

易方达中证 A50 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：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	16
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39
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	39
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	39
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	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39

7.12 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	41
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	42
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	42
10.8 其他重大事件	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证 A50 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证 A50 增强策略 ETF
场内简称	A50 增、中证 A50 增强 ETF 易方达
基金主代码	512030
交易代码	512030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 7 月 28 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	43,240,000.00 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 8 月 13 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，以中证 A50 指数作为标的指数，通过深入的基本面研究，精选具备核心竞争优势的公司，构建和优化投资组合，在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 6.5%的基础上追求超越业绩比较基准的投资回报。 股票（含存托凭证）投资方面，本基金根据中证 A50 指数成份股及权重，考虑本基金资产规模及流动性等因素，拟定以指数权重为基础的投资组合初始方案；在此基础上通过对上市公司及行业基本面的深入研究，精选具备核心竞争优势的公司对组合方案进行优化，据此调整部分成份股的权重，并可适当投资非指数成份股，形成本基金的股票投资组合配置方案并相应进行调整。 此外，为更好地实现投资目标，本基金将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。同时，本基金可投资股指期货、国债期货和股票期权。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	中证 A50 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	张姗
	联系电话	020-85102688	400-61-95555
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	400-61-95555
传真		020-38798812	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		510627；510623；519031	518040
法定代表人		吴欣荣	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	1,398,209.05
本期利润	779,583.59
加权平均基金份额本期利润	0.0182
本期加权平均净值利润率	1.62%
本期基金份额净值增长率	1.92%
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	5,632,616.06
期末可供分配基金份额利润	0.1303

期末基金资产净值	48,872,616.06
期末基金份额净值	1.1303
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	13.03%

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

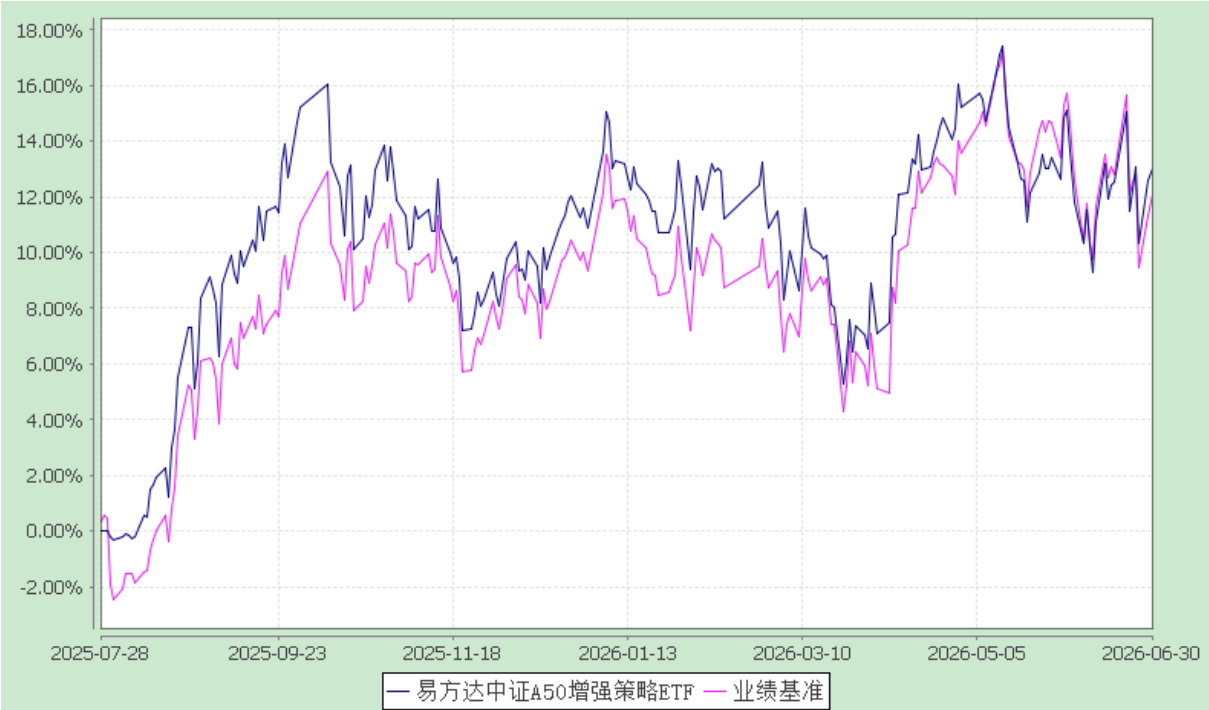
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.11%	1.18%	6.54%	1.25%	-0.43%	-0.07%
过去六个月	1.92%	1.13%	2.51%	1.15%	-0.59%	-0.02%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	13.03%	1.06%	12.09%	1.06%	0.94%	0.00%

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

易方达中证 A50 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 7 月 28 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：1.本基金合同于 2025 年 7 月 28 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		
郭杰	本基金的基金经理，易方达国企改革混合、易方达 ESG 责任投资股票、易方达核心优势股票、易方达商业	2025-07-28	-	18 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行业研究员、基金经理助理、研究部副总经

	模式优选混合、易方达长期价值混合（自 2021 年 09 月 23 日至 2026 年 03 月 24 日）、易方达竞争优势企业混合的基金经理，权益投资管理部副总经理				理，易方达资源行业股票、易方达科汇灵活配置混合、易方达改革红利混合、易方达新丝路混合的基金经理。
聂启文	本基金的基金经理助理，易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达深证 50ETF 联接发起式、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证全指建筑材料 ETF、易方达中证物联网主题 ETF 联接发起式、易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证国有企业改革指数（LOF）、易方达中证现代农业主题 ETF、易方达上证综合 ETF、易方达恒生 A 股电网设备 ETF、易方达中证全指电力公用事业 ETF 的基金经理，易方达中证 2000ETF、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式、易方达黄金股指数发起式、易方达恒生港股通新经济 ETF、易方达上证科创板 100ETF、易方达深证 50ETF、易方达中证全指食品 ETF、易方达中证畜牧养殖产业 ETF、易方达国证粮食产业 ETF、易方达中证全指可选消费指数发起式的基金经理助理	2025-08-23	-	4 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。
张湛	本基金的基金经理助理，易方达中证科技 50ETF、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万得生物科技指数（LOF）、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50ETF 联接、易方达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达中证全指证券公司 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF（QDII）、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接、易方达中证医疗 ETF 联接、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达黄金 ETF 联接、易方达黄金 ETF、易方达国证港股通科技 ETF 的基金经理，易方达中证港股通中	2025-08-23	-	17 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司数量化投资研究员、量化研究员、投资经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证全指证券公司 ETF、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证券公司指数（LOF）、易方达中证新能源 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证新能源 ETF 联接发起式的基金经理。

国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）、易方达上证科创板 100ETF（自 2023 年 12 月 02 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达中证港股通中国 100ETF 联接发起式、易方达上证 50 增强策略 ETF、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式（自 2024 年 08 月 31 日至 2026 年 01 月 05 日）、易方达创业板 ETF、易方达中证 A500ETF 联接、易方达中证 A500ETF 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

上半年，国内宏观经济整体仍处于偏弱运行状态，外部环境亦面临较多不确定因素。出口保持一定韧性，但传统产业需求恢复依然偏缓，居民收入预期和消费信心仍对消费形成约束，内需修复力度有限。政策继续发挥稳增长、稳预期作用，但尚未改变经济弱修复的总体特征。展望未来，我们认为经济大概率仍将维持低位运行，更多体现为部分领域的结构性改善，而非总量层面的全面复苏。在这样的宏观背景下，股票市场整体流动性仍较为充裕，但市场结构分化进一步加剧。AI、半导体等高景气方向持续受到资金关注，部分资产估值已反映较为乐观的长期预期；传统产业及消费相关资产则整体表现偏弱，市场预期仍处于相对低位。截至上半年末，沪深 300 指数收于 4979 点，上涨 7.55%。

本基金的投资目标是实现中长期稳健回报。我们始终认为，投资的本质并非在市场波动中寻找机会，而是在充满不确定性的环境下，对企业长期价值进行合理定价。优质的商业模式和清晰的竞争壁垒，是企业持续创造现金流和股东回报的基础；坚守能力圈、坚持安全边际，则是控制长期投资风险的重要前提。组合构建始终围绕这一框架展开，不因市场风格变化而偏离长期投资原则。

从长期看，我们完成投资目标的信心来自三方面。第一，A50 指数的成分股具备强大的马太效应，在商业竞争中强者恒强，确保了长期的稳定回报；第二，本基金的增强策略为优中选优，高质量和突出的竞争壁垒是核心优化指标，同时关注行业的景气波动：规避下行、布局底部；第三，风险控制是底线，核心是确保安全边际——规避泡沫、关注低估资产。报告期内，基金持仓结构稳定，适度控制与基准的偏离度，主要分布于食品饮料、电力设备、通信、电子、工程机械、有色金属、化工、生物医药等多个行业。

当市场多数资金持续降低消费板块配置比例时，我们依然保持了消费领域较高的配置比例。过去几年居民消费景气度低于预期，这一过程持续时间之长，确实超出了我们的判断，我们对消费复苏节奏的预期偏乐观，这是需要反思的地方。但与此同时，我们也看到，市场对部分优质消费企业的定价，已经由谨慎逐步演变为较为悲观的预期。我们始终认为，长期投资回报最终仍将来源于企业持续创造现金流的能力，而不是短期景气波动本身。如果未来消费需求能够由持续下行逐步转向企稳，即使只是恢复到更加稳定的发展状态，这类优质企业的长期价值也有望得到重新认识。因此，我们依然坚持既定的长期投资框架。当然，坚持并不意味着固守。我们始终持续跟踪企业商业模式、竞争格局和行业变化，对基本面风险保持动态评估，不断优化个股配置，努力提升组合长期回报的确定性。

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 1.1303 元，本报告期份额净值增长率为 1.92%，同期业绩比较基准收益率为 2.51%。年化跟踪误差 4.98%，在合同约定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济大概率仍将维持低位运行，消费修复仍可能是一个相对缓慢的过程，市场结构性分化也可能延续。但与此同时，一批长期竞争优势明确、自由现金流创造能力稳定的优质企业，其估值和市场预期已处于相对较低水平，为长期投资提供了更具吸引力的回报基础。我们不会试图预测市场风格何时切换，而会持续比较企业长期价值与当前价格之间的关系，在市场预期与企业长期价值出现明显偏离时，耐心寻找具有较高风险收益比的投资机会。

巴菲特曾指出，投资者长期能够获得的回报，最终取决于企业自身创造价值的能力。这一规律不会因为技术进步或产业变革而改变。产业趋势可以改变世界，但并不必然带来同等的投资回报；真正决定长期投资回报的，仍然是企业持续创造现金流的能力，以及投资者买入时所支付的价格。价格决定投资回报的起点，企业价值决定投资回报的终点。未来，我们仍将坚持以商业模式、竞争壁垒、资本回报和安全边际为核心，不追逐市场情绪，不依赖风格判断，以合理甚至偏低的价格投资能够长期创造价值的优秀企业。我们相信，时间不会改变企业价值，却终将体现企业价值；时间也终将成为长期投资者最重要的伙伴。

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

自 2026 年 3 月 17 日至 2026 年 5 月 11 日，本基金均存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证 A50 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	3,201,344.88	3,970,442.02
结算备付金		62,894.91	91,473.35
存出保证金		10,781.96	68,639.00
交易性金融资产	6.4.7.2	45,725,057.70	47,549,775.62
其中：股票投资		45,725,057.70	47,549,775.62
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		454,822.26	267,624.87
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		49,454,901.71	51,947,954.86
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		441,119.42	533,732.41
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		32,582.08	35,321.23
应付托管费		4,072.75	4,415.16
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	104,511.40	94,373.60
负债合计		582,285.65	667,842.40
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	43,240,000.00	46,240,000.00
未分配利润	6.4.7.8	5,632,616.06	5,040,112.46
净资产合计		48,872,616.06	51,280,112.46
负债和净资产总计		49,454,901.71	51,947,954.86

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 7 月 28 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 7 月 28 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 1.1303 元，基金份额总额 43,240,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证 A50 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		994,570.96
1.利息收入		4,960.31
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,960.31
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）		1,605,158.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,049,363.58
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	555,795.11
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	-618,625.46
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	3,077.42
减：二、营业总支出		214,987.37
1. 管理人报酬		189,901.12
2. 托管费		23,737.64
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	1,348.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		779,583.59
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		779,583.59
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		779,583.59

注：本基金合同生效日为 2025 年 7 月 28 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：易方达中证 A50 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	46,240,000.00	5,040,112.46	51,280,112.46
二、本期期初净资产	46,240,000.00	5,040,112.46	51,280,112.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,000,000.00	592,503.60	-2,407,496.40
（一）、综合收益总额	-	779,583.59	779,583.59
（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）	-3,000,000.00	-187,079.99	-3,187,079.99
其中：1.基金申购款	7,000,000.00	1,008,811.21	8,008,811.21
2.基金赎回款	-10,000,000.00	-1,195,891.20	-11,195,891.20
（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	43,240,000.00	5,632,616.06	48,872,616.06

注：本基金合同生效日为 2025 年 7 月 28 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

易方达中证 A50 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[2024]1859 号《关于准予易方达中证 A50 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《易方达中证 A50 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,《易方达中证 A50 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 7 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 222,240,000.00 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、

财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部 税务总局公告 2021 年第 33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8

月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,201,344.88
等于：本金	3,201,078.12
加：应计利息	266.76
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	3,201,344.88

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		43,851,113.76	-	45,725,057.70	1,873,943.94
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	43,851,113.76	-	45,725,057.70	1,873,943.94

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

本基金本报告期末无其他资产。

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	2,437.06
其中：交易所市场	2,437.06
银行间市场	-
应付利息	-
应付替代款	102,074.34
合计	104,511.40

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	46,240,000.00	46,240,000.00
本期申购	7,000,000.00	7,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-10,000,000.00	-10,000,000.00
本期末	43,240,000.00	43,240,000.00

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	5,998,675.35	-958,562.89	5,040,112.46
本期期初	5,998,675.35	-958,562.89	5,040,112.46
本期利润	1,398,209.05	-618,625.46	779,583.59
本期基金份额交易产生的变动数	-423,904.72	236,824.73	-187,079.99
其中：基金申购款	937,520.94	71,290.27	1,008,811.21
基金赎回款	-1,361,425.66	165,534.46	-1,195,891.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,972,979.68	-1,340,363.62	5,632,616.06

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	4,806.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	97.86
其他	55.71
合计	4,960.31

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	781,179.64
股票投资收益——赎回差价收入	268,183.94
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	1,049,363.58

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	34,293,542.15
减：卖出股票成本总额	33,484,023.86
减：交易费用	28,338.65

买卖股票差价收入	781,179.64
----------	------------

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	11,195,891.20
减：现金支付赎回款总额	4,230,512.20
减：赎回股票成本总额	6,697,195.06
减：交易费用	-
赎回差价收入	268,183.94

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	555,795.11
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	555,795.11

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	-618,625.46
——股票投资	-618,625.46
——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	-618,625.46

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	3,077.42
合计	3,077.42

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,348.61
合计	1,348.61

注：本报告期内，基金管理人自主承担本基金的信息披露费 39,671.23 元、审计费 2,479.45 元、银行间账户维护及查询费 9,000.00 元、IOPV 计算与发布费 9,917.81 元、注册登记费 59,506.85 元。

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
招商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	189,901.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,316.16
应支付基金管理人的净管理费	180,584.96

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对

无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	23,737.64

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
报告期初持有的基金份额	22,869,500.00
报告期间申购/买入总份额	4,500,000.00
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	27,369,500.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	63.2967%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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
广发证券股份有限公司	2,041,800.00	4.7220%	4,562,100.00	9.8661%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	3,201,344.88	4,806.74

注：本基金的上述银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期内，基金管理人自主承担本基金的信息披露费 39,671.23 元、审计费 2,479.45 元、银行间账户维护及查询费 9,000.00 元、IOPV 计算与发布费 9,917.81 元、注册登记费 59,506.85 元。

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	-

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，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 0.00%(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	3,201,344.88	-	-	-	3,201,344.88
结算备付金	62,894.91	-	-	-	62,894.91
存出保证金	10,781.96	-	-	-	10,781.96
交易性金融资产	-	-	-	45,725,057.70	45,725,057.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	454,822.26	454,822.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,275,021.75	-	-	46,179,879.96	49,454,901.71
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	-	-	-	441,119.42	441,119.42
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	32,582.08	32,582.08
应付托管费	-	-	-	4,072.75	4,072.75
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	-	-	-	104,511.40	104,511.40
负债总计	-	-	-	582,285.65	582,285.65
利率敏感度缺口	3,275,021.75	-	-	45,597,594.31	48,872,616.06
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	3,970,442.02	-	-	-	3,970,442.02
结算备付金	91,473.35	-	-	-	91,473.35
存出保证金	68,639.00	-	-	-	68,639.00

交易性金融资产	-	-	-	47,549,775.62	47,549,775.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	267,624.87	267,624.87
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,130,554.37	-	-	47,817,400.49	51,947,954.86
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	-	-	-	533,732.41	533,732.41
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	35,321.23	35,321.23
应付托管费	-	-	-	4,415.16	4,415.16
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	-	-	-	94,373.60	94,373.60
负债总计	-	-	-	667,842.40	667,842.40
利率敏感度缺口	4,130,554.37	-	-	47,149,558.09	51,280,112.46

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	45,725,057.70	93.56	47,549,775.62	92.73
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	45,725,057.70	93.56	47,549,775.62	92.73

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%	2,549,147.42	2,585,815.97
	2.业绩比较基准下降 5%	-2,549,147.42	-2,585,815.97

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	45,714,947.70
第二层次	10,110.00
第三层次	-
合计	45,725,057.70

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	45,725,057.70	92.46
	其中：股票	45,725,057.70	92.46
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	3,264,239.79	6.60
8	其他各项资产	465,604.22	0.94
9	合计	49,454,901.71	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	2,742,774.00	5.61
C	制造业	29,675,978.70	60.72
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	860,247.00	1.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,363,130.00	4.84
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	4,009,222.00	8.20
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,651,351.70	81.13

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	1,167,450.00	2.39
C	制造业	4,896,146.00	10.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,110.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,073,706.00	12.43

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	300308	中际旭创	3,600	4,572,000.00	9.35
2	300750	宁德时代	11,400	4,480,314.00	9.17
3	600519	贵州茅台	3,500	4,149,215.00	8.49
4	603259	药明康德	32,200	4,009,222.00	8.20
5	002371	北方华创	3,200	2,830,592.00	5.79
6	601899	紫金矿业	109,100	2,742,774.00	5.61
7	600031	三一重工	157,100	2,714,688.00	5.55
8	600309	万华化学	35,900	2,455,919.00	5.03
9	601318	中国平安	49,500	2,363,130.00	4.84
10	002475	立讯精密	23,700	1,668,480.00	3.41
11	605499	东鹏饮料	12,390	1,529,297.70	3.13
12	000333	美的集团	19,300	1,457,729.00	2.98
13	600276	恒瑞医药	20,600	1,072,024.00	2.19
14	300274	阳光电源	6,400	1,017,728.00	2.08
15	300124	汇川技术	13,200	875,556.00	1.79
16	601816	京沪高铁	189,900	860,247.00	1.76
17	600660	福耀玻璃	16,900	852,436.00	1.74

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	300502	新易盛	5,940	3,605,580.00	7.38
2	600809	山西汾酒	11,800	1,290,566.00	2.64
3	600938	中国海油	43,000	1,167,450.00	2.39
4	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.02

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	300502	新易盛	2,503,112.40	4.88
2	600938	中国海油	1,891,164.00	3.69
3	603259	药明康德	1,861,252.00	3.63
4	605499	东鹏饮料	1,818,380.00	3.55
5	300750	宁德时代	1,703,189.00	3.32
6	600030	中信证券	1,469,650.00	2.87
7	300308	中际旭创	1,348,125.52	2.63
8	688256	寒武纪	1,252,033.52	2.44
9	000858	五粮液	1,216,034.00	2.37

10	600426	华鲁恒升	1,214,527.00	2.37
11	600309	万华化学	1,181,500.00	2.30
12	002371	北方华创	1,143,664.00	2.23
13	601816	京沪高铁	1,103,185.00	2.15
14	300476	胜宏科技	1,070,663.00	2.09
15	000425	徐工机械	1,053,700.00	2.05
16	300124	汇川技术	1,027,985.00	2.00
17	601088	中国神华	1,026,205.00	2.00
18	600809	山西汾酒	987,968.00	1.93
19	300274	阳光电源	977,322.00	1.91
20	002475	立讯精密	919,126.00	1.79

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	300308	中际旭创	3,154,931.00	6.15
2	600030	中信证券	2,519,445.00	4.91
3	300750	宁德时代	2,376,604.00	4.63
4	600809	山西汾酒	2,147,885.98	4.19
5	002463	沪电股份	2,027,052.00	3.95
6	002311	海大集团	1,900,636.00	3.71
7	600989	宝丰能源	1,576,120.00	3.07
8	603259	药明康德	1,558,222.00	3.04
9	002027	分众传媒	1,479,477.00	2.89
10	002475	立讯精密	1,391,394.00	2.71
11	688256	寒武纪	1,379,867.23	2.69
12	688981	中芯国际	1,240,811.70	2.42
13	000425	徐工机械	1,105,955.00	2.16
14	000858	五粮液	1,076,597.00	2.10
15	600426	华鲁恒升	1,026,132.00	2.00
16	601088	中国神华	1,011,231.00	1.97
17	300476	胜宏科技	1,001,601.00	1.95
18	601318	中国平安	922,933.00	1.80
19	002371	北方华创	811,870.00	1.58
20	600893	航发动力	772,176.00	1.51

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	33,921,020.46
卖出股票收入（成交）总额	34,293,542.15

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 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	10,781.96
2	应收清算款	454,822.26
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	-
8	其他	-
9	合计	465,604.22

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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	001248	华润新能源	10,110.00	0.02	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
414	104,444.44	36,924,300.00	85.39%	6,315,700.00	14.61%

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 7 月 28 日）基金份额总额	222,240,000.00
本报告期期初基金份额总额	46,240,000.00
本报告期基金总申购份额	7,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	43,240,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	6,085,120.52	8.92%	608.53	8.92%	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	36,577,530.69	53.63%	3,657.73	53.63%	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	10,448,600.00	15.32%	1,044.93	15.32%	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	15,087,611.40	22.12%	1,508.73	22.12%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

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

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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

				比例		
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日
----	------	--------	-------

			期
1	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、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	中国证券报	2026-01-22
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加粤开证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-02
4	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加金融街证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-20
5	易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报	2026-03-31
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2026-04-22
8	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
9	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华源证券为一级交易商的公告	中国证券报、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

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
机构	1	2026 年 01 月 01 日 ~2026 年 06 月 30 日	22,869,500.00	4,500,000.00	0.00	27,369,500.00	63.30 %
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人自主承担本基金的固定费用。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证 A50 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证 A50 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证 A50 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