

易方达国证价值 100 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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
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	45
§ 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	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	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	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	易方达国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达国证价值 100ETF
场内简称	价值 ETF 易方达
基金主代码	159263
交易代码	159263
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 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	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,916,105,126.00 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	2025 年 7 月 8 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	国证价值 100 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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	滕菲菲
	联系电话	020-85102688	4006800000
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400 881 8088	95558

传真	020-38798812	010-85230024
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	510627；510623；519031	100020
法定代表人	吴欣荣	方合英

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	-56,567,326.31
本期利润	-657,990,922.28
加权平均基金份额本期利润	-0.2388
本期加权平均净值利润率	-20.72%
本期基金份额净值增长率	-5.91%
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	167,720,019.67
期末可供分配基金份额利润	0.0341
期末基金资产净值	5,083,825,145.67
期末基金份额净值	1.0341
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	3.41%

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

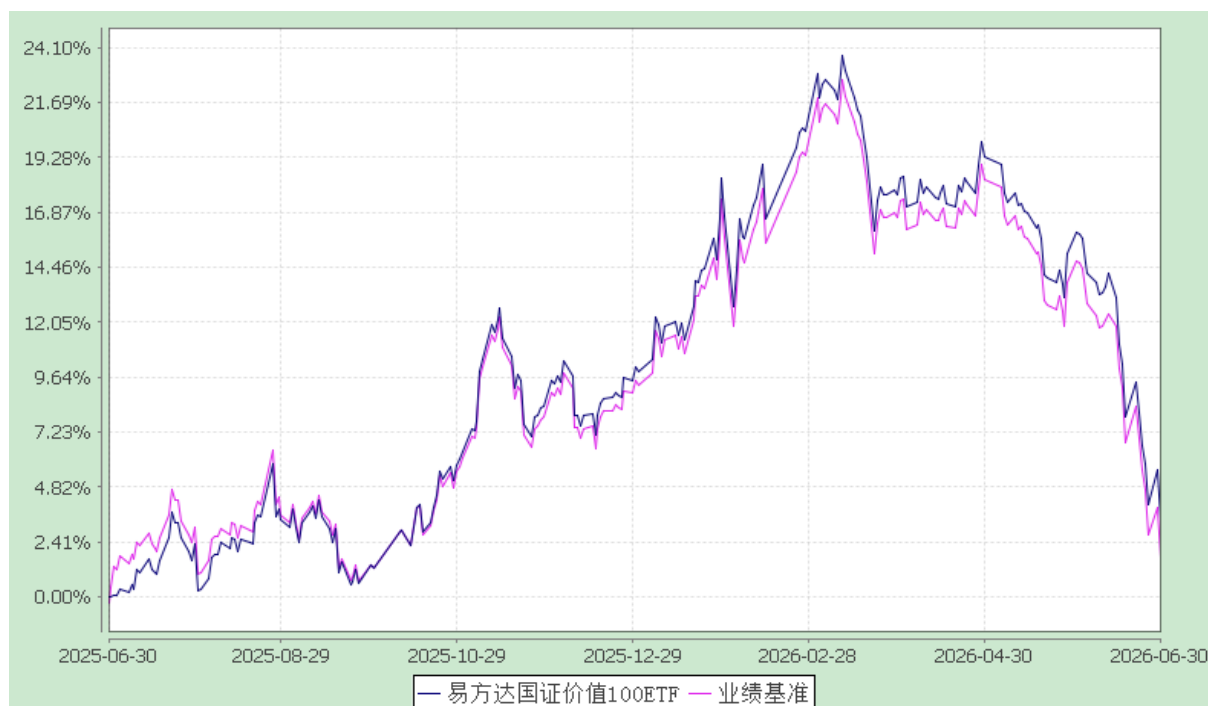
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-12.08%	0.81%	-12.75%	0.80%	0.67%	0.01%
过去六个月	-5.91%	0.96%	-6.90%	0.96%	0.99%	0.00%
过去一年	3.41%	0.84%	2.05%	0.84%	1.36%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	3.41%	0.84%	1.76%	0.84%	1.65%	0.00%

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

易方达国证价值 100 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 6 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：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 树 建	本基金的基金经理，易方达创业板中盘 200ETF（自 2023 年 12 月 15 日至 2026 年 02 月 06 日）、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 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	2025-06-30	-	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。
张 泽 峰	本基金的基金经理助理，易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证长江保护主题 ETF 联接发起式（自 2025 年 04 月 03 日至 2026	2025-07-26	-	5 年	博士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司研究员。

年 05 月 11 日)、易方达中证长江保护主题 ETF、易方达国证自由现金流 ETF、易方达国证通用航空产业 ETF、易方达上证 380ETF、易方达上证 380ETF 联接、易方达中证卫星产业 ETF、易方达中证 A500 红利低波动 ETF、易方达中证科创创业人工智能 ETF、易方达黄金 ETF、易方达国证自由现金流 ETF 联接的基金经理,易方达中证 A100ETF 联接发起式、易方达中证 A100ETF、易方达中证万得生物科技指数 (LOF)、易方达中证国企一带一路 ETF、易方达上证科创板人工智能 ETF、易方达国证成长 100ETF、易方达国证价值 100ETF 联接发起式、易方达黄金 ETF 联接的基金经理助理				
---	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

本基金跟踪国证价值 100 指数，该指数为反映沪深北交易所价值风格突出的上市公司证券价格变化情况，丰富指数化投资工具而编制。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，我国国民经济克服外部不利因素，总体运行在合理区间，高质量发展向新向优，新动能快速成长。根据国家统计局初步核算，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%。工业生产方面，规模以上工业增加值保持较快增长，装备制造业、高技术制造业的支撑作用进一步增强，制造业转型升级持续推进。服务业总体保持平稳增长，信息传输、软件和信息技术服务业等现代服务业表现相对较好。消费方面，上半年居民收入稳定增长，消费市场总体平稳，服务消费以及部分升级类、改善型消费保持增长。固定资产投资仍面临一定压力，房地产开发投资相对偏弱，但高技术产业等领域保持结构性亮点。出口方面，上半年货物贸易规模再创历史新高，机电产品和高技术产品出口表现较好，体现了我国制造业供应链的韧性和国际竞争力。政策方面，上半年更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策对扩大内需、优化供给和稳定预期发挥重要作用，“两重”“两新”等政策继续实施，科技创新、民生保障和重点领域风险化解得到有力支持。资本市场方面，市场基础制度持续完善，投融资协调和中长期资金入市环境进一步优化。海外方面，地缘冲突、国际能源价格波动以及主要经济体货币政策预期变化，对全球通胀预期和市场风险偏好形成一定扰动。市场方面，上半年权益市场结构分化较为明显，科技成长方向表现相对较好，价值风格阶段性承压。2026 年上半年，国证价值 100 指数下跌 6.90%。

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 1.0341 元，本报告期份额净值增长率为-5.91%，同期业绩比较基准收益率为-6.90%。年化跟踪误差 1.15%，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

展望中长期，我国经济总量有望保持平稳运行，发展质量提升和经济结构优化将成为更重要的增长来源。我国拥有超大规模市场、完整产业体系和持续积累的人力资本，能够为扩大内需、产业升级和技术扩散提供坚实基础。随着全国统一大市场建设深入推进，消费潜力逐步释放，公共服务和社会保障体系不断完善，国内大循环的内生动力将持续增强。与此同时，人工智能、先进制造、绿色转型、生命科学等新产业持续成长，并加快向传统行业渗透，通过提高生产效率、拓展新需求和重塑产业组织方式，形成新的增长动能。外部经贸环境、部分领域供需矛盾和资产负债表修复仍可能带来阶段性挑战，但我国制造业的系统配套能力、工程化效率和企业全球化能力仍具较强韧性。伴随创新成果加快转化、产业链附加值持续提升以及优质企业全球竞争力不断增强，我国经济结构有望继续向新向优，为长期平稳增长提供更稳固的支撑。

中长期来看，价值风格资产的核心特征体现为企业持续稳定的盈利创造能力、稳健的经营质量、充裕的自由现金流、完善的公司治理与可持续的股东回报机制。随着我国经济更加重视发展质量和经营效率，一批处于成熟行业或具有稳定竞争格局的企业，仍可通过精细化管理、产品结构优化、行业整合和国际化经营提升资本回报水平。资本市场制度层面持续聚焦上市公司质量提升与投资者回报机制完善，分红、回购等机制逐步完善，也有利于企业经营成果更有效地传递给长期投资者。国证价值 100 指数聚焦价值特征较为突出的上市公司，成份股整体具有经营相对稳健、现金流和分红能力较强等特点。同时需客观看待，价值类资产仍会受到宏观增长、行业周期、商品价格和利率环境变化的影响，不同行业和企业之间的基本面可能存在分化。中长期来看，具备核心竞争壁垒、稳健资产负债表、完善治理结构与持续股东回报能力的企业，其稳定的内生价值创造能力，构成价值风格长期运行的核心底层支撑。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对易方达国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，易方达基金管理有限公司在易方达国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，易方达基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

§ 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：易方达国证价值 100 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	175,326,538.53	10,137,834.51
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,080,848,582.50	1,288,436,969.36
其中：股票投资		5,080,848,582.50	1,288,436,969.36
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		-	174,400.58
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		5,256,235,613.66	1,298,749,204.45
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		180,389.17	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		711,715.78	459,204.73
应付托管费		237,238.59	91,840.94
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	171,281,124.45	6,816,032.90
负债合计		172,410,467.99	7,367,078.57
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,916,105,126.00	1,175,105,126.00

未分配利润	6.4.7.8	167,720,019.67	116,276,999.88
净资产合计		5,083,825,145.67	1,291,382,125.88
负债和净资产总计		5,256,235,613.66	1,298,749,204.45

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 6 月 30 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 6 月 30 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 1.0341 元，基金份额总额 4,916,105,126.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达国证价值 100 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 6 月 30 日（基 金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-650,610,115.50	2,124.26
1.利息收入		56,992.47	-
其中：存款利息收入	6.4.7.9	56,992.47	-
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）		-52,513,538.91	-
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-137,038,708.36	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	84,525,169.45	-
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	-601,423,595.97	-
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	3,270,026.91	2,124.26
减：二、营业总支出		7,380,806.78	1,035.13
1. 管理人报酬		5,944,990.87	-
2. 托管费		1,292,007.79	-
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	143,808.12	1,035.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-657,990,922.28	1,089.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-657,990,922.28	1,089.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-657,990,922.28	1,089.13

注：本基金合同生效日为 2025 年 6 月 30 日，上年度可比期间为 2025 年 6 月 30 日至 2025 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达国证价值 100 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	1,175,105,126.00	116,276,999.88	1,291,382,125.88
二、本期期初净资产	1,175,105,126.00	116,276,999.88	1,291,382,125.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,741,000,000.00	51,443,019.79	3,792,443,019.79
（一）、综合收益总额	-	-657,990,922.28	-657,990,922.28
（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）	3,741,000,000.00	709,433,942.07	4,450,433,942.07
其中：1.基金申购款	5,637,000,000.00	918,772,432.34	6,555,772,432.34
2.基金赎回款	-1,896,000,000.00	-209,338,490.27	-2,105,338,490.27
（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	4,916,105,126.00	167,720,019.67	5,083,825,145.67
项目	上年度可比期间 2025 年 6 月 30 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	466,105,126.00	-	466,105,126.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	1,089.13	1,089.13
（一）、综合收益总额	-	1,089.13	1,089.13
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（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	466,105,126.00	1,089.13	466,106,215.13

注：本基金合同生效日为 2025 年 6 月 30 日，上年度可比期间为 2025 年 6 月 30 日至 2025 年 6 月 30 日。

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：王永铨

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达国证价值 100 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]1083 号《关于准予易方达国证价值 100 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《易方达国证价值 100 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,《易方达国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 6 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 466,105,126.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 27,126.00 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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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	1,503,302.49
等于：本金	1,503,262.64
加：应计利息	39.85
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	173,823,236.04
等于：本金	173,813,535.94
加：应计利息	9,700.10
合计	175,326,538.53

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		5,654,280,959.51	-	5,080,848,582.50	-573,432,377.01
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	5,654,280,959.51	-	5,080,848,582.50	-573,432,377.01

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	84,300.75
应付替代款	166,662,618.25
其他应付款	4,534,205.45
合计	171,281,124.45

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	1,175,105,126.00	1,175,105,126.00
本期申购	5,637,000,000.00	5,637,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,896,000,000.00	-1,896,000,000.00
本期末	4,916,105,126.00	4,916,105,126.00

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	64,174,013.93	52,102,985.95	116,276,999.88
本期期初	64,174,013.93	52,102,985.95	116,276,999.88
本期利润	-56,567,326.31	-601,423,595.97	-657,990,922.28
本期基金份额交易产生的变动数	412,684,194.13	296,749,747.94	709,433,942.07
其中：基金申购款	594,986,970.95	323,785,461.39	918,772,432.34
基金赎回款	-182,302,776.82	-27,035,713.45	-209,338,490.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	420,290,881.75	-252,570,862.08	167,720,019.67

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	1,188.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	55,803.59
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	56,992.47

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	-123,522,510.12
股票投资收益——赎回差价收入	-13,516,198.24
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	-137,038,708.36

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	7,166,778,460.59
减：卖出股票成本总额	7,283,993,772.65
减：交易费用	6,307,198.06
买卖股票差价收入	-123,522,510.12

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	2,105,338,490.27
减：现金支付赎回款总额	1,456,082,105.27
减：赎回股票成本总额	662,772,583.24
减：交易费用	-
赎回差价收入	-13,516,198.24

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

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	84,525,169.45
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	84,525,169.45

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	-601,423,595.97
——股票投资	-601,423,595.97
——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	-601,423,595.97

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	3,270,026.91
合计	3,270,026.91

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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	69,424.36
合计	143,808.12

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
中信银行股份有限公司	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
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	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6月30日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,944,990.87	-
其中：应支付销售机构的客户维护费	414,381.00	-
应支付基金管理人的净管理费	5,530,609.87	-

注：1.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，由基金管理人与基金托管人核对一致后，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2.自 2026 年 5 月 29 日起本基金管理费率由 0.50%调整为 0.15%。

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6月30日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,292,007.79	-

注：1.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，由基金管理人与基金托管人核对一致后，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2.自 2026 年 5 月 29 日起本基金托管费率由 0.10%调整为 0.05%。

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
易方达国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	632,768,200.00	12.8713%	213,726,400.00	18.1879%
广发证券股份有限公司	3,980,943.00	0.0810%	320,392.00	0.0273%
易方达资产管理有限公司	206,900.00	0.0042%	-	-

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6月30日（基金合同生效日）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
中信银行-活期存款	1,503,302.49	1,188.88	466,080,930.42	-

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中信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：）	总金额

				股/张)	
广发证券股份 有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
上年度可比期间 2025 年 6 月 30 日（基金合同生效日）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
-	-	-	-	-	-

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	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
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	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
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	1,220	56,217.60	565,262.60	-
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	714	49,737.24	114,282.84	-
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	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

				受限						
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
000651	格力电器	2026-06-04	6 个月	大宗交易流通受限	37.13	36.53	2,400,000	89,112,000.00	87,672,000.00	-

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	175,326,538.53	-	-	-	175,326,538.53
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	5,080,848,582.50	5,080,848,582.50
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	175,326,538.53	-	-	5,080,909,075.13	5,256,235,613.66
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	-	-	-	180,389.17	180,389.17
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	711,715.78	711,715.78
应付托管费	-	-	-	237,238.59	237,238.59
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	-	-	-	171,281,124.45	171,281,124.45
负债总计	-	-	-	172,410,467.99	172,410,467.99

					.99
利率敏感度缺口	175,326,538.53	-	-	4,908,498,607.14	5,083,825,145.67
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	10,137,834.51	-	-	-	10,137,834.51
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,288,436,969.36	1,288,436,969.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	174,400.58	174,400.58
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,137,834.51	-	-	1,288,611,369.94	1,298,749,204.45
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	459,204.73	459,204.73
应付托管费	-	-	-	91,840.94	91,840.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,816,032.90	6,816,032.90

负债总计	-	-	-	7,367,078.57	7,367,078.57
利率敏感度缺口	10,137,834.51	-	-	1,281,244,291.37	1,291,382,125.88

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	5,080,848,582.50	99.94	1,288,436,969.36	99.77
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	5,080,848,582.50	99.94	1,288,436,969.36	99.77

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	253,938,239.85	64,403,693.07
	2.业绩比较基准下降 5%	-253,938,239.85	-64,403,693.07

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	4,991,209,009.42
第二层次	850,291.44
第三层次	88,789,281.64
合计	5,080,848,582.50

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	5,080,848,582.50	96.66
	其中：股票	5,080,848,582.50	96.66
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	175,326,538.53	3.34
8	其他各项资产	60,492.63	0.00
9	合计	5,256,235,613.66	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	-	-
B	采矿业	300,382,506.32	5.91
C	制造业	2,467,332,388.42	48.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	169,832,862.44	3.34

E	建筑业	261,569,870.80	5.15
F	批发和零售业	172,900,691.99	3.40
G	交通运输、仓储和邮政业	202,244,682.50	3.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	418,859,347.12	8.24
J	金融业	1,010,010,269.97	19.87
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	25,719,460.96	0.51
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	51,996,501.98	1.02
S	综合	-	-
	合计	5,080,848,582.50	99.94

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	000651	格力电器	11,701,503	436,478,362.50	8.59
2	601166	兴业银行	23,925,000	396,198,000.00	7.79
3	000333	美的集团	4,962,409	374,810,751.77	7.37
4	600036	招商银行	9,436,916	335,010,518.00	6.59
5	600690	海尔智家	8,692,900	177,422,089.00	3.49
6	601117	中国化学	23,163,000	170,248,050.00	3.35
7	600741	华域汽车	10,611,613	164,692,233.76	3.24
8	600096	云天化	5,355,800	162,816,320.00	3.20
9	601728	中国电信	31,329,654	162,600,904.26	3.20
10	601600	中国铝业	18,441,300	151,587,486.00	2.98
11	601225	陕西煤业	7,447,450	151,555,607.50	2.98
12	600050	中国联通	30,705,100	122,820,400.00	2.42
13	600941	中国移动	1,287,680	110,907,878.40	2.18
14	601766	中国中车	18,816,700	97,846,840.00	1.92
15	600938	中国海油	3,221,800	87,471,870.00	1.72
16	000708	中信特钢	6,770,300	85,441,186.00	1.68
17	002532	天山铝业	5,859,000	62,867,070.00	1.24

18	601001	晋控煤业	3,526,100	61,318,879.00	1.21
19	000001	平安银行	5,994,902	60,248,765.10	1.19
20	600019	宝钢股份	10,746,800	58,355,124.00	1.15
21	002091	江苏国泰	8,002,800	57,860,244.00	1.14
22	603565	中谷物流	5,515,984	54,111,803.04	1.06
23	000951	中国重汽	2,697,183	52,622,040.33	1.04
24	600428	中远海特	6,672,900	52,115,349.00	1.03
25	000921	海信家电	1,827,200	49,919,104.00	0.98
26	601229	上海银行	5,731,108	49,746,017.44	0.98
27	601577	长沙银行	5,376,303	46,827,599.13	0.92
28	600585	海螺水泥	2,705,300	45,854,835.00	0.90
29	600219	南山铝业	11,420,800	45,568,992.00	0.90
30	601818	光大银行	14,859,000	42,942,510.00	0.84
31	600015	华夏银行	6,453,300	41,236,587.00	0.81
32	600023	浙能电力	7,748,600	40,757,636.00	0.80
33	600642	申能股份	4,561,600	39,822,768.00	0.78
34	000690	宝新能源	8,223,000	38,648,100.00	0.76
35	601877	正泰电器	1,529,867	38,353,765.69	0.75
36	002011	盾安环境	3,543,300	37,594,413.00	0.74
37	600729	重百集团	1,949,928	36,619,647.84	0.72
38	000915	华特达因	1,221,032	34,567,415.92	0.68
39	603816	顾家家居	1,494,031	33,406,533.16	0.66
40	000719	中原传媒	2,821,000	32,244,030.00	0.63
41	000404	长虹华意	3,858,672	30,329,161.92	0.60
42	601156	东航物流	1,804,500	29,088,540.00	0.57
43	600039	四川路桥	3,647,340	28,522,198.80	0.56
44	600970	中材国际	3,974,600	28,338,898.00	0.56
45	601000	唐山港	6,488,800	26,928,520.00	0.53
46	600057	厦门象屿	4,745,288	25,719,460.96	0.51
47	600060	海信视像	896,400	24,982,668.00	0.49
48	600351	亚宝药业	4,290,686	24,671,444.50	0.49
49	601717	中创智领	1,612,400	22,428,484.00	0.44
50	600398	海澜之家	4,246,100	22,207,103.00	0.44
51	600694	大商股份	1,630,494	21,571,435.62	0.42
52	600742	富维股份	2,979,380	21,570,711.20	0.42
53	603368	柳药集团	1,378,659	20,224,927.53	0.40
54	600998	九州通	4,299,300	20,163,717.00	0.40
55	002061	浙江交科	6,021,480	19,870,884.00	0.39
56	920599	同力股份	1,181,349	19,456,818.03	0.38
57	000513	丽珠集团	665,000	19,211,850.00	0.38
58	600033	福建高速	5,961,400	19,195,708.00	0.38
59	300770	新媒股份	603,654	19,009,064.46	0.37
60	002563	森马服饰	3,315,400	16,709,616.00	0.33
61	600295	鄂尔多斯	1,539,900	16,507,728.00	0.32

62	600801	华新建材	987,900	15,411,240.00	0.30
63	600170	上海建工	6,572,000	14,589,840.00	0.29
64	600874	创业环保	2,640,600	14,153,616.00	0.28
65	600578	京能电力	2,017,700	13,014,165.00	0.26
66	605377	华旺科技	1,330,700	12,375,510.00	0.24
67	600461	洪城环境	1,352,600	12,254,556.00	0.24
68	601128	常熟银行	2,007,130	11,681,496.60	0.23
69	600380	健康元	1,209,000	11,388,780.00	0.22
70	600987	航民股份	1,726,200	10,443,510.00	0.21
71	601997	贵阳银行	2,007,800	10,300,014.00	0.20
72	002839	张家港行	2,609,100	10,175,490.00	0.20
73	600528	中铁工业	1,472,612	9,704,513.08	0.19
74	000411	英特集团	880,540	7,951,276.20	0.16
75	600757	长江传媒	1,083,958	7,923,732.98	0.16
76	600300	维维股份	2,734,400	7,711,008.00	0.15
77	601298	青岛港	948,300	7,633,815.00	0.15
78	600480	凌云股份	917,900	7,627,749.00	0.15
79	601900	南方传媒	675,600	7,337,016.00	0.14
80	600273	嘉化能源	1,100,300	7,173,956.00	0.14
81	601598	中国外运	1,403,500	6,961,360.00	0.14
82	603187	海容冷链	588,200	6,758,418.00	0.13
83	603508	思维列控	312,600	6,677,136.00	0.13
84	002034	旺能环境	440,600	6,675,090.00	0.13
85	601339	百隆东方	926,400	6,271,728.00	0.12
86	600269	赣粤高速	1,559,800	6,208,004.00	0.12
87	002508	老板电器	414,100	6,054,142.00	0.12
88	002293	罗莱生活	588,830	5,823,528.70	0.11
89	300360	炬华科技	495,230	5,818,952.50	0.11
90	603323	苏农银行	1,458,210	5,643,272.70	0.11
91	603279	景津装备	464,300	5,571,600.00	0.11
92	601163	三角轮胎	438,500	5,564,565.00	0.11
93	002697	红旗连锁	1,106,180	4,601,708.80	0.09
94	601801	皖新传媒	911,100	4,491,723.00	0.09
95	002758	浙农股份	494,650	3,907,735.00	0.08
96	600780	通宝能源	624,000	3,656,640.00	0.07
97	603558	健盛集团	326,700	3,623,103.00	0.07
98	002322	理工能科	363,000	3,521,100.00	0.07
99	002404	嘉欣丝绸	407,700	2,332,044.00	0.05
100	603948	建业股份	68,100	1,641,210.00	0.03
101	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.02
102	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
103	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
104	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
105	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00

106	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
107	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
108	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
109	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
110	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
111	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
112	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
113	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
114	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
115	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
116	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
117	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
118	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
119	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
120	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
121	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
122	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
123	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
124	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	601166	兴业银行	637,625,109.82	49.38
2	600036	招商银行	561,738,283.10	43.50
3	601225	陕西煤业	524,219,389.93	40.59
4	601600	中国铝业	404,434,009.34	31.32
5	600938	中国海油	380,570,987.14	29.47
6	601857	中国石油	322,386,339.60	24.96
7	601728	中国电信	289,406,473.32	22.41
8	601117	中国化学	278,416,055.70	21.56
9	600741	华域汽车	269,058,418.68	20.83
10	600690	海尔智家	258,295,834.67	20.00
11	600919	江苏银行	245,820,917.25	19.04
12	600096	云天化	215,576,205.23	16.69
13	600941	中国移动	213,843,621.11	16.56
14	600050	中国联通	208,072,767.44	16.11
15	601766	中国中车	200,688,134.90	15.54
16	000651	格力电器	163,232,727.60	12.64
17	000568	泸州老窖	158,044,268.28	12.24
18	000338	潍柴动力	143,633,873.20	11.12

19	002532	天山铝业	142,157,317.61	11.01
20	601001	晋控煤业	130,257,510.63	10.09
21	000333	美的集团	114,256,203.30	8.85
22	601229	上海银行	109,497,025.34	8.48
23	600219	南山铝业	105,356,863.00	8.16
24	600582	天地科技	103,940,557.33	8.05
25	600873	梅花生物	103,120,203.55	7.99
26	601818	光大银行	98,665,037.00	7.64
27	600023	浙能电力	93,659,615.00	7.25
28	002091	江苏国泰	91,090,893.71	7.05
29	600019	宝钢股份	85,880,670.48	6.65
30	603565	中谷物流	83,857,401.63	6.49
31	000690	宝新能源	82,031,079.00	6.35
32	600585	海螺水泥	81,381,902.33	6.30
33	000708	中信特钢	80,768,272.02	6.25
34	600428	中远海特	78,438,148.00	6.07
35	600352	浙江龙盛	75,825,606.38	5.87
36	600015	华夏银行	74,924,695.12	5.80
37	600729	重百集团	73,999,994.20	5.73
38	600027	华电国际	71,802,793.00	5.56
39	601838	成都银行	71,135,536.98	5.51
40	600642	申能股份	69,473,212.89	5.38
41	601919	中远海控	69,166,311.90	5.36
42	600188	兖矿能源	65,422,407.54	5.07
43	603816	顾家家居	65,331,908.45	5.06
44	601577	长沙银行	63,532,839.43	4.92
45	601877	正泰电器	61,526,071.20	4.76
46	600970	中材国际	58,008,218.89	4.49
47	601156	东航物流	57,457,236.00	4.45
48	000404	长虹华意	56,553,979.69	4.38
49	600039	四川路桥	56,395,595.97	4.37
50	601717	中创智领	53,145,969.00	4.12
51	600057	厦门象屿	52,561,099.17	4.07
52	002027	分众传媒	51,894,856.00	4.02
53	600710	苏美达	47,856,463.00	3.71
54	000951	中国重汽	47,807,064.20	3.70
55	600351	亚宝药业	47,238,175.34	3.66
56	002011	盾安环境	47,100,942.68	3.65
57	603833	欧派家居	45,655,422.00	3.54
58	601000	唐山港	44,248,385.38	3.43
59	600742	富维股份	43,951,819.04	3.40
60	600295	鄂尔多斯	41,193,394.00	3.19
61	603368	柳药集团	37,939,322.53	2.94
62	920599	同力股份	37,768,207.33	2.92

63	300770	新媒股份	37,465,860.27	2.90
64	600398	海澜之家	36,609,185.00	2.83
65	600216	浙江医药	36,141,270.90	2.80
66	601633	长城汽车	35,681,492.05	2.76
67	600801	华新建材	35,002,847.48	2.71
68	600694	大商股份	34,447,177.82	2.67
69	600033	福建高速	33,629,412.00	2.60
70	600060	海信视像	33,557,623.03	2.60
71	002563	森马服饰	33,201,938.00	2.57
72	000001	平安银行	32,630,478.00	2.53
73	601598	中国外运	28,985,580.00	2.24
74	600874	创业环保	28,702,115.93	2.22
75	600170	上海建工	28,434,853.00	2.20
76	603897	长城科技	27,941,869.00	2.16
77	600998	九州通	27,194,403.00	2.11
78	601298	青岛港	26,194,696.00	2.03
79	000921	海信家电	26,092,994.00	2.02

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	000338	潍柴动力	525,539,130.22	40.70
2	601225	陕西煤业	372,978,702.60	28.88
3	601857	中国石油	356,196,586.54	27.58
4	600938	中国海油	330,693,205.63	25.61
5	601600	中国铝业	287,291,976.10	22.25
6	600919	江苏银行	277,713,470.70	21.51
7	000568	泸州老窖	259,435,093.55	20.09
8	601166	兴业银行	247,369,456.85	19.16
9	000333	美的集团	215,390,836.86	16.68
10	600036	招商银行	188,569,246.54	14.60
11	000651	格力电器	180,408,965.56	13.97
12	601919	中远海控	170,234,205.54	13.18
13	600582	天地科技	108,836,885.92	8.43
14	600873	梅花生物	108,331,057.00	8.39
15	600741	华域汽车	99,330,076.75	7.69
16	601117	中国化学	96,744,837.00	7.49
17	601728	中国电信	95,554,465.00	7.40
18	601766	中国中车	92,461,223.05	7.16
19	600941	中国移动	88,990,994.99	6.89
20	600690	海尔智家	86,290,880.17	6.68

21	600352	浙江龙盛	84,206,433.00	6.52
22	601838	成都银行	83,716,857.00	6.48
23	000001	平安银行	82,541,293.08	6.39
24	600219	南山铝业	80,791,487.02	6.26
25	600096	云天化	80,706,404.00	6.25
26	002027	分众传媒	78,950,454.60	6.11
27	600050	中国联通	77,126,267.00	5.97
28	002001	新和成	77,048,944.00	5.97
29	601229	上海银行	73,576,377.00	5.70
30	002532	天山铝业	72,230,614.29	5.59
31	600027	华电国际	70,121,796.00	5.43
32	002648	卫星化学	68,158,277.84	5.28
33	601818	光大银行	65,488,071.00	5.07
34	600188	兖矿能源	64,105,024.60	4.96
35	601001	晋控煤业	61,168,713.30	4.74
36	600023	浙能电力	51,690,947.00	4.00
37	600710	苏美达	48,543,557.74	3.76
38	601169	北京银行	48,531,077.40	3.76
39	600015	华夏银行	43,229,405.00	3.35
40	000895	双汇发展	42,438,872.43	3.29
41	603833	欧派家居	41,217,032.02	3.19
42	600016	民生银行	38,688,870.00	3.00
43	000928	中钢国际	35,540,630.00	2.75
44	600216	浙江医药	33,977,863.00	2.63
45	600729	重百集团	33,699,915.72	2.61
46	601633	长城汽车	33,412,620.01	2.59
47	603565	中谷物流	31,408,968.58	2.43
48	600428	中远海特	30,362,963.00	2.35
49	600585	海螺水泥	29,152,303.00	2.26
50	002091	江苏国泰	28,349,985.00	2.20
51	603897	长城科技	28,336,903.60	2.19
52	600642	申能股份	28,142,479.00	2.18
53	603816	顾家家居	27,092,456.80	2.10
54	002056	横店东磁	27,050,378.00	2.09
55	000690	宝新能源	26,792,210.00	2.07
56	601156	东航物流	26,598,733.00	2.06
57	000708	中信特钢	26,491,823.00	2.05

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	10,084,088,735.12
卖出股票收入（成交）总额	7,166,778,460.59

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国铝业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到贵阳市应急管理局、西宁市生态环境局的处罚。

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

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	000651	格力电器	87,672,000.00	1.72	大宗交易流通受限

注：根据上海、深圳证券交易所发布的上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则，大股东减持或者特定股东减持，采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%；前款交易的受让方在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

§ 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	中信银行股份有限公司 一易方达国证价值 100 交易型开放式指数证券

						投资基金发起式联接基金	
		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
19,712	249,396.57	3,599,639,024.00	73.22%	1,316,466,102.00	26.78%	632,768,200.00	12.87%

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	67,100.00	0.0014%

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 6 月 30 日）基金份额总额	466,105,126.00
本报告期初基金份额总额	1,175,105,126.00
本报告期基金总申购份额	5,637,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,896,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,916,105,126.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。

2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

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，基金托管人未受到调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总额的 比例		金总量的 比例	
中信证券华南	7	17,248,698,067.78	100.00%	1,615,090.77	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信证券华南股份有限公司。本基金管理人与中信证券华南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 0.00936%。

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
中信证券华南	-	-	-	-	-	-

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	2026-03-23
4	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
5	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
6	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
7	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
8	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
9	易方达基金管理有限公司关于调低易方达国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金费率并修订基金合同、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	2026-05-26
10	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	易方达基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主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	2026-06-25

§ 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
中信银行股份有限公司—易方达国证价值100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2026 年 02 月 25 日 ~2026 年 03 月 22 日	213,726,400.00	729,713,700.00	310,671,900.00	632,768,200.00	12.87 %
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国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达国证价值 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达国证价值 100 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