

易方达上证科创板综合增强策略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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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	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	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	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股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52

7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达上证科创板综合增强策略 ETF
场内简称	科创增指、科创综指增强 ETF 易方达
基金主代码	588550
交易代码	588550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 27 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,290,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 9 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为增强策略交易型开放式指数证券投资基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。股票（含存托凭证）投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型，在控制组合风险与交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优选股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。本基金通过采取多个定量投资模型，力争分散模型风险，提高投资组合表现。为更好地实现投资目标，本基金可适当参与债券和货币市场工具的投资，并可投资股指期货、国债期货、股票期权，参与转融通证券出借业务、融资业务。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其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。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	潘琦
	联系电话	020-85102688	0755-22168257
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95511-3
传真		020-38798812	0755-82080387
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047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	广东省深圳市福田区益田路 5023号平安金融中心B座
邮政编码		510627；510623；519031	518001
法定代表人		吴欣荣	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	38,071,251.33
本期利润	52,883,705.62
加权平均基金份额本期利润	0.6684
本期加权平均净值利润率	53.05%
本期基金份额净值增长率	66.54%
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	33,018,580.92
期末可供分配基金份额利润	0.6438
期末基金资产净值	91,657,897.83
期末基金份额净值	1.7871

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	78.71%

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	67.11%	2.54%	55.71%	2.36%	11.40%	0.18%
过去六个月	66.54%	2.38%	53.99%	2.23%	12.55%	0.15%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	78.71%	2.13%	61.22%	2.07%	17.49%	0.06%

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

易方达上证科创板综合增强策略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 8 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：1.本基金合同于 2025 年 8 月 27 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
殷明	本基金的基金经理，易方达易百智 能量化策略混合、易方达中证 1000 量化增强、易方达上证科创板 100	2025- 08-27	-	10 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所研究员，国盛证券有限责任公司研

	增强策略 ETF、易方达上证科创板综合增强、易方达创业板增强的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员				究所金融工程分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员。
李博扬	本基金的基金经理助理，易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证龙头企业指数（自 2024 年 06 月 08 日至 2026 年 04 月 10 日）、易方达上证 180ETF、易方达上证 180ETF 联接、易方达上证科创板综合 ETF、易方达上证科创板人工智能 ETF 联接、易方达上证科创板 200ETF、易方达中证消费电子主题 ETF 联接发起式、易方达创业板 50ETF、易方达上证科创板新能源 ETF、易方达上证科创板 200ETF 联接、易方达上证 580ETF、易方达上证 580ETF 联接、易方达创业板 50ETF 联接、易方达上证科创板人工智能 ETF 的基金经理，易方达恒生 ETF(QDII)、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式（自 2024 年 09 月 14 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达中证沪港深 500ETF（自 2024 年 09 月 14 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证沪深港黄金产业股票指数发起式（自 2024 年 11 月 22 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达上证科创板综合 ETF 联接、易方达中证数字经济主题 ETF、易方达中证 A500 增强策略 ETF 的基金经理助理	2025-09-26	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任南方基金管理股份有限公司量化交易员、量化及指数研究员，易方达基金管理有限公司研究员。
刘砚芳	本基金的基金经理助理，易方达中证汽车零部件主题 ETF、易方达中证装备产业 ETF 联接发起式、易方达中证汽车零部件主题 ETF 联接发起式、易方达中证装备产业 ETF、易方达中证沪港深 300ETF 联接发起式、易方达中证万得并购重组指数（LOF）、易方达中证沪港深 300ETF、易方达上证中盘 ETF 联接、易方达上证中盘 ETF 的基金经	2025-09-26	-	5 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司研究员。

理，易方达上证科创板成长 ETF 联接发起式、易方达恒生 ETF(QDII)、易方达上证科创板成长 ETF 的基金经理助理				
---	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济顶住压力运行在合理区间，一季度增长开局良好，二季度增速有所回落。二季度的放缓主要受短期因素与外部环境影响：中东地缘冲突带来的能源供给冲击推升国际油价并沿产业链传导，部分石化相关行业受到扰动；同时部分需求在政策带动下已于前期集中释放，叠加房地产仍处调整阶段，内生需求偏弱，国内供强需弱的结构性矛盾较为突出。结构层面亮点亦

较为清晰：物价温和上涨，对外贸易增势良好，以信息服务业和高技术制造业为代表的新动能增速明显领先，新质生产力对经济增长的支撑作用持续显现。宏观政策方面，上半年更加积极有为的政策组合有效实施，财政与货币协同发力，市场流动性维持合理充裕，为实体经济与资本市场营造了总体适宜的环境。

在此背景下，上半年 A 股呈现“指数震荡抬升、结构极致分化”的行情特征。市场交投高度活跃，成交规模处于历史高位；但指数与个股层面的分化同样显著：科创 50 指数大幅上涨并创出历史新高，创业板指涨幅亦相当可观，而上证指数仅温和上涨，多数个股录得下跌，市场超额收益高度集中于科技硬制造赛道。行业层面，围绕全球 AI 资本开支、国产半导体替代与产业链上游涨价的主线贯穿上半年，半导体、光模块、PCB（印制电路板）等 AI 算力硬件方向领涨，半导体板块市值历史性跃居行业前列；与之相对，大消费、金融、地产等传统板块持续走弱。科创板作为本轮科技行情的核心载体，一季度报告披露后盈利的爆发性增长为板块上行提供了基本面支撑，上证科创板综合指数覆盖科创板上中下游各产业链环节，报告期内亦录得显著上涨，但成分股内部涨跌高度分化，盈利兑现能力成为个股定价的关键分水岭。

本基金作为指数增强型 ETF 基金，同时兼有指数增强与 ETF 两方面的特征：一方面在紧密跟踪上证科创板综合指数的前提下，通过量化方式力争获取超越业绩比较基准的收益；另一方面充分发挥 ETF 的工具属性。考虑到场内产品每日披露持仓且需要兼顾流动性管理，本基金的增强策略以低换手的基本面选股为主，侧重持有基本面扎实、成交与换手相对充裕的标的。本报告期内，市场上涨高度集中于少数权重与热门品种、多数个股下跌，这样的结构对偏重分散化持股的量化选股策略构成了较大考验；但另一方面，盈利兑现能力主导定价的市场环境，与本产品偏重基本面的选股框架较为契合，我们在上半年持续跟踪成分股一季报及中观景气变化，对基本面模型的因子权重进行了模型化的动态配置，其主要思路是基于历史时点信息对不同交易日给予不同的模型训练权重。同时，作为场内工具型产品，本基金上半年二级市场交易保持平稳，流动性维持在较为合理的水平，折溢价整体处于相对可控区间，较好地满足了投资者借道场内参与科创板块的配置与交易需求。

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 1.7871 元，本报告期份额净值增长率为 66.54%，同期业绩比较基准收益率为 53.99%。年化跟踪误差 5.33%，超过目标控制范围，主要是投资组合与指数权重的偏差有所扩大所致。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观政策有望加大逆周期和跨周期调节力度，持续扩大内需、优化供给，随着短期扰动因素逐步消除，前期受影响的行业有条件逐步恢复，经济增速有望企稳回升。需要跟踪的方

面包括：价格相关指标能否在政策发力下出现积极变化，地产调整与消费修复的进展，以及中东局势演变下能源价格对中下游行业成本与盈利的影响。

证券市场方面，上半年极致的结构性分化在下半年初已出现一定纠偏迹象，随着中报业绩陆续披露，围绕 AI 的交易预计将进一步进入考察盈利能力的阶段，概念驱动的品种可能被舍弃，资金有望向业绩确定、产业趋势具有持续性的方向集中。科创板块层面，海外与国产算力的推进节奏、半导体产业链的国产化进展与下游扩产状况、上游材料与资源品的价格传导，以及前期涨幅较大方向的业绩兑现情况，是下半年值得重点跟踪的主线；同时，部分成长板块估值已处于历史较高分位，若业绩兑现不及预期，波动可能加大，还需持续关注。

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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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

了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达上证科创板综合增强策略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	1,188,427.16	1,714,010.59
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	90,763,221.72	156,700,769.87
其中：股票投资		90,741,221.28	156,666,769.42
基金投资		-	-
债券投资		22,000.44	34,000.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		92,012,141.51	158,414,780.46
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	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		-	28,349.93
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		34,902.53	81,479.24
应付托管费		6,980.49	16,295.86
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	312,360.66	234,078.42
负债合计		354,243.68	360,203.45
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	51,290,000.00	147,290,000.00
未分配利润	6.4.7.8	40,367,897.83	10,764,577.01
净资产合计		91,657,897.83	158,054,577.01
负债和净资产总计		92,012,141.51	158,414,780.46

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 8 月 27 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 8 月 27 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 1.7871 元，基金份额总额 51,290,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		53,323,108.90
1.利息收入		2,233.50
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,233.50
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）		38,443,829.10
其中：股票投资收益	6.4.7.10	38,237,011.68
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.11	51,347.81
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	155,469.61
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	14,812,454.29
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	64,592.01
减：二、营业总支出		439,403.28
1. 管理人报酬		248,227.97
2. 托管费		49,645.54
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	141,529.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		52,883,705.62
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		52,883,705.62
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		52,883,705.62

注：本基金合同生效日为 2025 年 8 月 27 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达上证科创板综合增强策略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	147,290,000.00	10,764,577.01	158,054,577.01
二、本期期初净资产	147,290,000.00	10,764,577.01	158,054,577.01
三、本期增减变动	-96,000,000.00	29,603,320.82	-66,396,679.18

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	52,883,705.62	52,883,705.62
（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）	-96,000,000.00	-23,280,384.80	-119,280,384.80
其中：1.基金申购款	44,000,000.00	21,049,294.20	65,049,294.20
2.基金赎回款	-140,000,000.00	-44,329,679.00	-184,329,679.00
（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	51,290,000.00	40,367,897.83	91,657,897.83

注：本基金合同生效日为 2025 年 8 月 27 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达上证科创板综合增强策略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]940 号《关于准予易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 8 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 675,290,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

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	73,059.53
等于：本金	73,042.69
加：应计利息	16.84
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	1,115,367.63
等于：本金	1,115,227.95
加：应计利息	139.68
合计	1,188,427.16

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		66,889,020.67	-	90,741,221.28	23,852,200.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	21,999.85	0.59	22,000.44	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	21,999.85	0.59	22,000.44	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		66,911,020.52	0.59	90,763,221.72	23,852,200.61

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	82,020.15
应付替代款	159,597.68
可退替代款	65,005.49
其他应付款	5,737.34
合计	312,360.66

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	147,290,000.00	147,290,000.00
本期申购	44,000,000.00	44,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-140,000,000.00	-140,000,000.00
本期末	51,290,000.00	51,290,000.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,158,657.35	-3,394,080.34	10,764,577.01
本期期初	14,158,657.35	-3,394,080.34	10,764,577.01

本期利润	38,071,251.33	14,812,454.29	52,883,705.62
本期基金份额交易产生的变动数	-19,211,327.76	-4,069,057.04	-23,280,384.80
其中：基金申购款	17,787,787.95	3,261,506.25	21,049,294.20
基金赎回款	-36,999,115.71	-7,330,563.29	-44,329,679.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,018,580.92	7,349,316.91	40,367,897.83

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	486.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,747.07
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,233.50

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	12,116,026.08
股票投资收益——赎回差价收入	26,120,985.60
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	38,237,011.68

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	73,934,199.41
减：卖出股票成本总额	61,759,256.75
减：交易费用	58,916.58
买卖股票差价收入	12,116,026.08

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	184,329,679.00

减：现金支付赎回款总额	23,943,584.00
减：赎回股票成本总额	134,265,109.40
减：交易费用	-
赎回差价收入	26,120,985.60

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	3.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	51,344.37
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	51,347.81

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	108,952.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	57,599.91
减：应计利息总额	3.54
减：交易费用	4.49
买卖债券差价收入	51,344.37

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	155,469.61
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	155,469.61
----	------------

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	14,812,454.29
——股票投资	14,812,454.29
——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	14,812,454.29

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	64,592.01
合计	64,592.01

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	22,512.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	2.25
其他	59,507.37
合计	141,529.77

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
平安银行股份有限公司	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、证券经纪商

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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	133,748,151.08	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	108,952.31	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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
广发证券	13,375.78	100.00%	-	-

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
当期发生的基金应支付的管理费	248,227.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	78,404.89
应支付基金管理人的净管理费	169,823.08

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026年1月1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	49,645.54

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期存款	73,059.53	486.43
广发证券-其他存款	1,115,367.63	1,747.07

注：1.本基金的其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

2.除其他存款外，本基金的上述银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	438	6,902.88

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	129	1,442.22	2,269.11	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	25	947.00	871.75	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	18	602.82	610.74	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	61	1,334.68	1,556.72	-

603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	44	693.44	2,055.24	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	64	1,132.80	5,396.48	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	38	1,557.24	11,711.22	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	542	9,495.84	19,468.64	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	7,235	128,638.30	221,752.75	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	951	21,568.68	40,094.16	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	14,215	122,533.30	816,225.30	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	34	3,134.12	15,747.10	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	609	50,583.54	77,008.05	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	886	101,252.08	599,768.84	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	599	62,691.34	460,565.11	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	24	1,965.12	38,023.92	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	316	2,025.56	7,625.08	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	77	2,023.56	13,250.93	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通	55.95	57.10	48	2,685.60	2,740.80	-

				受限						
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	371	3,513.37	26,021.94	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	144	2,833.92	20,374.56	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.09	-
118070	南芯转债	2026-06-22	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	60	6,000.00	6,000.23	-
118071	华峰转债	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.12	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	1,395	765,664.85	1,160,640.00	-
688260	昀冢科技	2026-06-26	重大事项停牌	144.00	2026-07-01	132.00	275	38,508.25	39,600.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为股票型基金，理论上其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。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%(2025 年 12 月 31 日：0.02%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元		
短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	0.00	0.00
----	------	------

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	22,000.44	34,000.45
未评级	0.00	0.00
合计	22,000.44	34,000.45

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	1,188,427.16	-	-	-	1,188,427.16
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	22,000.44	90,741,221.28	90,763,221.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	1,188,427.16	-	22,000.44	90,801,713.91	92,012,141.51
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	-	-	-	34,902.53	34,902.53
应付托管费	-	-	-	6,980.49	6,980.49
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	-	-	-	312,360.66	312,360.66
负债总计	-	-	-	354,243.68	354,243.68
利率敏感度缺口	1,188,427.16	-	22,000.44	90,447,470.23	91,657,897.83
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	1,714,010.59	-	-	-	1,714,010.59
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	34,000.45	156,666,769.42	156,700,769.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,714,010.59	-	34,000.45	156,666,769.42	158,414,780.46
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	-	-	-	28,349.93	28,349.93
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	81,479.24	81,479.24
应付托管费	-	-	-	16,295.86	16,295.86
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	-	-	-	234,078.42	234,078.42
负债总计	-	-	-	360,203.45	360,203.45
利率敏感度缺口	1,714,010.59	-	34,000.45	156,306,565.97	158,054,577.01

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	90,741,221.28	99.00	156,666,769.42	99.12

交易性金融资产—债券投资	22,000.44	0.02	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	90,763,221.72	99.02	156,666,769.42	99.12

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%	4,584,850.57	8,322,007.29
	2.业绩比较基准下降 5%	-4,584,850.57	-8,322,007.29

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	87,147,732.84
第二层次	1,232,350.44
第三层次	2,383,138.44
合计	90,763,221.72

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业务等情况，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	90,741,221.28	98.62
	其中：股票	90,741,221.28	98.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,000.44	0.02
	其中：债券	22,000.44	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,188,427.16	1.29
8	其他各项资产	60,492.63	0.07
9	合计	92,012,141.51	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

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	61,973,495.51	67.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,020,057.25	14.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,036,750.28	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	40,992.12	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	76,071,295.16	82.99

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	407,264.00	0.44
C	制造业	12,005,219.49	13.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,110.00	0.01
E	建筑业	320,201.00	0.35

F	批发和零售业	514,161.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	89,271.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	345,632.20	0.38
J	金融业	479,332.00	0.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	146,400.00	0.16
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	352,335.43	0.38
S	综合	-	-
	合计	14,669,926.12	16.01

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	688256	寒武纪	3,334	5,319,563.70	5.80
2	688041	海光信息	12,055	4,463,966.50	4.87
3	688012	中微公司	5,212	2,441,822.00	2.66
4	688795	摩尔线程	2,833	1,994,774.87	2.18
5	688008	澜起科技	5,867	1,818,183.30	1.98
6	688981	中芯国际	10,940	1,737,490.80	1.90
7	688802	沐曦股份	1,919	1,553,921.11	1.70
8	688498	源杰科技	768	1,448,448.00	1.58
9	688525	佰维存储	2,720	1,345,665.60	1.47
10	688521	芯原股份	3,276	1,215,854.64	1.33
11	688072	拓荆科技	1,395	1,160,640.00	1.27
12	688200	华峰测控	1,838	965,133.80	1.05
13	688146	中船特气	2,623	918,023.77	1.00
14	688082	盛美上海	2,111	911,952.00	0.99
15	688766	普冉股份	1,122	860,125.20	0.94
16	688702	盛科通信	2,158	841,598.42	0.92
17	688361	中科飞测	1,692	727,560.00	0.79

18	688409	富创精密	2,374	727,037.50	0.79
19	688347	华虹宏力	2,131	716,655.30	0.78
20	688627	精智达	983	702,845.00	0.77
21	688172	燕东微	8,006	669,781.96	0.73
22	688120	华海清科	2,002	645,004.36	0.70
23	688629	华丰科技	3,396	636,783.96	0.69
24	688126	沪硅产业	15,577	621,366.53	0.68
25	688396	华润微	6,151	600,030.05	0.65
26	688183	生益电子	4,473	592,225.20	0.65
27	688506	百利天恒	1,864	548,071.92	0.60
28	688111	金山办公	2,500	532,625.00	0.58
29	688037	芯源微	1,212	532,128.60	0.58
30	688147	微导纳米	3,279	530,804.52	0.58
31	688048	长光华芯	1,037	520,574.00	0.57
32	688187	时代电气	7,390	507,397.40	0.55
33	688469	芯联集成	47,815	507,317.15	0.55
34	688313	仕佳光子	2,708	500,032.20	0.55
35	688300	联瑞新材	2,031	496,376.40	0.54
36	688249	晶合集成	8,395	495,556.85	0.54
37	688668	鼎通科技	1,290	481,557.00	0.53
38	688519	南亚新材	1,238	470,489.52	0.51
39	688110	东芯股份	2,159	439,788.30	0.48
40	688002	睿创微纳	2,738	423,541.22	0.46
41	688019	安集科技	1,191	404,296.86	0.44
42	688141	杰华特	2,578	395,723.00	0.43
43	688502	茂莱光学	560	388,416.00	0.42
44	688017	绿的谐波	902	376,909.72	0.41
45	688676	金盘科技	4,341	367,422.24	0.40
46	688234	天岳先进	2,085	361,768.35	0.39
47	688630	芯碁微装	642	352,708.38	0.38
48	688268	华特气体	1,302	348,285.00	0.38
49	688388	嘉元科技	7,818	343,992.00	0.38
50	688559	海目星	4,013	336,770.96	0.37
51	688025	杰普特	708	332,760.00	0.36
52	688167	炬光科技	934	330,832.14	0.36
53	688205	德科立	1,587	330,397.53	0.36
54	688362	甬矽电子	3,345	322,458.00	0.35
55	688220	翱捷科技	2,561	318,383.52	0.35
56	688343	云天励飞	3,834	313,084.44	0.34
57	688411	海博思创	1,016	295,859.20	0.32
58	688400	凌云光	4,410	291,942.00	0.32
59	688195	腾景科技	1,503	289,447.74	0.32
60	688322	奥比中光	2,215	289,168.25	0.32
61	688233	神工股份	1,340	287,322.80	0.31

62	688432	有研硅	7,046	281,628.62	0.31
63	688615	合合信息	2,451	277,208.10	0.30
64	688387	信科移动	13,836	274,506.24	0.30
65	688271	联影医疗	2,683	271,600.09	0.30
66	688318	财富趋势	3,808	271,548.48	0.30
67	688390	固德威	2,494	270,623.94	0.30
68	688800	瑞可达	2,784	267,180.48	0.29
69	688006	杭可科技	7,306	267,034.30	0.29
70	688375	国博电子	2,523	263,148.90	0.29
71	688578	艾力斯	2,359	257,602.80	0.28
72	688449	联芸科技	2,902	250,471.62	0.27
73	688652	京仪装备	1,244	249,011.48	0.27
74	688359	三孚新科	1,215	241,104.60	0.26
75	688052	纳芯微	832	239,873.92	0.26
76	688336	三生国健	4,512	239,587.20	0.26
77	688001	华兴源创	2,740	234,818.00	0.26
78	688368	晶丰明源	1,078	233,408.56	0.25
79	688392	骄成超声	1,024	232,632.32	0.25
80	688059	华锐精密	1,159	231,463.89	0.25
81	688127	蓝特光学	2,352	229,555.20	0.25
82	688372	伟测科技	1,220	226,920.00	0.25
83	688027	国盾量子	443	223,276.43	0.24
84	688603	天承科技	1,063	221,050.85	0.24
85	688223	晶科能源	45,881	217,934.75	0.24
86	688777	中控技术	1,822	214,085.00	0.23
87	688331	荣昌生物	1,640	213,626.40	0.23
88	688663	新风光	2,348	207,704.08	0.23
89	688536	思瑞浦	569	207,167.21	0.23
90	688231	隆达股份	5,530	203,116.90	0.22
91	688733	壹石通	4,907	202,904.45	0.22
92	688503	聚和材料	1,525	202,367.50	0.22
93	688099	晶晨股份	1,960	201,684.00	0.22
94	688386	泛亚微透	2,223	199,714.32	0.22
95	688661	和林微纳	1,255	199,519.90	0.22
96	688403	汇成股份	4,983	197,825.10	0.22
97	688235	百济神州	774	197,068.14	0.22
98	688257	新锐股份	1,915	195,138.50	0.21
99	688248	南网科技	2,772	191,766.96	0.21
100	688433	华曙高科	2,232	191,059.20	0.21
101	688692	达梦数据	782	191,034.78	0.21
102	688122	西部超导	3,039	190,879.59	0.21
103	688047	龙芯中科	1,221	188,852.07	0.21
104	688499	利元亨	3,568	187,498.40	0.20
105	688003	天准科技	1,468	186,876.40	0.20

106	688123	聚辰股份	853	181,347.80	0.20
107	688531	日联科技	1,019	181,218.96	0.20
108	688617	惠泰医疗	998	181,196.88	0.20
109	688036	传音控股	3,029	178,559.55	0.19
110	688090	瑞松科技	1,664	177,132.80	0.19
111	688711	宏微科技	3,891	176,845.95	0.19
112	688535	华海诚科	945	176,715.00	0.19
113	688378	奥来德	2,787	172,794.00	0.19
114	688686	奥普特	999	168,221.61	0.18
115	688472	阿特斯	15,484	167,536.88	0.18
116	688719	爱科赛博	2,173	167,321.00	0.18
117	688301	奕瑞科技	1,349	167,276.00	0.18
118	688281	华秦科技	3,270	164,252.10	0.18
119	688297	中无人机	3,946	163,956.30	0.18
120	688584	上海合晶	4,551	163,608.45	0.18
121	688155	先惠技术	2,002	161,941.78	0.18
122	688416	恒烁股份	1,152	161,280.00	0.18
123	688585	上纬新材	971	160,991.80	0.18
124	688097	博众精工	2,509	158,192.45	0.17
125	688518	联赢激光	4,983	153,974.70	0.17
126	688659	元琛科技	14,692	153,384.48	0.17
127	688510	航亚科技	6,413	153,142.44	0.17
128	688279	峰岬科技	682	153,068.08	0.17
129	688308	欧科亿	838	152,356.78	0.17
130	688258	卓易信息	1,285	152,323.90	0.17
131	688028	沃尔德	948	147,764.76	0.16
132	688598	金博股份	2,937	145,234.65	0.16
133	688778	厦钨新能	2,667	145,084.80	0.16
134	688625	呈和科技	1,716	144,847.56	0.16
135	688188	柏楚电子	1,354	144,471.80	0.16
136	688549	中巨芯	3,913	144,037.53	0.16
137	688376	美埃科技	1,231	143,165.30	0.16
138	688385	复旦微电	1,987	141,653.23	0.15
139	688275	万润新能	1,074	136,988.70	0.15
140	688352	颀中科技	5,633	136,205.94	0.15
141	688548	广钢气体	2,588	134,834.80	0.15
142	688596	正帆科技	1,702	134,560.12	0.15
143	688775	影石创新	922	127,835.30	0.14
144	688020	方邦股份	504	125,798.40	0.14
145	688600	皖仪科技	3,766	125,332.48	0.14
146	688222	成都先导	3,873	124,362.03	0.14
147	688303	大全能源	7,103	123,805.29	0.14
148	688383	新益昌	639	120,157.56	0.13
149	688401	路维光电	1,237	118,727.26	0.13

150	688005	容百科技	3,836	117,381.60	0.13
151	688353	华盛锂电	1,007	116,882.49	0.13
152	688379	华光新材	1,374	115,457.22	0.13
153	688667	菱电电控	862	115,206.30	0.13
154	688035	德邦科技	1,253	115,025.40	0.13
155	688239	航宇科技	1,900	113,677.00	0.12
156	688150	莱特光电	1,650	113,223.00	0.12
157	688143	长盈通	640	112,563.20	0.12
158	688515	裕太微	449	111,693.24	0.12
159	688295	中复神鹰	1,831	110,848.74	0.12
160	688106	金宏气体	2,672	110,834.56	0.12
161	688700	东威科技	1,238	110,677.20	0.12
162	688131	皓元医药	1,160	109,736.00	0.12
163	688691	灿芯股份	913	105,844.09	0.12
164	688545	兴福电子	793	105,516.58	0.12
165	688312	燕麦科技	1,251	105,071.49	0.11
166	688226	威腾电气	2,441	104,548.03	0.11
167	688520	神州细胞	2,986	102,151.06	0.11
168	688158	优刻得	2,740	100,722.40	0.11
169	688484	南芯科技	1,760	99,422.40	0.11
170	688662	富信科技	586	98,448.00	0.11
171	688356	键凯科技	1,192	91,879.36	0.10
172	688170	德龙激光	947	90,921.47	0.10
173	688551	科威尔	1,280	89,945.60	0.10
174	688206	概伦电子	2,027	89,937.99	0.10
175	688456	有研粉材	634	88,506.40	0.10
176	688160	步科股份	802	87,233.54	0.10
177	688208	道通科技	3,417	86,074.23	0.09
178	688088	虹软科技	2,413	85,782.15	0.09
179	688100	威胜信息	2,790	85,346.10	0.09
180	688508	芯朋微	917	85,244.32	0.09
181	688180	君实生物	2,517	85,124.94	0.09
182	688478	晶升股份	952	84,299.60	0.09
183	688628	优利德	850	84,099.00	0.09
184	688018	乐鑫科技	654	83,659.68	0.09
185	688179	阿拉丁	3,019	83,656.49	0.09
186	688328	深科达	865	82,780.50	0.09
187	688419	耐科装备	1,052	82,739.80	0.09
188	688135	利扬芯片	1,963	82,603.04	0.09
189	688728	格科微	3,911	82,287.44	0.09
190	688475	萤石网络	2,972	81,284.20	0.09
191	688107	安路科技	1,780	81,168.00	0.09
192	688612	威迈斯	2,730	80,780.70	0.09
193	688717	艾罗能源	965	79,680.05	0.09

194	688190	云路股份	873	79,189.83	0.09
195	688698	伟创电气	1,496	78,465.20	0.09
196	688095	福昕软件	1,308	77,734.44	0.08
197	688690	纳微科技	1,751	77,219.10	0.08
198	688428	诺诚健华	2,708	77,096.76	0.08
199	688202	美迪西	953	76,916.63	0.08
200	688655	迅捷兴	1,429	76,537.24	0.08
201	688789	宏华数科	1,432	76,139.44	0.08
202	688332	中科蓝讯	465	73,237.50	0.08
203	688102	斯瑞新材	1,545	72,893.10	0.08
204	688321	微芯生物	2,751	72,433.83	0.08
205	688337	普源精电	961	72,007.73	0.08
206	688561	奇安信	3,000	71,940.00	0.08
207	688608	恒玄科技	427	71,390.13	0.08
208	688349	三一重能	4,608	69,949.44	0.08
209	688063	派能科技	1,301	69,304.27	0.08
210	688278	特宝生物	1,268	68,979.20	0.08
211	688621	阳光诺和	1,256	68,966.96	0.08
212	688112	鼎阳科技	937	68,832.02	0.08
213	688798	艾为电子	933	68,407.56	0.07
214	688720	艾森股份	669	67,569.00	0.07
215	688327	云从科技	5,414	67,458.44	0.07
216	688678	福立旺	2,776	67,095.92	0.07
217	688779	五矿新能	8,217	66,639.87	0.07
218	688238	和元生物	11,993	65,002.06	0.07
219	688611	杭州柯林	906	64,733.70	0.07
220	688563	航材股份	1,263	64,703.49	0.07
221	688582	芯动联科	985	64,025.00	0.07
222	688410	山外山	4,458	64,016.88	0.07
223	688192	迪哲医药	1,597	63,768.21	0.07
224	688443	智翔金泰	2,721	63,263.25	0.07
225	688306	均普智能	6,113	61,741.30	0.07
226	688665	四方光电	936	61,495.20	0.07
227	688262	国芯科技	1,416	61,213.68	0.07
228	688677	海泰新光	600	60,678.00	0.07
229	688593	新相微	1,541	59,975.72	0.07
230	688056	莱伯泰科	913	58,934.15	0.06
231	688799	华纳药厂	1,284	57,613.08	0.06
232	688191	智洋创新	1,610	57,477.00	0.06
233	688486	龙迅股份	895	56,904.10	0.06
234	688198	佰仁医疗	637	56,845.88	0.06
235	688115	思林杰	689	56,670.25	0.06
236	688319	欧林生物	1,276	56,118.48	0.06
237	688550	瑞联新材	964	55,767.40	0.06

238	688261	东微半导	525	55,088.25	0.06
239	688148	芳源股份	6,225	53,410.50	0.06
240	688787	海天瑞声	394	52,973.30	0.06
241	688685	迈信林	957	52,539.30	0.06
242	688568	中科星图	1,257	52,127.79	0.06
243	688737	中自科技	2,704	51,754.56	0.06
244	688277	天智航	2,984	51,026.40	0.06
245	688073	毕得医药	945	50,859.90	0.06
246	688316	青云科技	938	50,652.00	0.06
247	688708	佳驰科技	996	50,596.80	0.06
248	688699	明微电子	600	49,170.00	0.05
249	688581	安杰思	945	48,865.95	0.05
250	688185	康希诺	947	48,287.53	0.05
251	688556	高测股份	3,508	46,586.24	0.05
252	688010	福光股份	937	45,566.31	0.05
253	688227	品高股份	443	45,491.67	0.05
254	688648	中邮科技	1,232	45,029.60	0.05
255	688166	博瑞医药	1,271	44,497.71	0.05
256	688365	光云科技	2,786	43,935.22	0.05
257	688252	天德钰	1,797	43,128.00	0.05
258	688512	慧智微	2,657	42,432.29	0.05
259	688068	热景生物	489	42,347.40	0.05
260	688305	科德数控	636	41,511.72	0.05
261	688653	康希通信	2,387	41,486.06	0.05
262	688480	赛恩斯	468	40,992.12	0.04
263	688260	昀冢科技	275	39,600.00	0.04
264	688513	苑东生物	896	39,388.16	0.04
265	688707	振华新材	3,035	38,999.75	0.04
266	688393	安必平	2,184	38,831.52	0.04
267	688293	奥浦迈	925	38,563.25	0.04
268	688029	南微医学	529	37,982.20	0.04
269	688776	国光电气	600	36,804.00	0.04
270	688232	新点软件	2,065	36,715.70	0.04
271	688709	成都华微	945	35,995.05	0.04
272	688023	安恒信息	974	35,765.28	0.04
273	688209	英集芯	1,214	35,303.12	0.04
274	688039	当虹科技	945	35,267.40	0.04
275	688560	明冠新材	2,950	34,957.50	0.04
276	688577	浙海德曼	732	33,547.56	0.04
277	688391	钜泉科技	932	33,430.84	0.04
278	688182	灿勤科技	775	33,379.25	0.04
279	688558	国盛智科	999	32,827.14	0.04
280	688139	海尔生物	1,241	32,787.22	0.04
281	688087	英科再生	974	32,551.08	0.04

282	688523	航天环宇	617	32,330.80	0.04
283	688772	珠海冠宇	1,631	32,016.53	0.03
284	688229	博睿数据	409	31,370.30	0.03
285	688283	坤恒顺维	945	31,288.95	0.03
286	688697	纽威数控	2,295	31,189.05	0.03
287	688009	中国通号	6,549	31,173.24	0.03
288	688651	盛邦安全	954	30,737.88	0.03
289	688081	兴图新科	720	29,433.60	0.03
290	688579	地纬智能	3,748	28,447.32	0.03
291	688543	国科军工	720	28,404.00	0.03
292	688516	奥特维	444	25,481.16	0.03
293	688726	拉普拉斯	471	24,892.35	0.03
294	688658	悦康药业	1,923	24,729.78	0.03
295	688050	爱博医疗	600	21,870.00	0.02
296	688636	智明达	600	21,738.00	0.02
297	688357	建龙微纳	691	20,363.77	0.02
298	688369	致远互联	943	19,812.43	0.02
299	688058	宝兰德	928	19,413.76	0.02
300	688339	亿华通	987	18,456.90	0.02
301	688207	格灵深瞳	915	18,391.50	0.02
302	688345	博力威	302	17,540.16	0.02
303	688501	青达环保	840	16,128.00	0.02
304	688687	凯因科技	982	16,016.42	0.02
305	688567	孚能科技	1,502	15,771.00	0.02
306	688186	广大特材	986	14,937.90	0.02
307	688330	宏力达	439	14,851.37	0.02
308	688590	新致软件	960	11,932.80	0.01
309	688588	凌志软件	1,264	11,489.76	0.01
310	688639	华恒生物	215	3,470.10	0.00

7.3.2 期末积极投资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	688783	西安奕材	14,215	816,225.30	0.89
2	002384	东山精密	900	236,115.00	0.26
3	603678	火炬电子	2,800	232,400.00	0.25
4	688759	必贝特	7,235	221,752.75	0.24
5	301235	华康洁净	2,900	217,529.00	0.24
6	301308	江波龙	300	211,140.00	0.23
7	300726	宏达电子	2,400	202,968.00	0.22
8	002487	大金重工	3,500	202,895.00	0.22
9	002364	中恒电气	3,600	193,680.00	0.21

10	001309	德明利	200	188,580.00	0.21
11	605060	联德股份	3,200	181,568.00	0.20
12	000021	深科技	2,800	179,956.00	0.20
13	300693	盛弘股份	3,500	170,625.00	0.19
14	603950	长源东谷	2,000	168,860.00	0.18
15	301205	联特科技	500	167,050.00	0.18
16	300547	川环科技	4,900	163,611.00	0.18
17	603986	兆易创新	200	163,000.00	0.18
18	605117	德业股份	1,500	159,270.00	0.17
19	605100	华丰股份	3,940	159,254.80	0.17
20	601166	兴业银行	9,500	157,320.00	0.17
21	002636	金安国纪	1,300	155,961.00	0.17
22	002735	王子新材	9,500	154,185.00	0.17
23	300870	欧陆通	440	152,103.60	0.17
24	002885	京泉华	3,700	151,182.00	0.16
25	603308	应流股份	2,500	151,000.00	0.16
26	000534	万泽股份	5,500	150,480.00	0.16
27	300475	香农芯创	500	150,000.00	0.16
28	000880	潍柴重机	6,500	149,565.00	0.16
29	300223	北京君正	600	149,340.00	0.16
30	000338	潍柴动力	5,400	147,150.00	0.16
31	300990	同飞股份	1,400	147,098.00	0.16
32	300816	艾可蓝	2,000	146,400.00	0.16
33	605589	圣泉集团	2,300	146,211.00	0.16
34	600096	云天化	4,700	142,880.00	0.16
35	002536	飞龙股份	3,000	141,540.00	0.15
36	601126	四方股份	2,200	139,040.00	0.15
37	300548	长芯博创	500	139,000.00	0.15
38	600183	生益科技	800	138,720.00	0.15
39	002916	深南电路	300	137,370.00	0.15
40	002353	杰瑞股份	900	137,250.00	0.15
41	601208	东材科技	1,900	134,501.00	0.15
42	603083	剑桥科技	500	127,435.00	0.14
43	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.14
44	300593	新雷能	4,200	126,252.00	0.14
45	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.14
46	600585	海螺水泥	7,300	123,735.00	0.13
47	000404	长虹华意	15,000	117,900.00	0.13
48	601877	正泰电器	4,600	115,322.00	0.13
49	300491	通合科技	3,000	114,570.00	0.12
50	300499	高澜股份	2,956	114,397.20	0.12
51	600938	中国海油	4,200	114,030.00	0.12
52	603186	华正新材	500	112,650.00	0.12
53	601225	陕西煤业	5,500	111,925.00	0.12

54	002922	伊戈尔	3,400	111,520.00	0.12
55	603558	健盛集团	9,900	109,791.00	0.12
56	601801	皖新传媒	22,200	109,446.00	0.12
57	002697	红旗连锁	26,000	108,160.00	0.12
58	601577	长沙银行	12,400	108,004.00	0.12
59	601818	光大银行	37,200	107,508.00	0.12
60	600036	招商银行	3,000	106,500.00	0.12
61	002580	圣阳股份	5,200	104,832.00	0.11
62	002706	良信股份	9,600	104,736.00	0.11
63	600970	中材国际	14,400	102,672.00	0.11
64	601001	晋控煤业	5,900	102,601.00	0.11
65	301171	易点天下	2,910	98,823.60	0.11
66	601339	百隆东方	14,500	98,165.00	0.11
67	603191	望变电气	6,200	97,898.00	0.11
68	003026	中晶科技	2,100	95,781.00	0.10
69	600552	凯盛科技	2,900	94,482.00	0.10
70	002091	江苏国泰	13,000	93,990.00	0.10
71	002315	焦点科技	4,020	93,585.60	0.10
72	600707	彩虹股份	5,400	91,206.00	0.10
73	603936	博敏电子	3,400	90,814.00	0.10
74	002533	金杯电工	8,400	89,628.00	0.10
75	603565	中谷物流	9,100	89,271.00	0.10
76	600367	红星发展	1,400	88,102.00	0.10
77	002733	雄韬股份	2,800	86,744.00	0.09
78	601900	南方传媒	7,900	85,794.00	0.09
79	002335	科华数据	2,000	84,900.00	0.09
80	300243	瑞丰高材	3,900	84,786.00	0.09
81	300394	天孚通信	280	84,750.40	0.09
82	301086	鸿富瀚	400	83,712.00	0.09
83	605377	华旺科技	9,000	83,700.00	0.09
84	603368	柳药集团	5,700	83,619.00	0.09
85	002851	麦格米特	500	83,590.00	0.09
86	301486	致尚科技	400	83,328.00	0.09
87	002741	光华科技	2,300	82,202.00	0.09
88	600380	健康元	8,700	81,954.00	0.09
89	000719	中原传媒	6,901	78,878.43	0.09
90	601958	金钼股份	2,800	78,708.00	0.09
91	600710	苏美达	8,200	78,392.00	0.09
92	600757	长江传媒	10,700	78,217.00	0.09
93	301373	凌玮科技	500	77,750.00	0.08
94	603681	永冠新材	3,400	77,690.00	0.08
95	688790	昂瑞微	609	77,008.05	0.08
96	300454	深信服	800	76,960.00	0.08
97	300576	容大感光	1,500	76,830.00	0.08

98	002957	科瑞技术	1,400	76,776.00	0.08
99	300360	炬华科技	6,500	76,375.00	0.08
100	603861	白云电器	5,900	76,169.00	0.08
101	002203	海亮股份	3,300	75,405.00	0.08
102	301630	同宇新材	300	75,048.00	0.08
103	300442	润泽科技	900	74,763.00	0.08
104	301526	国际复材	1,600	74,672.00	0.08
105	003036	泰坦股份	800	73,992.00	0.08
106	301188	力诺药包	1,100	73,590.00	0.08
107	002270	华明装备	3,900	73,515.00	0.08
108	605006	山东玻纤	3,400	71,706.00	0.08
109	002975	博杰股份	500	71,000.00	0.08
110	002378	章源钨业	2,100	70,308.00	0.08
111	600869	远东股份	2,100	70,287.00	0.08
112	605198	安德利	1,100	69,696.00	0.08
113	300400	劲拓股份	1,800	67,770.00	0.07
114	300395	菲利华	500	66,865.00	0.07
115	603773	沃格光电	400	65,188.00	0.07
116	301338	凯格精机	400	65,156.00	0.07
117	002112	三变科技	3,700	60,643.00	0.07
118	301511	德福科技	400	57,540.00	0.06
119	301397	溯联股份	1,600	51,776.00	0.06
120	688781	视涯科技	951	40,094.16	0.04
121	688808	联讯仪器	24	38,023.92	0.04
122	688818	电科蓝天	371	26,021.94	0.03
123	002518	科士达	400	21,436.00	0.02
124	688820	盛合晶微	144	20,374.56	0.02
125	688712	北芯生命	542	19,468.64	0.02
126	688785	恒运昌	34	15,747.10	0.02
127	688813	泰金新能	77	13,250.93	0.01
128	688635	长进光子	38	11,711.22	0.01
129	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.01
130	688811	有研复材	316	7,625.08	0.01
131	603459	红板科技	64	5,396.48	0.01
132	688816	易思维	48	2,740.80	0.00
133	601112	振石股份	129	2,269.11	0.00
134	603435	嘉德利	44	2,055.24	0.00
135	603352	至信股份	61	1,556.72	0.00
136	603881	数据港	60	1,500.00	0.00
137	603284	林平发展	25	871.75	0.00
138	603293	埃泰克	18	610.74	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	688795	摩尔线程	1,809,338.29	1.14
2	688802	沐曦股份	1,518,431.06	0.96
3	688041	海光信息	760,641.08	0.48
4	688187	时代电气	616,430.90	0.39
5	000534	万泽股份	614,128.00	0.39
6	688012	中微公司	610,835.52	0.39
7	301235	华康洁净	584,269.00	0.37
8	688702	盛科通信	545,284.24	0.34
9	688326	经纬恒润	532,840.65	0.34
10	688082	盛美上海	512,714.22	0.32
11	002487	大金重工	485,799.00	0.31
12	688396	华润微	477,575.30	0.30
13	688072	拓荆科技	476,016.00	0.30
14	688036	传音控股	470,165.26	0.30
15	688521	芯原股份	456,694.30	0.29
16	688506	百利天恒	454,076.10	0.29
17	000880	潍柴重机	426,647.00	0.27
18	688775	影石创新	415,367.55	0.26
19	688205	德科立	408,617.47	0.26
20	300443	金雷股份	398,287.00	0.25

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	2,362,559.03	1.49
2	688041	海光信息	1,475,342.70	0.93
3	688256	寒武纪	1,398,067.35	0.88
4	688027	国盾量子	1,120,354.90	0.71
5	688375	国博电子	779,121.59	0.49
6	688031	星环科技	743,596.54	0.47
7	688568	中科星图	706,685.52	0.45
8	688326	经纬恒润	665,404.51	0.42
9	688502	茂莱光学	652,704.76	0.41
10	301171	易点天下	625,010.00	0.40
11	002384	东山精密	609,387.00	0.39
12	688099	晶晨股份	603,852.98	0.38
13	688981	中芯国际	586,301.43	0.37
14	002364	中恒电气	576,405.00	0.36

15	301235	华康洁净	566,004.00	0.36
16	688167	炬光科技	559,899.76	0.35
17	002922	伊戈尔	548,455.00	0.35
18	000977	浪潮信息	545,410.00	0.35
19	300870	欧陆通	538,218.00	0.34
20	688519	南亚新材	536,819.40	0.34

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	60,145,071.72
卖出股票收入（成交）总额	73,934,199.41

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	22,000.44	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,000.44	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	118071	华峰转债	80	8,000.12	0.01
2	111025	圣泉转债	80	8,000.09	0.01
3	118070	南芯转债	60	6,000.23	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-

9	合计	60,492.63
---	----	-----------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资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	688795	摩尔线程	599,768.84	0.65	新股流通受限
2	688802	沐曦股份	460,565.11	0.50	新股流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五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	688783	西安奕材	816,225.30	0.89	新股流通受限
2	688759	必贝特	221,752.75	0.24	新股流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,891	27,123.22	1,721,600.00	3.36%	49,568,400.00	96.64%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%
------------------	------	---------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 8 月 27 日）基金份额总额	675,290,000.00
本报告期期初基金份额总额	147,290,000.00
本报告期基金总申购份额	44,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	140,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	51,290,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

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，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

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	
广发证券	6	133,748,151.08	100.00%	13,375.78	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广发证券股份有限公司。广发证券股份有限公司系本基金管理人的股东。

c）本报告期本基金的平均佣金费率为：股票 0.01000%、债券 0.00010%。

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
广发证券	108,952.31	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、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	上海证券报	2026-01-22
3	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报	2026-03-31
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-04-22
6	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
7	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
8	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	上海证券报、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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达上证科创板综合增强策略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