。海外方面，全球宏观环境仍存在一定不确定性，美国通胀与就业数据的变化将继续影响美联储政策路径，美元及美债收益率可能维持较高波动，同时中东局势及能源运输通道变化仍可能扰动全球通胀和风险偏好。国内方面，随着年中宏观政策进一步明确，专项债发行使用有望提速，政策性金融工具协同发力，财政资金有望更快转化为重大项目投资和实物工作量；促消费、设备更新、城市更新等政策也有望持续发力，推动内需和经济内生动能逐步改善。与此同时，人工

智能、先进制造等新质生产力方向持续释放增长动能，并带动相关产业投资和生产活动。

创业板 200 指数对于创业板中盘成长风格具有很强的代表性，剔除了创业板指样本股以及总市值排名前 70 名的股票。同时，创业板 200 指数在风格方面更突出中小盘成长属性，在行业分布上也更突出新质生产力相关板块，超配了电子、电力设备、计算机等新兴成长行业。展望 2026 年下半年，随着宏观流动性环境维持合理充裕、市场风险偏好有望逐步修复，中小盘成长风格在经历前期调整后估值性价比开始显现，创业板 200 的高弹性特征有望重新获得市场定价。整体而言，创业板 200 指数有望在产业结构转型升级、中小市值创新企业基本面逐步改善的进程中持续受益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值程序和技术，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责

地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达创业板 200 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	782,046.97	1,740,454.97
结算备付金		246,246.84	196,791.93
存出保证金		32,908.02	53,784.37
交易性金融资产	6.4.7.2	295,676,796.34	393,671,329.72
其中：股票投资		295,676,796.34	393,671,329.72
基金投资		-	-
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		668,889.47	160,505.81
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		297,467,380.27	395,822,866.80
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		28,351.32	56,117.58
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		37,536.87	56,853.32
应付托管费		12,512.29	18,951.11
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	110,041.36	202,162.81
负债合计		188,441.84	334,085.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	175,749,107.00	269,749,107.00
未分配利润	6.4.7.8	121,529,831.43	125,739,674.79
净资产合计		297,278,938.43	395,488,781.79
负债和净资产总计		297,467,380.27	395,822,866.80

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6915 元，基金份额总额 175,749,107.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达创业板 200 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	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		52,064,205.99	113,100,136.66
1.利息收入		3,571.42	5,101.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,571.42	5,101.14
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）		86,905,318.93	30,202,549.51
其中：股票投资收益	6.4.7.10	85,119,098.99	25,845,423.76

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	574,962.90	409,247.13
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	1,211,257.04	3,947,878.62
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	-34,691,877.94	82,849,341.98
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	-152,806.42	43,144.03
减：二、营业总支出		538,131.28	987,030.29
1．管理人报酬		288,953.83	626,182.88
2．托管费		96,317.91	208,727.66
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7．税金及附加		-	-
8．其他费用	6.4.7.18	152,859.54	152,119.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**51,526,074.71**	**112,113,106.37**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**51,526,074.71**	**112,113,106.37**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		**51,526,074.71**	**112,113,106.37**

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达创业板 200 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	269,749,107.00	125,739,674.79	395,488,781.79
二、本期期初净资产	269,749,107.00	125,739,674.79	395,488,781.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-94,000,000.00	-4,209,843.36	-98,209,843.36

（一）、综合收益总额	-	51,526,074.71	51,526,074.71
（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）	-94,000,000.00	-55,735,918.07	-149,735,918.07
其中：1.基金申购款	240,000,000.00	139,971,410.12	379,971,410.12
2.基金赎回款	-334,000,000.00	-195,707,328.19	-529,707,328.19
（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	175,749,107.00	121,529,831.43	297,278,938.43
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	879,749,107.00	109,578,218.68	989,327,325.68
二、本期期初净资产	879,749,107.00	109,578,218.68	989,327,325.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-248,000,000.00	50,947,465.05	-197,052,534.95
（一）、综合收益总额	-	112,113,106.37	112,113,106.37
（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）	-248,000,000.00	-61,165,641.32	-309,165,641.32
其中：1.基金申购款	252,000,000.00	32,529,372.36	284,529,372.36
2.基金赎回款	-500,000,000.00	-93,695,013.68	-593,695,013.68
（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	631,749,107.00	160,525,683.73	792,274,790.73

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

易方达创业板中盘 200 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[2023]2635 号《关于准予易方达创业板中盘 200 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《易方达创业板中盘 200 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，《易方达创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 323,749,107.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 12,107.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2026 年 5 月 15 日深圳证券交易所、深圳证券信息有限公司发布的《关于修订创业板中盘 200 等 3 条指数编制方案的公告》，“创业板中盘 200 指数”名称于 2026 年 6 月 15 日变更为“创业板 200 指数”。自 2026 年 6 月 15 日起，本基金名称相应变更为“易方达创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金”，基金简称变更为“易方达创业板 200ETF”，业绩比较基准变更为“创业板 200 指数收益率”,场内简称及基金代码不变。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及

本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》的规定：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税及金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）

的利息收入，免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	782,046.97
等于：本金	781,832.61
加：应计利息	214.36
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	782,046.97

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		276,111,775.84	-	295,676,796.34	19,565,020.50
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		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		276,111,775.84	-	295,676,796.34	19,565,020.50

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	19,094.29
其中：交易所市场	19,094.29
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	90,947.07
合计	110,041.36

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	269,749,107.00	269,749,107.00
本期申购	240,000,000.00	240,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-334,000,000.00	-334,000,000.00
本期末	175,749,107.00	175,749,107.00

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	85,200,153.53	40,539,521.26	125,739,674.79
本期期初	85,200,153.53	40,539,521.26	125,739,674.79
本期利润	86,217,952.65	-34,691,877.94	51,526,074.71
本期基金份额交易产生的变动数	-49,857,238.39	-5,878,679.68	-55,735,918.07
其中：基金申购款	102,528,711.14	37,442,698.98	139,971,410.12
基金赎回款	-152,385,949.53	-43,321,378.66	-195,707,328.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	121,560,867.79	-31,036.36	121,529,831.43

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	3,207.29
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	273.96
其他	90.17

合计	3,571.42

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	24,921,661.81
股票投资收益——赎回差价收入	60,197,437.18
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	85,119,098.99

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	134,403,644.97
减：卖出股票成本总额	109,375,968.65
减：交易费用	106,014.51
买卖股票差价收入	24,921,661.81

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	529,707,328.19
减：现金支付赎回款总额	2,420,042.19
减：赎回股票成本总额	467,089,848.82
减：交易费用	-
赎回差价收入	60,197,437.18

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	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	574,962.90
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	574,962.90

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	46,401,158.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	45,516,677.08
减：应计利息总额	307,680.77
减：交易费用	1,837.26
买卖债券差价收入	574,962.90

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	1,211,257.04
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,211,257.04

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	-34,691,877.94
——股票投资	-34,691,877.94
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的	-

预估增值税	
合计	-34,691,877.94

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	-152,806.42
合计	-152,806.42

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	31,439.70
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,405.10
其他	59,507.37
合计	152,859.54

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人

广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达创业板 200 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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	-	-	51,745,060.33	17.81%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	5,175.48	17.81%	1,405.74	5.56%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2.本基金佣金协议约定的服务仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

3.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人

管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	288,953.83	626,182.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,109.79	10,362.86
应支付基金管理人的净管理费	282,844.04	615,820.02

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

H＝E×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月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	96,317.91	208,727.66

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

H＝E×0.05%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

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
易方达创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	123,820,841.00	70.4532%	217,661,341.00	80.6903%

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		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
中国银行-活期存款	782,046.97	3,207.29	1,555,941.06	4,601.00

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

利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 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
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40

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
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	171	9,107.46	10,044.54	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	4,625	46,758.75	46,758.75	-
00124	华润	2026-0	6 个月	新股	10.11	10.11	10,794	109,12	109,12	-

8	新能源	6-24		流通受限				7.34	7.34	
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	435	11,827.65	13,619.85	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	309	9,387.42	12,047.91	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	636	29,306.88	294,677.88	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	410	28,560.60	65,624.60	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

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

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 0.00%(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	782,046.97	-	-	-	782,046.97
结算备付金	246,246.84	-	-	-	246,246.84
存出保证金	32,908.02	-	-	-	32,908.02
交易性金融资产	-	-	-	295,676,796.34	295,676,796.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	668,889.47	668,889.47

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	1,061,201.83	-	-	296,406,178.44	297,467,380.27
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	-	-	-	28,351.32	28,351.32
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	37,536.87	37,536.87
应付托管费	-	-	-	12,512.29	12,512.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	110,041.36	110,041.36
负债总计	-	-	-	188,441.84	188,441.84
利率敏感度缺口	1,061,201.83	-	-	296,217,736.60	297,278,938.43
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	1,740,454.97	-	-	-	1,740,454.97
结算备付金	196,791.93	-	-	-	196,791.93
存出保证金	53,784.37	-	-	-	53,784.37
交易性金融资产	-	-	-	393,671,329.72	393,671,329.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	160,505.81	160,505.81
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,991,031.27	-	-	393,831,835.53	395,822,866.80
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	-	-	-	56,117.58	56,117.58
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	56,853.32	56,853.32
应付托管费	-	-	-	18,951.11	18,951.11
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.19	0.19
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	202,162.81	202,162.81
负债总计	-	-	-	334,085.01	334,085.01
利率敏感度缺口	1,991,031.27	-	-	393,497,750.52	395,488,781.79

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	295,676,796.34	99.46	393,671,329.72	99.54
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	295,676,796.34	99.46	393,671,329.72	99.54

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%	14,757,138.42	19,668,978.22
	2.业绩比较基准下降 5%	-14,757,138.42	-19,668,978.22

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	294,974,634.34
第二层次	155,886.09
第三层次	546,275.91
合计	295,676,796.34

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	295,676,796.34	99.40
	其中：股票	295,676,796.34	99.40
2	基金投资	-	-
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	1,028,293.81	0.35
8	其他各项资产	762,290.12	0.26
9	合计	297,467,380.27	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	1,370,257.12	0.46
B	采矿业	36,149.82	0.01
C	制造业	215,846,273.90	72.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	155,886.09	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,251,863.69	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,460,210.32	17.65
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	656,707.14	0.22
M	科学研究和技术服务业	7,039,281.70	2.37
N	水利、环境和公共设施管理业	2,306,066.35	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	374,415.00	0.13
Q	卫生和社会工作	897,412.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	5,280,689.75	1.78
S	综合	-	-
	合计	295,676,796.34	99.46

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	301511	德福科技	45,900	6,602,715.00	2.22
2	300570	太辰光	24,550	6,056,730.50	2.04
3	301396	宏景科技	16,940	5,617,304.00	1.89
4	300806	斯迪克	45,200	5,062,400.00	1.70
5	300776	帝尔激光	22,503	4,837,244.88	1.63
6	300438	鹏辉能源	54,600	4,523,610.00	1.52
7	300398	飞凯材料	71,100	4,390,425.00	1.48
8	300236	上海新阳	33,100	4,352,650.00	1.46
9	300870	欧陆通	11,320	3,913,210.80	1.32
10	300088	长信科技	331,200	3,841,920.00	1.29
11	300568	星源材质	186,200	3,485,664.00	1.17
12	300623	捷捷微电	75,900	3,414,741.00	1.15
13	300811	铂科新材	34,660	3,288,887.40	1.11
14	301205	联特科技	9,800	3,274,180.00	1.10
15	300655	晶瑞电材	150,832	3,230,821.44	1.09
16	301626	苏州天脉	8,300	3,186,868.00	1.07
17	300131	英唐智控	164,700	3,134,241.00	1.05
18	301018	申菱环境	26,600	3,075,226.00	1.03
19	300319	麦捷科技	103,600	3,069,668.00	1.03
20	300083	创世纪	223,700	3,046,794.00	1.02
21	300260	新莱应材	28,531	2,866,224.26	0.96
22	300184	力源信息	161,747	2,838,659.85	0.95
23	300077	国民技术	89,800	2,815,230.00	0.95
24	300657	弘信电子	60,900	2,680,818.00	0.90
25	300747	锐科激光	49,380	2,621,584.20	0.88
26	300558	贝达药业	39,000	2,537,730.00	0.85
27	300679	电连技术	42,000	2,519,580.00	0.85
28	300199	翰宇药业	110,900	2,448,672.00	0.82
29	300102	乾照光电	93,000	2,421,720.00	0.81
30	300602	飞荣达	47,000	2,406,400.00	0.81
31	300342	天银机电	50,400	2,368,800.00	0.80
32	300170	汉得信息	155,399	2,368,280.76	0.80
33	300166	东方国信	130,400	2,309,384.00	0.78
34	301171	易点天下	67,580	2,295,016.80	0.77
35	300738	奥飞数据	113,000	2,284,860.00	0.77
36	300065	海兰信	100,650	2,245,501.50	0.76
37	300364	中文在线	91,200	2,151,408.00	0.72
38	300409	道氏技术	105,906	2,110,706.58	0.71
39	300671	富满微	24,100	2,076,456.00	0.70
40	300303	聚飞光电	183,600	2,030,616.00	0.68
41	301095	广立微	17,100	2,018,655.00	0.68

42	301071	力量钻石	21,780	2,014,650.00	0.68
43	300593	新雷能	66,860	2,009,811.60	0.68
44	300607	拓斯达	48,400	1,995,532.00	0.67
45	300693	盛弘股份	40,400	1,969,500.00	0.66
46	300296	利亚德	338,000	1,892,800.00	0.64
47	300821	东岳硅材	91,000	1,870,960.00	0.63
48	301486	致尚科技	8,900	1,854,048.00	0.62
49	300773	拉卡拉	118,740	1,816,722.00	0.61
50	301005	超捷股份	16,000	1,784,960.00	0.60
51	300257	开山股份	61,195	1,755,072.60	0.59
52	300576	容大感光	34,212	1,752,338.64	0.59
53	300459	汤姆猫	508,700	1,724,493.00	0.58
54	300726	宏达电子	20,300	1,716,771.00	0.58
55	300353	东土科技	82,100	1,706,038.00	0.57
56	300182	捷成股份	358,157	1,701,245.75	0.57
57	300118	东方日升	135,700	1,689,465.00	0.57
58	300573	兴齐眼药	39,419	1,606,718.44	0.54
59	301297	富乐德	26,200	1,604,488.00	0.54
60	300613	富瀚微	19,900	1,593,592.00	0.54
61	300315	掌趣科技	402,900	1,571,310.00	0.53
62	300382	斯莱克	67,680	1,564,084.80	0.53
63	301029	怡合达	57,600	1,555,776.00	0.52
64	300007	汉威科技	40,400	1,543,280.00	0.52
65	300031	宝通科技	53,800	1,537,066.00	0.52
66	300827	上能电气	49,441	1,522,288.39	0.51
67	301219	腾远钴业	27,250	1,493,300.00	0.50
68	300779	惠城环保	29,440	1,477,888.00	0.50
69	300229	拓尔思	106,100	1,466,302.00	0.49
70	300053	航宇微	88,100	1,449,245.00	0.49
71	300777	中简科技	55,000	1,445,400.00	0.49
72	300687	赛意信息	46,500	1,441,500.00	0.48
73	300676	华大基因	40,800	1,430,448.00	0.48
74	300133	华策影视	201,700	1,428,036.00	0.48
75	300468	四方精创	67,800	1,424,478.00	0.48
76	300735	光弘科技	61,000	1,387,140.00	0.47
77	301316	慧博云通	35,200	1,386,176.00	0.47
78	300185	通裕重工	504,350	1,376,875.50	0.46
79	300009	安科生物	172,900	1,357,265.00	0.46
80	300146	汤臣倍健	149,500	1,351,480.00	0.45
81	300049	福瑞医科	34,400	1,337,472.00	0.45
82	300327	中颖电子	41,065	1,316,133.25	0.44
83	300113	顺网科技	72,000	1,311,120.00	0.44
84	300775	三角防务	59,200	1,304,768.00	0.44
85	300045	华力创通	75,600	1,303,344.00	0.44

86	300596	利安隆	24,800	1,301,504.00	0.44
87	300401	花园生物	59,166	1,295,143.74	0.44
88	300109	新开源	79,786	1,280,565.30	0.43
89	300100	双林股份	46,040	1,278,991.20	0.43
90	300638	广和通	68,900	1,275,339.00	0.43
91	300181	佐力药业	90,407	1,274,738.70	0.43
92	300674	宇信科技	84,600	1,273,230.00	0.43
93	301510	固高科技	39,800	1,270,814.00	0.43
94	300035	中科电气	87,400	1,260,308.00	0.42
95	301275	汉朔科技	28,000	1,257,200.00	0.42
96	300130	新国都	59,400	1,249,776.00	0.42
97	300378	鼎捷数智	34,300	1,238,230.00	0.42
98	300457	赢合科技	58,600	1,235,288.00	0.42
99	300846	首都在线	58,200	1,234,422.00	0.42
100	300618	寒锐钴业	34,200	1,220,940.00	0.41
101	300850	新强联	44,347	1,188,499.60	0.40
102	300224	正海磁材	88,210	1,175,839.30	0.40
103	300416	苏试试验	55,890	1,139,038.20	0.38
104	300624	万兴科技	21,731	1,127,186.97	0.38
105	300145	南方泵业	206,700	1,126,515.00	0.38
106	300725	药石科技	30,540	1,117,764.00	0.38
107	300070	碧水源	343,400	1,095,446.00	0.37
108	300455	航天智装	50,546	1,088,760.84	0.37
109	300820	英杰电气	11,900	1,073,737.00	0.36
110	300204	舒泰神	45,100	1,072,478.00	0.36
111	301345	涛涛车业	4,602	1,063,062.00	0.36
112	300855	图南股份	33,795	1,056,431.70	0.36
113	300861	美畅股份	41,520	1,045,888.80	0.35
114	300682	朗新科技	105,500	1,044,450.00	0.35
115	301263	泰恩康	50,420	1,033,105.80	0.35
116	300101	振芯科技	63,400	1,025,178.00	0.34
117	300276	三丰智能	141,200	1,012,404.00	0.34
118	300357	我武生物	41,800	974,776.00	0.33
119	300415	伊之密	48,900	973,599.00	0.33
120	300660	江苏雷利	33,930	945,289.80	0.32
121	300348	长亮科技	106,800	939,840.00	0.32
122	300761	立华股份	57,200	938,652.00	0.32
123	300026	红日药业	322,200	934,380.00	0.31
124	300957	贝泰妮	29,400	926,394.00	0.31
125	301291	明阳电气	25,600	921,344.00	0.31
126	301078	孩子王	135,200	913,952.00	0.31
127	300723	一品红	24,500	913,360.00	0.31
128	301606	绿联科技	14,800	903,096.00	0.30
129	301050	雷电微力	26,780	895,523.20	0.30

130	301035	润丰股份	18,730	869,072.00	0.29
131	300708	聚灿光电	100,861	865,387.38	0.29
132	300446	航天智造	50,700	853,281.00	0.29
133	300910	瑞丰新材	30,080	843,443.20	0.28
134	301069	凯盛新材	41,791	837,491.64	0.28
135	300168	万达信息	181,717	834,081.03	0.28
136	300079	数码视讯	196,100	823,620.00	0.28
137	300595	欧普康视	78,200	823,446.00	0.28
138	300363	博腾股份	50,600	821,744.00	0.28
139	300772	运达股份	66,120	813,276.00	0.27
140	301039	中集车辆	114,800	809,340.00	0.27
141	300685	艾德生物	47,860	805,962.40	0.27
142	300075	数字政通	78,224	799,449.28	0.27
143	301238	瑞泰新材	32,700	797,880.00	0.27
144	300634	彩讯股份	40,400	790,628.00	0.27
145	300072	海新能科	230,900	785,060.00	0.26
146	300036	超图软件	68,864	776,097.28	0.26
147	301589	诺瓦星云	5,144	766,353.12	0.26
148	300180	华峰超纤	194,300	765,542.00	0.26
149	301487	盟固利	39,600	758,340.00	0.26
150	301522	上大股份	28,600	748,462.00	0.25
151	300188	国投智能	79,800	746,130.00	0.25
152	301080	百普赛斯	15,480	743,040.00	0.25
153	300443	金雷股份	34,400	742,352.00	0.25
154	300428	立中集团	40,613	738,344.34	0.25
155	300232	洲明科技	127,200	728,856.00	0.25
156	300598	诚迈科技	25,240	716,816.00	0.24
157	300482	万孚生物	42,900	712,569.00	0.24
158	300470	中密控股	24,013	696,617.13	0.23
159	300678	中科信息	30,950	693,280.00	0.23
160	300525	博思软件	92,700	689,688.00	0.23
161	300140	节能环境	136,600	678,902.00	0.23
162	300294	博雅生物	46,500	662,160.00	0.22
163	300217	东方电热	154,900	661,423.00	0.22
164	300226	上海钢联	42,894	656,707.14	0.22
165	300171	东富龙	58,600	648,116.00	0.22
166	300580	贝斯特	32,100	645,531.00	0.22
167	301363	美好医疗	35,104	643,456.32	0.22
168	300298	三诺生物	45,700	637,515.00	0.21
169	300913	兆龙互连	13,300	637,203.00	0.21
170	300841	康华生物	13,100	623,036.00	0.21
171	300633	开立医疗	33,600	617,904.00	0.21
172	300451	创业慧康	193,000	617,600.00	0.21
173	300770	新媒股份	19,500	614,055.00	0.21

174	301155	海力风电	14,100	604,890.00	0.20
175	300783	三只松鼠	36,900	583,020.00	0.20
176	300267	尔康制药	170,600	562,980.00	0.19
177	300641	正丹股份	36,300	558,294.00	0.19
178	300815	玉禾田	32,521	531,718.35	0.18
179	300284	苏交科	103,880	519,400.00	0.17
180	300143	盈康生命	75,350	507,859.00	0.17
181	300206	理邦仪器	40,900	500,207.00	0.17
182	301091	深城交	31,297	485,103.50	0.16
183	300080	易成新能	125,800	473,008.00	0.16
184	300127	银河磁体	16,900	472,355.00	0.16
185	300134	大富科技	54,700	467,685.00	0.16
186	300768	迪普科技	33,900	466,803.00	0.16
187	300702	天宇股份	22,800	459,648.00	0.15
188	300406	九强生物	41,600	454,688.00	0.15
189	300087	ST 荃银	80,224	431,605.12	0.15
190	300705	九典制药	42,580	416,432.40	0.14
191	301061	匠心家居	11,494	403,094.58	0.14
192	301551	无线传媒	20,300	400,519.00	0.13
193	301015	百洋医药	20,700	394,542.00	0.13
194	301267	华厦眼科	26,700	389,553.00	0.13
195	301327	华宝新能	7,940	381,675.80	0.13
196	300492	华图山鼎	10,900	374,415.00	0.13
197	301153	中科江南	22,480	366,199.20	0.12
198	301381	赛维时代	19,216	354,343.04	0.12
199	301371	敷尔佳	12,290	319,540.00	0.11
200	301666	大普微	636	294,677.88	0.10
201	301262	海看股份	15,600	280,332.00	0.09
202	001248	华润新能源	15,419	155,886.09	0.05
203	301682	宏明电子	410	65,624.60	0.02
204	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
205	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
206	301669	高特电子	546	15,506.40	0.01
207	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
208	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
209	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
210	001365	天海电子	435	13,619.85	0.00
211	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
212	001393	维通利	309	12,047.91	0.00
213	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
214	001237	惠康科技	171	10,044.54	0.00
215	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
216	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
217	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300776	帝尔激光	30,309,505.95	7.66
2	300185	通裕重工	12,767,096.42	3.23
3	301069	凯盛新材	4,613,116.47	1.17
4	300806	斯迪克	4,034,612.00	1.02
5	301396	宏景科技	3,247,253.20	0.82
6	300342	天银机电	2,950,947.00	0.75
7	301018	申菱环境	2,843,853.60	0.72
8	300623	捷捷微电	2,706,883.08	0.68
9	301626	苏州天脉	2,629,028.00	0.66
10	300679	电连技术	2,548,521.00	0.64
11	300102	乾照光电	2,400,269.00	0.61
12	300558	贝达药业	2,244,310.00	0.57
13	300353	东土科技	2,217,073.00	0.56
14	301486	致尚科技	2,048,698.00	0.52
15	301005	超捷股份	1,791,127.40	0.45
16	300779	惠城环保	1,775,337.20	0.45
17	300146	汤臣倍健	1,612,337.00	0.41
18	300676	华大基因	1,526,990.00	0.39
19	301263	泰恩康	1,524,368.76	0.39
20	300775	三角防务	1,503,867.00	0.38

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	300776	帝尔激光	29,395,653.03	7.43
2	300185	通裕重工	12,499,021.18	3.16
3	300475	香农芯创	10,651,603.00	2.69
4	300390	天华新能	9,168,638.60	2.32
5	300672	国科微	6,709,965.00	1.70
6	300620	光库科技	6,293,987.00	1.59
7	301217	铜冠铜箔	5,210,450.00	1.32
8	301377	鼎泰高科	4,831,378.00	1.22
9	301526	国际复材	4,808,267.00	1.22
10	301069	凯盛新材	4,237,452.37	1.07
11	300456	赛微电子	3,408,886.28	0.86

12	300953	震裕科技	3,314,971.60	0.84
13	300762	上海瀚讯	3,220,526.00	0.81
14	301550	斯菱智驱	2,625,716.50	0.66
15	300377	赢时胜	1,404,799.00	0.36
16	300766	每日互动	1,328,158.00	0.34
17	300252	金信诺	1,265,422.00	0.32
18	301345	涛涛车业	1,058,252.06	0.27
19	300212	*ST 易录	905,070.00	0.23
20	300068	ST 南都	869,544.00	0.22

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	149,339,944.74
卖出股票收入（成交）总额	134,403,644.97

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本基金本报告期未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	32,908.02
2	应收清算款	668,889.47
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	762,290.12

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	中国银行股份有限公司－易方达创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,818	96,671.68	148,046,654.00	84.24%	27,702,453.00	15.76%	123,820,841.00	70.45%

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（2023 年 12 月 15 日）基金份额总额	323,749,107.00
本报告期期初基金份额总额	269,749,107.00
本报告期基金总申购份额	240,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	334,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	175,749,107.00

§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、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	222,961,806.03	94.29%	22,295.77	94.29%	-
银河证券	1	13,500,592.33	5.71%	1,350.33	5.71%	-

粤开证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

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	
	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
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	45,824,357.85	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2026-01-22
3	易方达创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	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	2026-02-07
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金新增流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-09
5	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
6	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
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2026-04-22
8	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
9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万和证券为一级交易商的公告	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	2026-05-26
10	易方达基金管理有限公司关于易方达创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	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	2026-05-27
11	易方达基金管理有限公司关于易方达创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金变更基金名称及修改基金合同和托管协议的公告	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	2026-06-08
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分基金落实创业板中盘 200 指数编制方案修订相关安排的公告	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	2026-06-11
13	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告	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	2026-06-15

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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
中国银行股份有限公司－易方达创业板 200 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	217,661,341.00	57,344,800.00	151,185,300.00	123,820,841.00	70.45%
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创业板中盘 200 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

2.《易方达创业板 200 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3.《易方达创业板 200 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