

易方达上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 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	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48

7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
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	51
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证 380 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达上证 380ETF
场内简称	上证 380、上证 380ETF 易方达
基金主代码	530380
交易代码	530380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 9 月 22 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	150,705,000.00 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 30 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	上证 380 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	许俊
	联系电话	020-85102688	010-66596688
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566

传真	020-38798812	010-66594942
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广东省广州市天河区珠江西路 21号52层；广东省广州市天河区 珠江东路30号42层；广东省珠海 市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510627；510623；519031	100818
法定代表人	吴欣荣	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	76,197,327.74
本期利润	70,059,715.08
加权平均基金份额本期利润	0.2634
本期加权平均净值利润率	23.73%
本期基金份额净值增长率	18.87%
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	31,572,862.42
期末可供分配基金份额利润	0.2095
期末基金资产净值	182,277,862.42
期末基金份额净值	1.2095
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	20.95%

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。

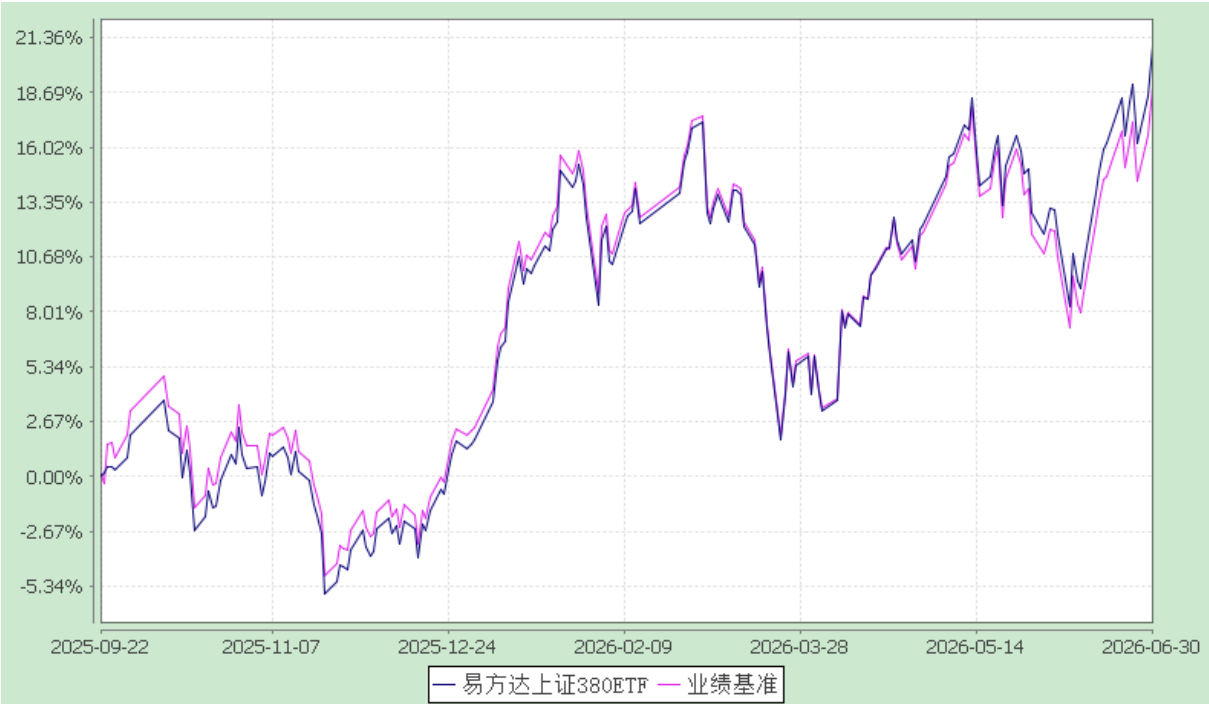
3.2 基金净值表现

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	16.26%	1.43%	14.19%	1.44%	2.07%	-0.01%
过去六个月	18.87%	1.47%	16.19%	1.47%	2.68%	0.00%
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	20.95%	1.32%	18.94%	1.34%	2.01%	-0.02%

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

易方达上证 380 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 9 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：1.本基金合同于 2025 年 9 月 22 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		
张 泽 峰	本基金的基金经理，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 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 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、易方达国证价值 100ETF、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	2025-09-22	-	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。

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

本基金跟踪上证 380 指数，该指数从沪市证券中选取市值规模中等、流动性较好的 380 只证券作为样本，反映上海证券市场中等市值上市公司证券整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

2026 年上半年，在持续积极有为的宏观政策效应驱动下，国内经济保持着稳中向好的发展态势。上半年我国 GDP 按不变价格计算同比增长 4.7%，处于全年经济增长目标区间，其中制造业和服务业的贡献较高。在外需提振与出口数据向好的背景下，上半年国内规模以上高技术制造业增加值同

比增长 13.3%，规模以上工业企业利润总额同比增长 18.7%，表明以高新技术为代表的新经济动能不断发展壮大，成为国内经济增长的重要引擎；消费层面，随着提振消费专项行动的深入实施，优质服务消费供给不断扩大，国内消费市场开始扩容和提质升级。目前政策层面再次明确提出“加大逆周期调节力度”，表明现有政策工具有望加速落地，同时新的政策将储备接续。未来在积极的财政政策与适度宽松的货币政策基调延续下，今年经济持续稳定增长的基础将进一步夯实。在此背景下，A 股市场整体呈现出震荡走高的特征，以人工智能为代表的科技成长型资产持续受到资金青睐。本报告期内，A 股市场震荡上行，上证 380 指数上涨 16.19%。

本报告期涵盖本基金的建仓期，建仓期间内本基金采取相对灵活以及审慎的建仓策略，在严格按照基金合同要求以及尽量减少市场冲击的原则下进行基金的建仓工作。在基金的正常运作期，本基金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。

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 1.2095 元，本报告期份额净值增长率为 18.87%，同期业绩比较基准收益率为 16.19%。年化跟踪误差 0.80%，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，政策层面有望持续围绕扩大内需提振消费，并在投资端加快下达重大项目形成实物工作量，保障“十五五”规划实现良好开局，顺利完成全年经济增长既定目标。同时得益于全球 AI 产业链资本开支的不断增长，下半年我国高新技术出口有望持续保持较强的韧性。资本市场方面，近期监管层密集召开系列座谈会，并要求“综合施策全力维护市场平稳运行，提升资本市场韧性”。未来在积极的财政政策和适度宽松的货币政策延续下，资本市场有望在经济新旧动能平稳转换过程中持续吸引更多增量资金与中长期资金，并展现出较好的赚钱效应与新的投资机遇。未来在国内供给侧改革与全球需求提升的双重催化下，国内中小盘周期和制造板块将迎来较好投资机遇。供给端，随着相关过剩产能的加速出清，中盘制造业的资本开支与利润率已开始触底回升，其中科技制造已重回扩张周期并展现出净利润率改善的特征；需求端，国内企业出口产品的价值附加含量开始显著提升，龙头企业的海外份额占比不断提升。未来在资本市场流动性条件改善和保持充裕的背景下，中小盘股的投资价值有望持续展现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达上证 380 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达上证 380 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	744,679.90	2,970,786.49
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	181,589,179.75	675,893,332.03
其中：股票投资		181,446,175.78	675,734,329.94
基金投资		-	-
债券投资		143,003.97	159,002.09
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		26,790.38	-
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		182,421,142.66	678,864,118.52
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		-	350,557.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		22,483.29	102,582.39
应付托管费		7,494.45	34,194.12
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.06

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	113,302.50	30,000.00
负债合计		143,280.24	517,334.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	150,705,000.00	666,705,000.00
未分配利润	6.4.7.8	31,572,862.42	11,641,784.28
净资产合计		182,277,862.42	678,346,784.28
负债和净资产总计		182,421,142.66	678,864,118.52

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 9 月 22 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 9 月 22 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 1.2095 元，基金份额总额 150,705,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证 380 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		70,492,653.86
1.利息收入		1,927.68
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,927.68
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）		76,621,974.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	74,653,725.02
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	538,706.44
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	1,429,543.10
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	-6,137,612.66
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	6,364.28
减：二、营业总支出		432,938.78
1. 管理人报酬		223,616.06

2. 托管费		74,538.70
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		0.01
8. 其他费用	6.4.7.18	134,784.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,059,715.08
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,059,715.08
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		70,059,715.08

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 22 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 380 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	666,705,000.00	11,641,784.28	678,346,784.28
二、本期期初净资产	666,705,000.00	11,641,784.28	678,346,784.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-516,000,000.00	19,931,078.14	-496,068,921.86
（一）、综合收益总额	-	70,059,715.08	70,059,715.08
（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）	-516,000,000.00	-50,128,636.94	-566,128,636.94
其中：1.基金申购款	16,000,000.00	2,660,154.23	18,660,154.23
2.基金赎回	-532,000,000.00	-52,788,791.17	-584,788,791.17

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	150,705,000.00	31,572,862.42	182,277,862.42

注：本基金合同生效日为 2025 年 9 月 22 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 380 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]1412 号《关于准予易方达上证 380 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 380 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 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 426,705,000.00 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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	170,440.01
等于：本金	170,425.67
加：应计利息	14.34
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	574,239.89
等于：本金	574,188.52
加：应计利息	51.37
合计	744,679.90

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		162,660,951.43	-	181,446,175.78	18,785,224.35
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	142,999.21	4.76	143,003.97	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	142,999.21	4.76	143,003.97	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		162,803,950.64	4.76	181,589,179.75	18,785,224.35

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	74,383.76
可退替代款	9,582.64
其他应付款	29,336.10
合计	113,302.50

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	666,705,000.00	666,705,000.00
本期申购	16,000,000.00	16,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-532,000,000.00	-532,000,000.00
本期末	150,705,000.00	150,705,000.00

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	27,072,849.80	-15,431,065.52	11,641,784.28
本期期初	27,072,849.80	-15,431,065.52	11,641,784.28
本期利润	76,197,327.74	-6,137,612.66	70,059,715.08
本期基金份额交易产生的变动数	-55,960,324.64	5,831,687.70	-50,128,636.94
其中：基金申购款	3,853,231.58	-1,193,077.35	2,660,154.23
基金赎回款	-59,813,556.22	7,024,765.05	-52,788,791.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,309,852.90	-15,736,990.48	31,572,862.42

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	633.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,293.93
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,927.68

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	18,796,834.34
股票投资收益——赎回差价收入	55,856,890.68
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	74,653,725.02

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	144,553,796.90
减：卖出股票成本总额	125,647,709.73
减：交易费用	109,252.83
买卖股票差价收入	18,796,834.34

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	584,788,791.17
减：现金支付赎回款总额	2,563,463.17
减：赎回股票成本总额	526,368,437.32
减：交易费用	-
赎回差价收入	55,856,890.68

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	13.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	538,693.23
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	538,706.44

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	64,349,998.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	63,520,226.09
减：应计利息总额	288,482.41
减：交易费用	2,596.70
买卖债券差价收入	538,693.23

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,429,543.10
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,429,543.10

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	-6,137,612.66
——股票投资	-6,137,612.66
——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	-6,137,612.66

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	6,364.28
合计	6,364.28

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	-
银行汇划费	755.00
存托服务费	137.88
其他	59,507.37
合计	134,784.01

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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	223,616.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,996.96
应支付基金管理人的净管理费	213,619.10

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

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	74,538.70

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

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
易方达上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	116,987,707.00	77.6270%	552,200,207.00	82.8253%
广发证券股份有限公司	2,769,381.00	1.8376%	2,314,601.00	0.3472%

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
中国银行-活期存款	170,440.01	633.75

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期					
2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56

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

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，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，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于托管人关联方中银证券发行的 A 股中银证券。于 2026 年 06 月

30 日，本基金持有中银证券发行的 A 股中银证券 44,900 股（2025 年 12 月 31 日：198,000 股），占本基金净值比例为 0.31%（2025 年 12 月 31 日：0.44%）。

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
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	502	5,612.36	8,830.18	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	51	1,707.99	1,730.43	-
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	192	3,398.40	16,189.44	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	102	4,179.96	31,435.38	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	5,797	103,070.66	177,678.05	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月	新股流通	22.68	47.61	622	14,106.96	29,613.42	-

				受限						
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	738	84,338.64	499,581.72	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	77	3,431.12	36,087.59	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	533	55,783.78	409,818.37	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	70	5,731.60	110,903.10	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,359	12,869.73	95,320.26	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	403	7,931.04	57,020.47	-

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	540	54,000.00	54,000.59	-
113704	春风转债	2026-06-11	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	440	44,000.00	44,001.93	-
118070	南芯转债	2026-06-22	1 个月内	新发流通	100.00	100.00	310	31,000.00	31,001.23	-

			(含)	受限						
11807 1	华峰 转债	2026-0 6-24	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.00	140	14,000 .00	14,000 .22	-

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 0.08%(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	上年度末
--------	-----	------

	2026年6月30日	2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	143,003.97	159,002.09
未评级	0.00	0.00
合计	143,003.97	159,002.09

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同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	744,679.90	-	-	-	744,679.90
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	143,003.97	181,446,175.78	181,589,179.7

					5
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	26,790.38	26,790.38
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	744,679.90	-	143,003.97	181,533,458.79	182,421,142.66
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	22,483.29	22,483.29
应付托管费	-	-	-	7,494.45	7,494.45
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	-	-	-	113,302.50	113,302.50
负债总计	-	-	-	143,280.24	143,280.24
利率敏感度缺口	744,679.90	-	143,003.97	181,390,178.55	182,277,862.42
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	2,970,786.49	-	-	-	2,970,786.49
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	159,002.09	675,734,329.94	675,893,332.03

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	2,970,786.49	-	159,002.09	675,734,329.94	678,864,118.52
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	-	-	-	350,557.67	350,557.67
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	102,582.39	102,582.39
应付托管费	-	-	-	34,194.12	34,194.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.06	0.06
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	30,000.00	30,000.00
负债总计	-	-	-	517,334.24	517,334.24
利率敏感度缺口	2,970,786.49	-	159,002.09	675,216,995.70	678,346,784.28

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	181,446,175.78	99.54	675,734,329.94	99.61
交易性金融资产—债券投资	143,003.97	0.08	-	-
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	181,589,179.75	99.62	675,734,329.94	99.61

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%	9,044,447.62	33,763,941.71
	2.业绩比较基准下降 5%	-9,044,447.62	-33,763,941.71

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	179,784,541.69
第二层次	143,003.97
第三层次	1,661,634.09
合计	181,589,179.75

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	181,446,175.78	99.47
	其中：股票	181,446,175.78	99.47

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	143,003.97	0.08
	其中：债券	143,003.97	0.08
	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	744,679.90	0.41
8	其他各项资产	87,283.01	0.05
9	合计	182,421,142.66	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	207,044.00	0.11
B	采矿业	7,692,168.75	4.22
C	制造业	126,614,235.32	69.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,533,854.20	3.58
E	建筑业	3,224,547.00	1.77
F	批发和零售业	2,268,561.98	1.24
G	交通运输、仓储和邮政业	3,456,274.12	1.90
H	住宿和餐饮业	196,560.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,443,135.43	5.73
J	金融业	12,927,348.18	7.09
K	房地产业	2,767,155.00	1.52
L	租赁和商务服务业	830,347.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	1,400,121.04	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	1,847,106.92	1.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	286,116.60	0.16
R	文化、体育和娱乐业	751,600.24	0.41
S	综合	-	-
	合计	181,446,175.78	99.54

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	688498	源杰科技	2,681	5,056,366.00	2.77
2	688347	华虹宏力	10,893	3,663,315.90	2.01
3	688120	华海清科	10,747	3,462,468.46	1.90
4	688361	中科飞测	6,689	2,876,270.00	1.58
5	688200	华峰测控	3,889	2,042,113.90	1.12
6	688777	中控技术	17,075	2,006,312.50	1.10
7	688037	芯源微	4,368	1,917,770.40	1.05
8	603083	剑桥科技	7,400	1,886,038.00	1.03
9	601869	长飞光纤	3,300	1,801,470.00	0.99
10	600460	士兰微	31,400	1,716,324.00	0.94
11	688019	安集科技	4,864	1,651,133.44	0.91
12	600498	烽火通信	21,978	1,617,580.80	0.89
13	688313	仕佳光子	8,551	1,578,942.15	0.87
14	688002	睿创微纳	10,095	1,561,595.55	0.86
15	600879	航天电子	71,100	1,513,719.00	0.83
16	688469	芯联集成	135,482	1,437,464.02	0.79
17	688017	绿的谐波	3,408	1,424,066.88	0.78
18	688630	芯碁微装	2,446	1,343,807.94	0.74
19	603256	宏和科技	4,900	1,300,117.00	0.71
20	688702	盛科通信	3,294	1,284,627.06	0.70
21	688172	燕东微	15,316	1,281,336.56	0.70
22	600988	赤峰黄金	44,800	1,179,136.00	0.65
23	688099	晶晨股份	11,343	1,167,194.70	0.64
24	605589	圣泉集团	18,200	1,156,974.00	0.63
25	600667	太极实业	39,400	1,149,692.00	0.63
26	600885	宏发股份	33,307	1,148,758.43	0.63
27	600392	盛和资源	37,800	1,125,306.00	0.62
28	600601	方正科技	80,500	1,114,120.00	0.61
29	600141	兴发集团	22,642	1,063,494.74	0.58
30	600378	昊华科技	13,900	1,047,782.00	0.57
31	601179	中国西电	69,000	1,029,480.00	0.56
32	688234	天岳先进	5,870	1,018,503.70	0.56

33	600497	驰宏锌锗	81,500	986,965.00	0.54
34	603005	晶方科技	17,600	948,112.00	0.52
35	600157	永泰能源	587,700	946,197.00	0.52
36	688629	华丰科技	4,933	924,986.83	0.51
37	600711	盛屯矿业	83,200	912,704.00	0.50
38	600909	华安证券	81,178	901,887.58	0.49
39	600143	金发科技	57,600	889,920.00	0.49
40	605111	新洁能	8,900	882,346.00	0.48
41	688411	海博思创	2,966	863,699.20	0.47
42	601126	四方股份	13,500	853,200.00	0.47
43	688220	翱捷科技	6,845	850,970.40	0.47
44	600352	浙江龙盛	70,100	848,911.00	0.47
45	601555	东吴证券	107,100	848,232.00	0.47
46	601233	桐昆股份	38,500	833,525.00	0.46
47	603659	璞泰来	28,800	833,184.00	0.46
48	688027	国盾量子	1,636	824,560.36	0.45
49	601058	赛轮轮胎	70,900	817,477.00	0.45
50	688213	思特威	7,571	810,626.97	0.44
51	603588	高能环境	41,000	787,200.00	0.43
52	688578	艾力斯	7,203	786,567.60	0.43
53	688388	嘉元科技	17,763	781,572.00	0.43
54	688235	百济神州	3,035	772,741.35	0.42
55	688122	西部超导	12,179	764,962.99	0.42
56	601108	财通证券	87,600	757,740.00	0.42
57	601456	国联民生	84,700	748,748.00	0.41
58	603129	春风动力	2,900	741,820.00	0.41
59	601958	金钼股份	26,100	733,671.00	0.40
60	688387	信科移动	36,751	729,139.84	0.40
61	601117	中国化学	98,700	725,445.00	0.40
62	688385	复旦微电	10,101	720,100.29	0.40
63	600641	先导基电	17,800	709,508.00	0.39
64	601991	大唐发电	100,200	709,416.00	0.39
65	601198	东兴证券	52,200	709,398.00	0.39
66	688123	聚辰股份	3,319	705,619.40	0.39
67	688322	奥比中光	5,401	705,100.55	0.39
68	601878	浙商证券	73,900	702,050.00	0.39
69	600839	四川长虹	99,500	694,510.00	0.38
70	688301	奕瑞科技	5,589	693,036.00	0.38
71	600563	法拉电子	3,600	686,880.00	0.38
72	603179	新泉股份	13,490	669,778.50	0.37
73	601665	齐鲁银行	116,000	669,320.00	0.37
74	603156	养元饮品	13,600	667,352.00	0.37
75	603063	禾望电气	12,400	655,836.00	0.36
76	603650	彤程新材	6,678	654,310.44	0.36

77	603678	火炬电子	7,700	639,100.00	0.35
78	603379	三美股份	8,200	622,298.00	0.34
79	688676	金盘科技	7,321	619,649.44	0.34
80	601099	太平洋	183,600	618,732.00	0.34
81	688331	荣昌生物	4,747	618,344.22	0.34
82	600109	国金证券	69,900	613,722.00	0.34
83	603688	石英股份	7,300	603,053.00	0.33
84	601021	春秋航空	13,200	601,656.00	0.33
85	688333	铂力特	5,875	601,600.00	0.33
86	689009	九号公司	15,719	599,679.85	0.33
87	603979	金诚信	10,100	596,203.00	0.33
88	600256	广汇能源	120,500	595,270.00	0.33
89	600298	安琪酵母	16,400	593,680.00	0.33
90	600060	海信视像	21,100	588,057.00	0.32
91	688728	格科微	27,286	574,097.44	0.31
92	600021	上海电力	37,960	572,057.20	0.31
93	601128	常熟银行	98,280	571,989.60	0.31
94	601636	旗滨集团	55,821	571,048.83	0.31
95	600699	均胜电子	26,300	568,343.00	0.31
96	601696	中银证券	44,900	567,985.00	0.31
97	600577	精达股份	57,983	567,073.74	0.31
98	601577	长沙银行	65,000	566,150.00	0.31
99	601615	明阳智能	48,700	563,459.00	0.31
100	603920	世运电路	11,600	557,264.00	0.31
101	601677	明泰铝业	33,500	556,100.00	0.31
102	603606	东方电缆	13,320	552,913.20	0.30
103	603087	甘李药业	9,700	550,572.00	0.30
104	688127	蓝特光学	5,518	538,556.80	0.30
105	603283	赛腾股份	6,600	534,468.00	0.29
106	688599	天合光能	37,851	534,456.12	0.29
107	688608	恒玄科技	3,129	523,137.51	0.29
108	688169	石头科技	5,508	523,094.76	0.29
109	688390	固德威	4,661	505,765.11	0.28
110	603119	浙江荣泰	7,600	504,184.00	0.28
111	600600	青岛啤酒	9,600	501,408.00	0.28
112	688795	摩尔线程	738	499,581.72	0.27
113	688375	国博电子	4,751	495,529.30	0.27
114	688180	君实生物	14,516	490,931.12	0.27
115	603290	斯达半导	3,200	489,408.00	0.27
116	600171	上海贝岭	15,300	488,682.00	0.27
117	688187	时代电气	7,053	484,258.98	0.27
118	603369	今世缘	20,200	478,942.00	0.26
119	600027	华电国际	106,600	474,370.00	0.26
120	603806	福斯特	28,125	472,218.75	0.26

121	600177	雅戈尔	62,300	469,119.00	0.26
122	688065	凯赛生物	9,685	463,427.25	0.25
123	603160	汇顶科技	7,500	462,825.00	0.25
124	601607	上海医药	30,000	462,000.00	0.25
125	688188	柏楚电子	4,313	460,197.10	0.25
126	600642	申能股份	52,700	460,071.00	0.25
127	601699	潞安环能	32,200	459,816.00	0.25
128	603127	昭衍新药	11,900	454,818.00	0.25
129	688484	南芯科技	8,039	454,123.11	0.25
130	688568	中科星图	10,943	453,806.21	0.25
131	600918	中泰证券	85,300	453,796.00	0.25
132	600061	国投资本	68,900	451,295.00	0.25
133	600637	东方明珠	54,300	451,233.00	0.25
134	603225	新凤鸣	22,571	443,520.15	0.24
135	688800	瑞可达	4,609	442,325.73	0.24
136	603345	安井食品	5,500	441,045.00	0.24
137	600369	西南证券	107,400	431,748.00	0.24
138	603444	吉比特	1,200	430,104.00	0.24
139	688617	惠泰医疗	2,362	428,844.72	0.24
140	600499	科达制造	31,000	427,800.00	0.23
141	600085	同仁堂	18,500	427,535.00	0.23
142	688700	东威科技	4,759	425,454.60	0.23
143	600536	中国软件	15,120	425,174.40	0.23
144	688472	阿特斯	39,247	424,652.54	0.23
145	605090	九丰能源	11,400	423,738.00	0.23
146	600515	海南机场	153,900	421,686.00	0.23
147	603596	伯特利	16,956	421,187.04	0.23
148	603699	纽威股份	8,300	417,490.00	0.23
149	688005	容百科技	13,463	411,967.80	0.23
150	601016	节能风电	105,800	410,504.00	0.23
151	688802	沐曦股份	533	409,818.37	0.22
152	600985	淮北矿业	29,000	407,450.00	0.22
153	600521	华海药业	28,200	406,080.00	0.22
154	600862	中航高科	22,500	405,675.00	0.22
155	601216	君正集团	90,900	405,414.00	0.22
156	601717	中创智领	29,100	404,781.00	0.22
157	601997	贵阳银行	78,800	404,244.00	0.22
158	600888	新疆众和	25,100	398,839.00	0.22
159	600863	华能蒙电	84,400	396,680.00	0.22
160	603766	隆鑫通用	33,200	396,076.00	0.22
161	600704	物产中大	83,600	394,592.00	0.22
162	601001	晋控煤业	22,500	391,275.00	0.21
163	601990	南京证券	59,300	389,601.00	0.21
164	600873	梅花生物	52,900	388,815.00	0.21

165	688538	和辉光电	148,831	386,960.60	0.21
166	603077	和邦生物	166,500	386,280.00	0.21
167	603236	移远通信	7,540	385,821.80	0.21
168	600845	宝信软件	23,100	384,153.00	0.21
169	600459	贵研铂业	13,300	384,104.00	0.21
170	603605	珀莱雅	6,400	383,488.00	0.21
171	600332	白云山	18,900	378,756.00	0.21
172	600765	中航重机	29,300	378,556.00	0.21
173	688116	天奈科技	9,901	378,218.20	0.21
174	688297	中无人机	9,061	376,484.55	0.21
175	688131	皓元医药	3,977	376,224.20	0.21
176	600153	建发股份	46,900	371,917.00	0.20
177	600348	华阳股份	48,600	371,790.00	0.20
178	600323	瀚蓝环境	13,200	362,472.00	0.20
179	601611	中国核建	32,500	362,375.00	0.20
180	600901	江苏金租	62,400	358,800.00	0.20
181	688106	金宏气体	8,628	357,889.44	0.20
182	688692	达梦数据	1,451	354,464.79	0.19
183	600578	京能电力	54,100	348,945.00	0.19
184	603728	鸣志电器	5,700	347,244.00	0.19
185	600363	联创光电	9,700	347,066.00	0.19
186	688114	华大智造	6,761	345,351.88	0.19
187	600737	中粮糖业	28,000	345,240.00	0.19
188	601799	星宇股份	3,800	344,356.00	0.19
189	603568	伟明环保	22,084	339,651.92	0.19
190	600398	海澜之家	64,700	338,381.00	0.19
191	603298	杭叉集团	14,100	336,426.00	0.18
192	603267	鸿远电子	4,300	333,164.00	0.18
193	601137	博威合金	14,863	331,890.79	0.18
194	601000	唐山港	79,800	331,170.00	0.18
195	688009	中国通号	69,564	331,124.64	0.18
196	600529	山东药玻	17,900	330,255.00	0.18
197	600486	扬农化工	6,500	329,550.00	0.18
198	600208	衢州发展	114,600	324,318.00	0.18
199	600316	洪都航空	11,600	324,104.00	0.18
200	603341	龙旗科技	7,600	322,924.00	0.18
201	600008	首创环保	118,700	322,864.00	0.18
202	688248	南网科技	4,638	320,856.84	0.18
203	600435	北方导航	28,500	319,200.00	0.18
204	600170	上海建工	143,600	318,792.00	0.17
205	600998	九州通	67,900	318,451.00	0.17
206	600995	南网储能	25,800	317,340.00	0.17
207	688208	道通科技	12,564	316,487.16	0.17
208	603486	科沃斯	6,200	314,650.00	0.17

209	600820	隧道股份	59,300	308,953.00	0.17
210	600161	天坛生物	26,600	308,028.00	0.17
211	600282	南钢股份	66,425	304,890.75	0.17
212	600483	福能股份	29,900	304,681.00	0.17
213	603885	吉祥航空	29,400	302,526.00	0.17
214	688303	大全能源	17,313	301,765.59	0.17
215	600583	海油工程	59,500	299,285.00	0.16
216	688778	厦钨新能	5,470	297,568.00	0.16
217	603816	顾家家居	13,300	297,388.00	0.16
218	688516	奥特维	5,128	294,295.92	0.16
219	603939	益丰药房	16,301	293,091.98	0.16
220	600546	山煤国际	26,700	291,831.00	0.16
221	603690	至纯科技	8,200	290,280.00	0.16
222	688295	中复神鹰	4,791	290,047.14	0.16
223	603338	浙江鼎力	6,800	289,000.00	0.16
224	600428	中远海特	36,900	288,189.00	0.16
225	688166	博瑞医药	8,223	287,887.23	0.16
226	600329	达仁堂	7,700	286,594.00	0.16
227	688690	纳微科技	6,496	286,473.60	0.16
228	600763	通策医疗	8,445	286,116.60	0.16
229	601666	平煤股份	39,945	285,606.75	0.16
230	603281	江瀚新材	7,000	284,410.00	0.16
231	600562	国睿科技	13,400	284,348.00	0.16
232	688318	财富趋势	3,963	282,601.53	0.16
233	601567	三星电气	18,900	282,366.00	0.15
234	600380	健康元	29,600	278,832.00	0.15
235	600038	中直股份	11,000	278,190.00	0.15
236	603565	中谷物流	28,300	277,623.00	0.15
237	600390	五矿资本	60,600	276,336.00	0.15
238	601156	东航物流	17,100	275,652.00	0.15
239	600761	安徽合力	16,819	275,158.84	0.15
240	601880	辽港股份	198,400	273,792.00	0.15
241	601399	国机重装	77,700	271,950.00	0.15
242	601865	福莱特	25,600	269,056.00	0.15
243	600132	重庆啤酒	6,500	268,450.00	0.15
244	688281	华秦科技	5,211	261,748.53	0.14
245	601236	红塔证券	38,100	259,842.00	0.14
246	600816	建元信托	106,100	258,884.00	0.14
247	688336	三生国健	4,784	254,030.40	0.14
248	688779	五矿新能	31,178	252,853.58	0.14
249	600970	中材国际	35,300	251,689.00	0.14
250	601155	新城控股	24,400	250,344.00	0.14
251	603613	国联股份	13,545	249,498.90	0.14
252	600967	内蒙一机	22,900	248,465.00	0.14

253	601187	厦门银行	35,500	242,465.00	0.13
254	600120	浙江东方	55,200	237,360.00	0.13
255	600285	羚锐制药	12,200	236,436.00	0.13
256	688278	特宝生物	4,333	235,715.20	0.13
257	600131	国网信通	16,100	235,060.00	0.13
258	688006	杭可科技	6,430	235,016.50	0.13
259	601528	瑞丰银行	52,900	233,818.00	0.13
260	600064	南京高科	32,600	232,438.00	0.13
261	603619	中曼石油	12,400	232,004.00	0.13
262	600095	湘财股份	30,800	231,924.00	0.13
263	600452	涪陵电力	24,800	231,384.00	0.13
264	603737	三棵树	9,600	231,360.00	0.13
265	603505	金石资源	11,300	227,695.00	0.12
266	600750	华润江中	10,300	227,321.00	0.12
267	600801	华新建材	14,500	226,200.00	0.12
268	603305	旭升集团	18,639	225,904.68	0.12
269	600871	石化油服	109,500	222,285.00	0.12
270	600559	老白干酒	19,700	220,640.00	0.12
271	600566	济川药业	9,900	219,681.00	0.12
272	600755	厦门国贸	40,300	218,426.00	0.12
273	688029	南微医学	3,034	217,841.20	0.12
274	600517	国网英大	46,200	216,216.00	0.12
275	600655	豫园股份	52,400	215,364.00	0.12
276	600633	浙数文化	20,500	208,690.00	0.11
277	600598	北大荒	19,100	207,044.00	0.11
278	601598	中国外运	41,647	206,569.12	0.11
279	600216	浙江医药	18,100	206,340.00	0.11
280	600933	爱柯迪	13,900	205,442.00	0.11
281	601136	首创证券	14,700	205,065.00	0.11
282	601222	林洋能源	38,500	204,820.00	0.11
283	603899	晨光股份	9,900	204,237.00	0.11
284	600446	金证股份	20,300	204,218.00	0.11
285	600409	三友化工	33,400	204,074.00	0.11
286	600210	紫江企业	32,700	202,740.00	0.11
287	600350	山东高速	18,200	202,566.00	0.11
288	601966	玲珑轮胎	19,749	201,242.31	0.11
289	600663	陆家嘴	31,800	199,704.00	0.11
290	603927	中科软	15,700	199,547.00	0.11
291	688192	迪哲医药	4,981	198,891.33	0.11
292	600582	天地科技	44,600	198,470.00	0.11
293	600773	西藏城投	15,400	198,198.00	0.11
294	603456	九洲药业	14,400	196,704.00	0.11
295	600258	首旅酒店	18,000	196,560.00	0.11
296	688349	三一重能	12,843	194,956.74	0.11

297	603612	索通发展	10,700	193,991.00	0.11
298	600848	上海临港	25,800	193,242.00	0.11
299	603198	迎驾贡酒	6,500	192,400.00	0.11
300	601098	中南传媒	19,300	189,912.00	0.10
301	603871	嘉友国际	18,400	187,864.00	0.10
302	603233	大参林	12,300	184,869.00	0.10
303	600968	海油发展	54,800	182,484.00	0.10
304	688016	心脉医疗	2,050	181,712.00	0.10
305	601928	凤凰传媒	20,600	181,074.00	0.10
306	688083	中望软件	2,788	180,523.00	0.10
307	688759	必贝特	5,797	177,678.05	0.10
308	600993	马应龙	8,100	175,122.00	0.10
309	601311	骆驼股份	22,100	172,159.00	0.09
310	601808	中海油服	15,900	171,879.00	0.09
311	600295	鄂尔多斯	16,000	171,520.00	0.09
312	600776	东方通信	12,900	169,506.00	0.09
313	600057	厦门象屿	30,600	165,852.00	0.09
314	603712	七一二	12,500	161,125.00	0.09
315	600211	西藏药业	4,300	160,777.00	0.09
316	600292	电投水电	13,000	156,520.00	0.09
317	600377	宁沪高速	13,400	155,038.00	0.09
318	600916	中国黄金	22,600	154,584.00	0.08
319	600399	抚顺特钢	37,200	152,892.00	0.08
320	601298	青岛港	18,900	152,145.00	0.08
321	600507	方大特钢	37,400	151,470.00	0.08
322	601702	华峰铝业	10,720	151,152.00	0.08
323	600012	皖通高速	9,400	148,144.00	0.08
324	603833	欧派家居	4,900	147,539.00	0.08
325	603393	新天然气	6,800	145,588.00	0.08
326	600116	三峡水利	25,700	143,920.00	0.08
327	600328	中盐化工	23,700	142,200.00	0.08
328	603218	日月股份	13,900	142,058.00	0.08
329	600129	太极集团	10,400	141,128.00	0.08
330	600273	嘉化能源	21,200	138,224.00	0.08
331	688139	海尔生物	5,211	137,674.62	0.08
332	600325	华发股份	59,300	136,983.00	0.08
333	600032	浙江新能	19,400	136,770.00	0.08
334	603529	爱玛科技	7,000	136,570.00	0.07
335	688289	圣湘生物	9,476	136,454.40	0.07
336	688050	爱博医疗	3,742	136,395.90	0.07
337	603786	科博达	3,300	135,003.00	0.07
338	603883	老百姓	12,300	134,808.00	0.07
339	603658	安图生物	4,600	133,492.00	0.07
340	600395	盘江股份	28,900	131,784.00	0.07

341	601139	深圳燃气	23,200	131,312.00	0.07
342	603730	岱美股份	11,600	129,572.00	0.07
343	601965	中国汽研	10,800	129,168.00	0.07
344	600782	新钢股份	51,500	127,720.00	0.07
345	688439	振华风光	2,728	126,033.60	0.07
346	603027	千禾味业	17,980	125,320.60	0.07
347	603888	新华网	7,240	123,297.20	0.07
348	688100	威胜信息	3,941	120,555.19	0.07
349	600373	中文传媒	18,100	120,003.00	0.07
350	600720	中交设计	24,700	119,054.00	0.07
351	603583	捷昌驱动	5,200	118,560.00	0.07
352	600866	星湖科技	26,800	117,652.00	0.06
353	603049	中策橡胶	2,600	116,506.00	0.06
354	688475	萤石网络	4,242	116,018.70	0.06
355	603175	超颖电子	1,300	115,817.00	0.06
356	603556	海兴电力	5,200	114,400.00	0.06
357	603317	天味食品	8,600	111,886.00	0.06
358	600422	昆药集团	14,300	111,683.00	0.06
359	688808	联讯仪器	70	110,903.10	0.06
360	601952	苏垦农发	14,800	110,852.00	0.06
361	600729	重百集团	5,900	110,802.00	0.06
362	600740	山西焦化	34,500	110,055.00	0.06
363	688032	禾迈股份	1,300	109,876.00	0.06
364	600612	老凤祥	3,400	109,310.00	0.06
365	601019	山东出版	16,900	108,160.00	0.06
366	600248	陕建股份	40,300	107,601.00	0.06
367	603099	长白山	2,900	103,443.00	0.06
368	603915	国茂股份	7,200	102,168.00	0.06
369	600675	中华企业	48,900	100,734.00	0.06
370	601033	永兴股份	7,300	97,820.00	0.05
371	688818	电科蓝天	1,359	95,320.26	0.05
372	601112	振石股份	5,202	94,511.18	0.05
373	603707	健友股份	13,100	92,617.00	0.05
374	601882	海天精工	4,200	84,966.00	0.05
375	600299	安迪苏	10,800	84,780.00	0.05
376	688819	天能股份	3,760	83,472.00	0.05
377	603025	大豪科技	6,000	81,840.00	0.04
378	603355	莱克电气	3,100	81,778.00	0.04
379	601595	上海电影	4,800	79,680.00	0.04
380	688631	莱斯信息	1,656	77,682.96	0.04
381	600662	外服控股	18,400	74,152.00	0.04
382	601858	中国科传	4,204	72,771.24	0.04
383	605333	沪光股份	3,700	63,085.00	0.03
384	600956	新天绿能	8,300	58,017.00	0.03

385	688820	盛合晶微	403	57,020.47	0.03
386	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.03
387	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.03
388	601022	宁波远洋	7,000	53,340.00	0.03
389	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.02
390	688797	臻宝科技	77	36,087.59	0.02
391	688635	长进光子	102	31,435.38	0.02
392	688781	视涯科技	622	29,613.42	0.02
393	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
394	603459	红板科技	192	16,189.44	0.01
395	688816	易思维	177	10,106.70	0.01
396	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
397	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
398	603293	埃泰克	51	1,730.43	0.00
399	603284	林平发展	46	1,604.02	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	688019	安集科技	11,638,169.97	1.72
2	601231	环旭电子	10,269,385.08	1.51
3	603225	新凤鸣	9,178,944.98	1.35
4	600141	兴发集团	8,444,778.67	1.24
5	688388	嘉元科技	5,519,772.30	0.81
6	688106	金宏气体	4,475,784.87	0.66
7	688498	源杰科技	4,112,577.81	0.61
8	688166	博瑞医药	3,452,540.66	0.51
9	688002	睿创微纳	3,379,346.47	0.50
10	688301	奕瑞科技	2,610,901.09	0.38
11	688347	华虹宏力	2,590,826.59	0.38
12	601016	节能风电	2,533,374.62	0.37
13	688037	芯源微	2,350,467.01	0.35
14	688235	百济神州	1,923,217.78	0.28
15	601137	博威合金	1,808,572.04	0.27
16	600888	新疆众和	1,747,695.57	0.26
17	688361	中科飞测	1,468,723.71	0.22
18	688313	仕佳光子	1,354,855.83	0.20
19	603327	福蓉科技	1,188,714.53	0.18
20	600577	精达股份	1,183,750.08	0.17

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	688019	安集科技	14,311,326.88	2.11
2	601231	环旭电子	10,782,999.16	1.59
3	603225	新凤鸣	8,959,628.60	1.32
4	600141	兴发集团	7,995,649.00	1.18
5	600487	亨通光电	5,668,179.00	0.84
6	688388	嘉元科技	5,065,692.28	0.75
7	688106	金宏气体	4,449,825.60	0.66
8	688525	佰维存储	3,929,845.20	0.58
9	688301	奕瑞科技	3,840,464.50	0.57
10	688166	博瑞医药	3,535,489.88	0.52
11	688027	国盾量子	3,396,216.85	0.50
12	688002	睿创微纳	2,773,456.50	0.41
13	688017	绿的谐波	2,586,171.54	0.38
14	601016	节能风电	2,515,496.73	0.37
15	600079	ST 人福	2,505,614.00	0.37
16	688521	芯原股份	2,450,665.26	0.36
17	688608	恒玄科技	2,374,546.51	0.35
18	688200	华峰测控	2,178,258.51	0.32
19	600549	厦门钨业	2,147,141.00	0.32
20	688617	惠泰医疗	1,948,440.84	0.29

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	145,552,366.55
卖出股票收入（成交）总额	144,553,796.90

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）	143,003.97	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	143,003.97	0.08

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	111025	圣泉转债	540	54,000.59	0.03
2	113704	春风转债	440	44,001.93	0.02
3	118070	南芯转债	310	31,001.23	0.02
4	118071	华峰转债	140	14,000.22	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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海剑桥科技股份有限公司在报告编制日前一年内

曾受到中华人民共和国龙吴海关的处罚。

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	26,790.38
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	87,283.01

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	中国银行股份有限公司 — 易方达上证 380 交易

						型开放式指数证券投资 基金联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
737	204,484.4 0	131,255,675 .00	87.09%	19,449,325. 00	12.91%	116,987,70 7.00	77.63%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含该基金的联接基金“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 9 月 22 日）基金份额总额	426,705,000.00
本报告期初基金份额总额	666,705,000.00
本报告期基金总申购份额	16,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	532,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	150,705,000.00

§ 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，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	5	224,789,239.57	100.00%	22,526.46	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国信证券股份有限公司。本基金管理人与国信证券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 0.01000%、债券 0.00007%。

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
国信证券	64,004,741.98	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	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	中国证券报	2026-03-31

	度报告提示性公告		
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	中国证券报	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	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	2026-05-16
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	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
中国银行股份有限公司—易方达上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2026 年 01 月 01 日 ~2026 年 06 月 30 日	552,200, 207.00	372,658, 000.00	807,870, 500.00	116,987, 707.00	77.63 %
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上证 380 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 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达上证 380 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