

易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年八月三十日

§ 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，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	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	11
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	53
7.12 投资组合报告附注	53

§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金	
基金简称	易方达科鑫量化选股股票发起式	
基金主代码	022754	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 12 月 11 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	20,016,656.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达科鑫量化选股股票发起式 A	易方达科鑫量化选股股票发起式 C
下属分级基金的交易代码	022754	022755
报告期末下属分级基金的份额总额	19,596,561.00 份	420,095.26 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	资产配置方面，本基金将综合考虑宏观与微观经济、市场与政策等因素，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。股票投资方面，本基金以基本面研究为驱动，采用量化选股模型精选优质股票，并结合组合优化方法，力争实现基金资产的长期增值。本基金投资存托凭证的策略依照上述股票投资策略执行。债券投资方面，本基金主要通过类属配置与券种选择两个层次进行债券投资管理。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×80%+中证港股通综合指数收益率×5%+中债总指数收益率×15%
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、债券型基金和货币市场基金。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	400 881 8088	95588
传真	020-38798812	010-66105798
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55 号
办公地址	广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼； 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55 号
邮政编码	510620； 519031	100140
法定代表人	吴欣荣	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 40-43 楼；广东省珠海市横琴新区 荣粤道 188 号 6 层

§ 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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	易方达科鑫量化选股股票发起式 A	易方达科鑫量化选股股票发起式 C
本期已实现收益	1,101,970.39	11,746.23
本期利润	1,918,880.49	8,461.20
加权平均基金份额本期利润	0.1080	0.0181
本期加权平均净值利润率	10.65%	1.78%
本期基金份额净值增长率	11.20%	10.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	易方达科鑫量化选股股票发起式 A	易方达科鑫量化选股股票发起式 C
期末可供分配利润	774,800.52	15,635.45

期末可供分配基金份额利润	0.0395	0.0372
期末基金资产净值	21,049,856.17	450,257.56
期末基金份额净值	1.0742	1.0718
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	易方达科鑫量化选股股票发起式 A	易方达科鑫量化选股股票发起式 C
	基金份额累计净值增长率	7.42% 7.18%

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

易方达科鑫量化选股股票发起式 A

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
过去一个月	6.21%	0.87%	2.58%	0.53%	3.63%	0.34%
过去三个月	5.03%	1.38%	1.30%	1.03%	3.73%	0.35%
过去六个月	11.20%	1.33%	1.54%	0.94%	9.66%	0.39%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	7.42%	1.29%	-0.17%	0.92%	7.59%	0.37%

易方达科鑫量化选股股票发起式 C

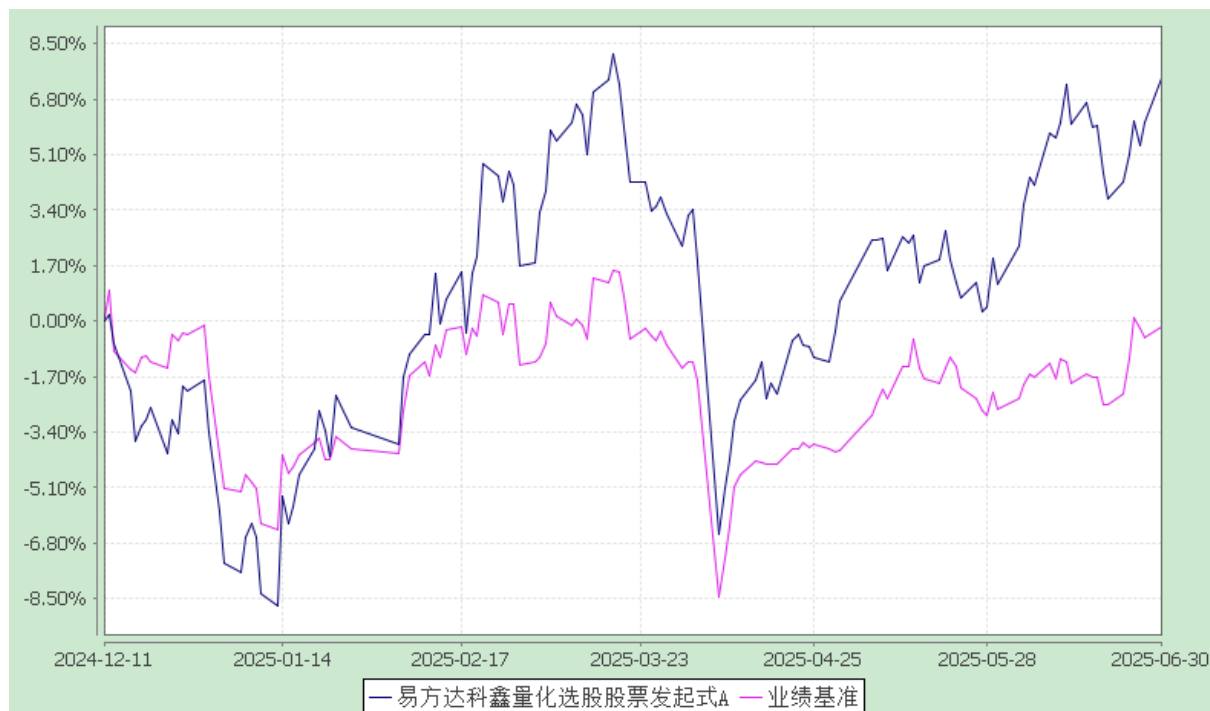
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	6.16%	0.87%	2.58%	0.53%	3.58%	0.34%
过去三个月	4.90%	1.38%	1.30%	1.03%	3.60%	0.35%
过去六个月	10.98%	1.33%	1.54%	0.94%	9.44%	0.39%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	7.18%	1.29%	-0.17%	0.92%	7.35%	0.37%

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

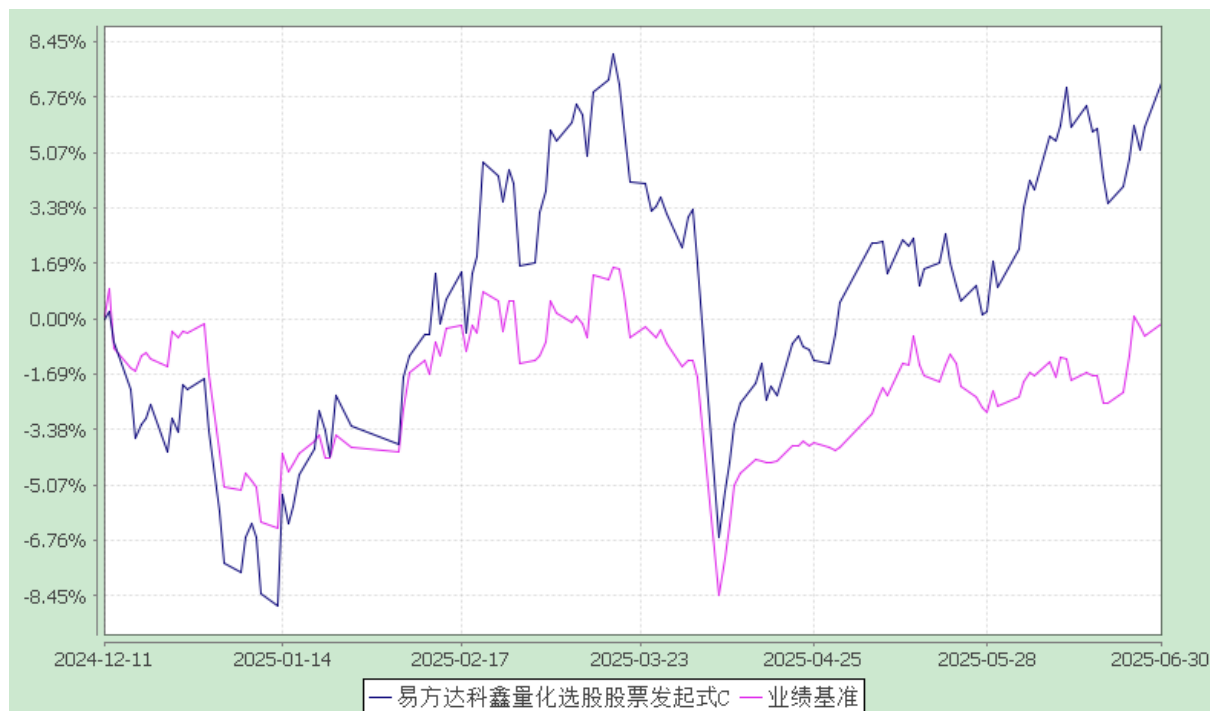
易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024 年 12 月 11 日至 2025 年 6 月 30 日)

易方达科鑫量化选股股票发起式 A



易方达科鑫量化选股股票发起式 C



注：1.本基金合同于 2024 年 12 月 11 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。

3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值增长率为 7.42%，同期业绩比较基准收益率为 -0.17%；C 类基金份额净值增长率为 7.18%，同期业绩比较基准收益率为-0.17%。

§ 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、投资顾问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		
包正钰	本基金的基金经理，易方达价值精选混合、易方达红利混合、易方达科智量化选股股票发起式的基金经理，研究部总经理助理、行业研究员	2024-12-11	-	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 38 次，其中 31 次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，7 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

2025 年上半年，全球风险资产在关税扰动与流动性宽松交织的背景下呈现“先抑后扬”。A 股宽基指数整体收涨，上证指数上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，创业板指依托人工智能、创新药等攀升，上涨 0.53%。全市场成交额超万亿元，但量能主要集中于科技成长板块。

风格因子方面，成长因子持续走强，银行、公用事业等板块凭借 6%–7% 以上的股息率吸引险资与外资持续加码；与此同时，AI 算力、半导体设备等硬科技龙头获机构追逐，而缺乏基本面支撑的纯概念股估值则收缩，成长因子内部分化显著。

报告期内，本基金继续以“基本面研究+主动量化”双轮驱动获取 alpha。基本面层面，我们围绕成长能力、盈利质量、运营效率与财务结构四大维度筛选个股；量化层面，则将市场关注度、波动率、历史收益率及情绪指标纳入打分模型，对候选池进行动态排序与权重优化。风格暴露保持在中性略偏成长区间，量化选股与基本面研究形成良性互补，努力为份额持有人贡献超额收益。

在风险管理上，本基金持续运用多因子风险估测模型，对行业集中度、单一因子暴露及极端行情冲击进行实时监控，确保回撤处于可控范围。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0742 元，本报告期份额净值增长率为 11.20%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%；C 类基金份额净值为 1.0718 元，本报告期份额净值增长率为

10.98%，同期业绩比较基准收益率为 1.54%。

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 2025 年下半年，外部关税谈判有望继续缓和，国内“稳增长”政策窗口仍在。我们判断，金融条件保持宽松的同时，产业政策将更多向先进制造与自主创新倾斜，高股息与硬科技“哑铃型”格局大概率延续。本基金将持续挖掘 alpha 信号，并控制风险，力争在复杂环境中持续为投资者创造有竞争力的超额回报。

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

易方达科鑫量化选股股票发起式 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达科鑫量化选股股票发起式 C: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

本基金为发起式基金且发起资金持有期限不满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“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”的披露规定。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,178,242.77	1,038,285.23
结算备付金		128,626.45	-
存出保证金		13,256.08	-
交易性金融资产	6.4.7.2	19,830,861.41	12,707,833.54
其中：股票投资		19,830,861.41	12,707,833.54
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		633,063.97	127,547.87
应收股利		-	-
应收申购款		100,218.45	24,232.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		21,884,269.13	13,897,899.07
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		229,774.01	233,106.37
应付赎回款		105,428.70	-
应付管理人报酬		20,608.38	9,053.04
应付托管费		1,717.36	754.41
应付销售服务费		161.10	3.65
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	26,465.85	5,020.60
负债合计		384,155.40	247,938.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	20,016,656.26	14,130,436.36
未分配利润	6.4.7.8	1,483,457.47	-480,475.36
净资产合计		21,500,113.73	13,649,961.00
负债和净资产总计		21,884,269.13	13,897,899.07

注：1.本基金合同生效日为 2024 年 12 月 11 日，2024 年度实际报告期间为 2024 年 12 月 11 日至 2024 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2025 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0742 元，C 类基金份额净值 1.0718 元；基金份额总额 20,016,656.26 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 19,596,561.00 份，C 类基金份额总额 420,095.26 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,046,814.69
1.利息收入		2,456.81
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,456.81
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）		1,229,911.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,091,520.75
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-6,828.17
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	145,219.36
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	813,625.07
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	820.87
减：二、营业总支出		119,473.00
1. 管理人报酬		109,203.26
2. 托管费		9,100.27
3. 销售服务费		924.60
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	244.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,927,341.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,927,341.69
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,927,341.69

注：本基金合同生效日为 2024 年 12 月 11 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：易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	14,130,436.36	-480,475.36	13,649,961.00
二、本期期初净资产	14,130,436.36	-480,475.36	13,649,961.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,886,219.90	1,963,932.83	7,850,152.73
（一）、综合收益总额	-	1,927,341.69	1,927,341.69
（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）	5,886,219.90	36,591.14	5,922,811.04
其中：1.基金申购款	6,440,436.53	52,800.49	6,493,237.02
2.基金赎回款	-554,216.63	-16,209.35	-570,425.98
（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	20,016,656.26	1,483,457.47	21,500,113.73

注：本基金合同生效日为 2024 年 12 月 11 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

易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金(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]1687 号《关于准予易方达科鑫量化选股股票型发起式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《易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会

备案,《易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 12 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 14,105,744.27 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》《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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、

以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值

技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资

产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（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；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,178,242.77
等于：本金	1,178,122.83
加：应计利息	119.94
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	1,178,242.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		19,246,063.27	-	19,830,861.41	584,798.14
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		19,246,063.27	-	19,830,861.41	584,798.14

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	140.63
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	26,325.22
其中：交易所市场	26,325.22
银行间市场	-
应付利息	-
合计	26,465.85

6.4.7.7 实收基金

易方达科鑫量化选股股票发起式 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,089,666.03	14,089,666.03
本期申购	5,687,090.79	5,687,090.79
本期赎回（以“-”号填列）	-180,195.82	-180,195.82
本期末	19,596,561.00	19,596,561.00

易方达科鑫量化选股股票发起式 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,770.33	40,770.33
本期申购	753,345.74	753,345.74
本期赎回（以“-”号填列）	-374,020.81	-374,020.81
本期末	420,095.26	420,095.26

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

易方达科鑫量化选股股票发起式 A

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	-250,856.25	-228,223.42	-479,079.67
本期期初	-250,856.25	-228,223.42	-479,079.67
本期利润	1,101,970.39	816,910.10	1,918,880.49
本期基金份额交易产生的变动数	-76,313.62	89,807.97	13,494.35
其中：基金申购款	-72,770.95	90,359.21	17,588.26
基金赎回款	-3,542.67	-551.24	-4,093.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	774,800.52	678,494.65	1,453,295.17

易方达科鑫量化选股股票发起式 C

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	-735.32	-660.37	-1,395.69
本期期初	-735.32	-660.37	-1,395.69
本期利润	11,746.23	-3,285.03	8,461.20
本期基金份额交易产生的变动数	4,624.54	18,472.25	23,096.79
其中：基金申购款	5,958.31	29,253.92	35,212.23
基金赎回款	-1,333.77	-10,781.67	-12,115.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,635.45	14,526.85	30,162.30

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,184.39
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	230.30
其他	42.12
合计	2,456.81

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,091,520.75
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	1,091,520.75

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	110,482,689.41
减：卖出股票成本总额	109,275,989.37
减：交易费用	115,179.29
买卖股票差价收入	1,091,520.75

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,829.23
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	-6,828.17

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	89,307.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	96,114.77
减：应计利息总额	15.03
减：交易费用	7.30
买卖债券差价收入	-6,829.23

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	145,219.36
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	145,219.36

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	813,625.07
——股票投资	813,625.07
——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	813,625.07
----	------------

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	820.87
合计	820.87

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
存托服务费	3.87
银行汇划费	241.00
合计	244.87

注：本报告期内，基金管理人自主承担本基金的审计费 2,479.45 元、银行间账户维护及查询费 4,500.00 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、注册登记机构、基金销售机构、基金发起人
中国工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

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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	997,110.50	0.44%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	363.97	0.80%	270.08	1.03%

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.本基金佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务及研究服务。

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
----	----

	2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	109,203.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	-
应支付基金管理人的净管理费	109,203.26

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

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，自动在次月初 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,100.27

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，自动在次月初 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达科鑫量化选股股票发起式A	易方达科鑫量化选股股票发起式C	合计
易方达基金管理有限公司	-	924.60	924.60
合计	-	924.60	924.60

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，按

前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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，自动在次月初 3 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 2025年1月1日至2025年6月30日	
	易方达科鑫量化选股股票发起 式 A	易方达科鑫量化选股股票发起 式 C
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.0294%	-

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

易方达科鑫量化选股股票发起式 A

无。

易方达科鑫量化选股股票发起式 C

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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	1,178,242.77	2,184.39

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工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审计费 2,479.45 元、银行间账户维护及查询费 4,500.00 元。

6.4.11 利润分配情况

易方达科鑫量化选股股票发起式 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达科鑫量化选股股票发起式 C

本报告期内未发生利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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 2025 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 2025 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、债券型基金和货币市场基金。

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险详见招募说明书。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 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、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%(2024 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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025年6月30日	上年度末 2024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 2025 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，组合变现比例能力较好。

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 2025 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	1,178,242.77	-	-	-	1,178,242.77
结算备付金	128,626.45	-	-	-	128,626.45
存出保证金	13,256.08	-	-	-	13,256.08
交易性金融资产	-	-	-	19,830,861.41	19,830,861.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	633,063.97	633,063.97
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	100,218.45	100,218.45
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	1,320,125.30	-	-	20,564,143.83	21,884,269.13
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	-	-	-	229,774.01	229,774.01
应付赎回款	-	-	-	105,428.70	105,428.70
应付管理人报酬	-	-	-	20,608.38	20,608.38
应付托管费	-	-	-	1,717.36	1,717.36
应付销售服务费	-	-	-	161.10	161.10
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	-	-	-	26,465.85	26,465.85
负债总计	-	-	-	384,155.40	384,155.40
利率敏感度缺口	1,320,125.30	-	-	20,179,988.43	21,500,113.73
上年度末					
2024 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	1,038,285.23	-	-	-	1,038,285.23
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	12,707,833.54	12,707,833.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	127,547.87	127,547.87
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	24,232.43	24,232.43
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,038,285.23	-	-	12,859,613.84	13,897,899.07
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	-	-	-	233,106.37	233,106.37
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	9,053.04	9,053.04
应付托管费	-	-	-	754.41	754.41
应付销售服务费	-	-	-	3.65	3.65
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	-	-	-	5,020.60	5,020.60
负债总计	-	-	-	247,938.07	247,938.07
利率敏感度缺口	1,038,285.23	-	-	12,611,675.77	13,649,961.00

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		上年度末	
	2025 年 6 月 30 日		2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	19,830,861.41	92.24	12,707,833.54	93.10
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	19,830,861.41	92.24	12,707,833.54	93.10

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	1,462,739.61	872,463.36
	2.业绩比较基准下降 5%	-1,462,739.61	-872,463.36

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 2025 年 6 月 30 日
第一层次	19,830,861.41
第二层次	-
第三层次	-
合计	19,830,861.41

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基

金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	19,830,861.41	90.62
	其中：股票	19,830,861.41	90.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,306,869.22	5.97
8	其他各项资产	746,538.50	3.41
9	合计	21,884,269.13	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	685,860.00	3.19
C	制造业	12,987,105.50	60.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,058,848.00	4.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	730,327.00	3.40
G	交通运输、仓储和邮政业	348,412.00	1.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,476,009.91	6.87
J	金融业	2,241,843.00	10.43
K	房地产业	24,256.00	0.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	278,200.00	1.29
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	19,830,861.41	92.24

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	600919	江苏银行	58,500	698,490.00	3.25
2	002648	卫星化学	39,900	691,467.00	3.22
3	300308	中际旭创	4,100	598,026.00	2.78
4	688521	芯原股份	5,852	564,718.00	2.63
5	002025	航天电器	10,500	539,805.00	2.51
6	002245	蔚蓝锂芯	40,300	517,049.00	2.40

7	601899	紫金矿业	25,800	503,100.00	2.34
8	002756	永兴材料	15,500	492,125.00	2.29
9	000690	宝新能源	90,600	412,230.00	1.92
10	002384	东山精密	10,900	411,693.00	1.91
11	000729	燕京啤酒	30,600	395,658.00	1.84
12	600066	宇通客车	15,900	395,274.00	1.84
13	300940	南极光	15,400	388,850.00	1.81
14	600060	海信视像	16,800	386,736.00	1.80
15	002170	芭田股份	37,600	385,400.00	1.79
16	002850	科达利	3,400	384,778.00	1.79
17	301200	大族数控	9,000	382,230.00	1.78
18	300475	香农芯创	10,500	374,115.00	1.74
19	600000	浦发银行	26,100	362,268.00	1.68
20	002727	一心堂	21,800	356,212.00	1.66
21	688258	卓易信息	7,247	350,972.21	1.63
22	002916	深南电路	3,250	350,382.50	1.63
23	688668	鼎通科技	4,683	292,500.18	1.36
24	300570	太辰光	2,900	279,502.00	1.30
25	603259	药明康德	4,000	278,200.00	1.29
26	002484	江海股份	13,400	274,566.00	1.28
27	300618	寒锐钴业	7,600	271,472.00	1.26
28	301018	申菱环境	7,100	269,374.00	1.25
29	002777	久远银海	14,500	264,770.00	1.23
30	300059	东方财富	11,300	261,369.00	1.22
31	600623	华谊集团	34,500	261,165.00	1.21
32	000568	泸州老窖	2,300	260,820.00	1.21
33	603019	中科曙光	3,700	260,480.00	1.21
34	688068	热景生物	1,843	258,278.02	1.20
35	300604	长川科技	5,700	255,987.00	1.19
36	688256	寒武纪	423	254,434.50	1.18
37	000528	柳工	26,200	251,782.00	1.17
38	000686	东北证券	32,600	248,738.00	1.16
39	688331	荣昌生物	4,017	243,028.50	1.13
40	603129	春风动力	1,100	238,150.00	1.11
41	002821	凯莱英	2,500	220,625.00	1.03
42	601975	招商南油	74,500	217,540.00	1.01
43	601336	新华保险	3,700	216,450.00	1.01
44	600398	海澜之家	29,500	205,320.00	0.95
45	301219	腾远钴业	3,800	201,856.00	0.94
46	603194	中力股份	4,300	195,177.00	0.91
47	603809	豪能股份	12,300	188,190.00	0.88
48	600882	妙可蓝多	6,100	186,233.00	0.87
49	002226	江南化工	31,900	185,020.00	0.86

50	600369	西南证券	41,500	180,525.00	0.84
51	600259	广晟有色	3,300	175,296.00	0.82
52	603799	华友钴业	4,200	155,484.00	0.72
53	300548	博创科技	2,300	153,571.00	0.71
54	600879	航天电子	13,400	140,298.00	0.65
55	601615	明阳智能	12,200	140,178.00	0.65
56	002956	西麦食品	5,800	136,126.00	0.63
57	688208	道通科技	4,285	131,121.00	0.61
58	600650	锦江在线	8,400	130,872.00	0.61
59	600874	创业环保	21,800	130,146.00	0.61
60	688180	君实生物	3,830	130,143.40	0.61
61	603689	皖天然气	15,400	129,668.00	0.60
62	001389	广合科技	2,200	129,294.00	0.60
63	601158	重庆水务	27,800	128,992.00	0.60
64	600167	联美控股	22,700	127,574.00	0.59
65	002911	佛燃能源	12,400	127,224.00	0.59
66	300502	新易盛	1,000	127,020.00	0.59
67	300476	胜宏科技	900	120,942.00	0.56
68	002673	西部证券	14,500	114,260.00	0.53
69	688425	铁建重工	27,721	113,101.68	0.53
70	002463	沪电股份	2,500	106,450.00	0.50
71	600161	天坛生物	4,400	84,436.00	0.39
72	688379	华光新材	2,073	71,850.18	0.33
73	000750	国海证券	13,900	57,268.00	0.27
74	601099	太平洋	14,200	55,806.00	0.26
75	688205	德科立	816	51,155.04	0.24
76	601901	方正证券	5,900	46,669.00	0.22
77	600761	安徽合力	1,700	30,158.00	0.14
78	300010	豆神教育	3,600	29,844.00	0.14
79	600383	金地集团	6,400	24,256.00	0.11
80	600988	赤峰黄金	300	7,464.00	0.03
81	300130	新国都	200	7,106.00	0.03
82	003010	若羽臣	100	6,060.00	0.03
83	002409	雅克科技	100	5,469.00	0.03
84	301393	昊帆生物	100	5,356.00	0.02
85	601689	拓普集团	100	4,725.00	0.02
86	300842	帝科股份	100	4,383.00	0.02
87	603228	景旺电子	100	4,184.00	0.02
88	300378	鼎捷数智	100	3,660.00	0.02
89	603529	爱玛科技	100	3,440.00	0.02
90	600900	长江电力	100	3,014.00	0.01
91	000921	海信家电	100	2,570.00	0.01
92	601567	三星医疗	100	2,242.00	0.01

93	300515	三德科技	100	2,235.00	0.01
94	603599	广信股份	200	2,134.00	0.01
95	601608	中信重工	400	1,748.00	0.01
96	002602	ST 华通	140	1,551.20	0.01
97	000657	中钨高新	100	1,186.00	0.01

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	000729	燕京啤酒	1,225,168.00	8.98
2	300033	同花顺	1,130,192.00	8.28
3	688068	热景生物	1,070,422.04	7.84
4	603766	隆鑫通用	996,457.00	7.30
5	600323	瀚蓝环境	973,613.43	7.13
6	300765	新诺威	968,363.00	7.09
7	600919	江苏银行	958,708.00	7.02
8	002648	卫星化学	947,687.00	6.94
9	603127	昭衍新药	894,045.20	6.55
10	600060	海信视像	854,725.00	6.26
11	002384	东山精密	846,176.00	6.20
12	603228	景旺电子	824,872.00	6.04
13	688136	科兴制药	804,436.47	5.89
14	300475	香农芯创	793,139.00	5.81
15	002821	凯莱英	789,904.00	5.79
16	688521	芯原股份	757,209.40	5.55
17	002850	科达利	752,784.00	5.51
18	002847	盐津铺子	741,143.00	5.43
19	000921	海信家电	728,009.00	5.33
20	688717	艾罗能源	679,318.58	4.98
21	601872	招商轮船	668,541.00	4.90
22	300253	卫宁健康	662,335.00	4.85
23	688498	源杰科技	658,565.90	4.82
24	688258	卓易信息	657,151.85	4.81
25	600161	天坛生物	645,623.00	4.73
26	688073	毕得医药	640,283.50	4.69
27	600415	小商品城	637,560.00	4.67
28	300570	太辰光	636,893.00	4.67
29	002602	ST 华通	634,414.20	4.65
30	600383	金地集团	632,882.00	4.64
31	300783	三只松鼠	632,129.00	4.63
32	300010	豆神教育	613,003.00	4.49

33	002916	深南电路	608,986.30	4.46
34	000858	五粮液	589,763.00	4.32
35	300308	中际旭创	587,796.00	4.31
36	000403	派林生物	582,428.00	4.27
37	600489	中金黄金	578,830.00	4.24
38	601336	新华保险	576,486.00	4.22
39	603129	春风动力	564,250.00	4.13
40	300432	富临精工	563,968.00	4.13
41	688331	荣昌生物	562,909.14	4.12
42	688668	鼎通科技	562,871.32	4.12
43	300014	亿纬锂能	557,268.00	4.08
44	600176	中国巨石	530,902.00	3.89
45	300842	帝科股份	529,351.00	3.88
46	688235	百济神州	526,383.20	3.86
47	002245	蔚蓝锂芯	525,978.00	3.85
48	000680	山推股份	525,616.00	3.85
49	002025	航天电器	514,540.00	3.77
50	688052	纳芯微	508,396.17	3.72
51	688029	南微医学	504,672.78	3.70
52	688408	中信博	502,440.69	3.68
53	603799	华友钴业	502,355.00	3.68
54	002558	巨人网络	501,568.00	3.67
55	002294	信立泰	501,346.60	3.67
56	000568	泸州老窖	498,645.00	3.65
57	600131	国网信通	492,941.00	3.61
58	300682	朗新集团	492,924.00	3.61
59	600729	重庆百货	491,814.00	3.60
60	001309	德明利	486,943.00	3.57
61	601033	永兴股份	486,089.96	3.56
62	688008	澜起科技	483,425.50	3.54
63	601899	紫金矿业	482,525.00	3.53
64	002756	永兴材料	481,641.00	3.53
65	601229	上海银行	480,991.00	3.52
66	600312	平高电气	480,109.00	3.52
67	002475	立讯精密	474,614.00	3.48
68	600036	招商银行	472,738.00	3.46
69	002034	旺能环境	468,107.00	3.43
70	003010	若羽臣	453,191.00	3.32
71	688428	诺诚健华	448,984.74	3.29
72	300628	亿联网络	445,965.00	3.27
73	688536	思瑞浦	439,779.01	3.22
74	603383	顶点软件	438,144.00	3.21
75	600577	精达股份	437,259.00	3.20

76	002926	华西证券	436,123.00	3.20
77	600699	均胜电子	436,111.00	3.19
78	301393	昊帆生物	424,721.00	3.11
79	301358	湖南裕能	420,229.00	3.08
80	603341	龙旗科技	415,758.00	3.05
81	688519	南亚新材	403,388.96	2.96
82	000528	柳工	394,881.00	2.89
83	000831	中国稀土	394,012.00	2.89
84	300435	中泰股份	391,449.00	2.87
85	000690	宝新能源	390,228.00	2.86
86	600066	宇通客车	389,118.00	2.85
87	002727	一心堂	386,827.00	2.83
88	600590	泰豪科技	386,480.00	2.83
89	301200	大族数控	384,045.02	2.81
90	002956	西麦食品	383,227.00	2.81
91	002170	芭田股份	380,911.00	2.79
92	300940	南极光	380,813.00	2.79
93	603259	药明康德	380,178.00	2.79
94	000686	东北证券	377,221.00	2.76
95	002139	拓邦股份	375,719.00	2.75
96	688131	皓元医药	375,423.25	2.75
97	600480	凌云股份	373,598.00	2.74
98	001301	尚太科技	370,753.00	2.72
99	688778	厦钨新能	370,748.51	2.72
100	688768	容知日新	369,870.59	2.71
101	600406	国电南瑞	369,672.00	2.71
102	300633	开立医疗	369,618.00	2.71
103	689009	九号公司	369,407.64	2.71
104	601567	三星医疗	369,280.00	2.71
105	605376	博迁新材	366,838.00	2.69
106	688369	致远互联	366,148.43	2.68
107	603529	爱玛科技	365,987.00	2.68
108	002352	顺丰控股	365,773.00	2.68
109	000951	中国重汽	364,643.00	2.67
110	002597	金禾实业	363,771.00	2.66
111	600426	华鲁恒升	361,551.00	2.65
112	002463	沪电股份	361,114.00	2.65
113	688179	阿拉丁	360,640.75	2.64
114	603109	神驰机电	359,452.00	2.63
115	600031	三一重工	357,525.00	2.62
116	600398	海澜之家	357,065.00	2.62
117	603986	兆易创新	356,275.00	2.61
118	603605	珀莱雅	355,554.00	2.60

119	601127	赛力斯	355,281.00	2.60
120	688246	嘉和美康	354,144.83	2.59
121	300548	博创科技	353,999.00	2.59
122	000672	上峰水泥	351,365.00	2.57
123	300476	胜宏科技	350,099.00	2.56
124	600000	浦发银行	347,725.00	2.55
125	000928	中钢国际	347,043.00	2.54
126	300760	迈瑞医疗	346,331.00	2.54
127	603108	润达医疗	346,255.00	2.54
128	002223	鱼跃医疗	346,193.00	2.54
129	688133	泰坦科技	343,962.62	2.52
130	688486	龙迅股份	342,804.07	2.51
131	601126	四方股份	340,454.00	2.49
132	000423	东阿阿胶	339,906.00	2.49
133	601939	建设银行	335,350.00	2.46
134	002064	华峰化学	331,192.00	2.43
135	605166	聚合顺	323,239.00	2.37
136	000157	中联重科	320,167.00	2.35
137	000400	许继电气	312,590.00	2.29
138	601003	柳钢股份	309,879.00	2.27
139	688160	步科股份	308,948.39	2.26
140	300394	天孚通信	307,366.00	2.25
141	300803	指南针	307,062.00	2.25
142	300638	广和通	306,111.00	2.24
143	301219	腾远钴业	305,894.00	2.24
144	603194	中力股份	305,413.00	2.24
145	301421	波长光电	303,949.00	2.23
146	301205	联特科技	303,940.00	2.23
147	301517	陕西华达	303,331.00	2.22
148	603606	东方电缆	303,033.80	2.22
149	603533	掌阅科技	301,439.00	2.21
150	300680	隆盛科技	300,665.48	2.20
151	002865	钧达股份	299,991.00	2.20
152	300857	协创数据	299,917.00	2.20
153	002979	雷赛智能	298,988.00	2.19
154	688625	呈和科技	298,959.65	2.19
155	688195	腾景科技	297,087.32	2.18
156	300378	鼎捷数智	296,403.00	2.17
157	603599	广信股份	296,325.00	2.17
158	002657	中科金财	294,949.00	2.16
159	001283	豪鹏科技	286,384.00	2.10
160	600581	八一钢铁	286,231.00	2.10
161	600184	光电股份	285,896.00	2.09

162	002469	三维化学	285,284.00	2.09
163	688591	泰凌微	284,876.48	2.09
164	000519	中兵红箭	283,644.00	2.08
165	603855	华荣股份	282,725.00	2.07
166	688289	圣湘生物	281,041.38	2.06
167	688050	爱博医疗	280,894.08	2.06
168	002456	欧菲光	280,687.00	2.06
169	603100	川仪股份	280,402.00	2.05
170	601607	上海医药	279,982.00	2.05
171	002459	晶澳科技	279,870.00	2.05
172	002714	牧原股份	279,251.00	2.05
173	600732	爱旭股份	279,250.00	2.05
174	300685	艾德生物	278,892.00	2.04
175	300735	光弘科技	278,440.00	2.04
176	300533	冰川网络	273,977.00	2.01

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	300765	新诺威	1,359,908.00	9.96
2	001309	德明利	1,083,376.00	7.94
3	688068	热景生物	1,043,137.65	7.64
4	300033	同花顺	1,040,058.00	7.62
5	603766	隆鑫通用	1,007,442.00	7.38
6	600323	瀚蓝环境	968,189.00	7.09
7	603127	昭衍新药	917,993.00	6.73
8	688136	科兴制药	900,819.43	6.60
9	603228	景旺电子	875,518.00	6.41
10	000729	燕京啤酒	860,315.00	6.30
11	600312	平高电气	852,954.00	6.25
12	600919	江苏银行	758,104.00	5.55
13	002847	盐津铺子	747,385.00	5.48
14	600415	小商品城	721,135.00	5.28
15	000921	海信家电	687,736.00	5.04
16	601872	招商轮船	675,127.00	4.95
17	002602	ST 华通	658,670.00	4.83
18	300432	富临精工	653,193.00	4.79
19	688073	毕得医药	623,931.52	4.57
20	300253	卫宁健康	618,095.00	4.53
21	688717	艾罗能源	616,934.81	4.52
22	001301	尚太科技	611,495.00	4.48

23	688498	源杰科技	609,782.11	4.47
24	300783	三只松鼠	608,789.00	4.46
25	601939	建设银行	601,707.00	4.41
26	000858	五粮液	600,766.00	4.40
27	300014	亿纬锂能	600,739.00	4.40
28	002294	信立泰	599,885.00	4.39
29	600489	中金黄金	586,570.00	4.30
30	002926	华西证券	580,006.00	4.25
31	688179	阿拉丁	563,100.07	4.13
32	600383	金地集团	557,060.00	4.08
33	688235	百济神州	554,931.80	4.07
34	003010	若羽臣	548,899.00	4.02
35	000403	派林生物	539,206.00	3.95
36	300010	豆神教育	537,046.00	3.93
37	688052	纳芯微	534,659.26	3.92
38	600729	重庆百货	534,474.00	3.92
39	688536	思瑞浦	534,136.01	3.91
40	000680	山推股份	529,791.00	3.88
41	600176	中国巨石	529,670.00	3.88
42	601229	上海银行	524,240.00	3.84
43	600161	天坛生物	519,377.00	3.80
44	688029	南微医学	516,651.43	3.79
45	002821	凯莱英	513,866.00	3.76
46	002558	巨人网络	509,910.00	3.74
47	688008	澜起科技	506,839.72	3.71
48	600060	海信视像	504,443.00	3.70
49	688519	南亚新材	503,066.42	3.69
50	603501	豪威集团	498,025.00	3.65
51	600036	招商银行	492,896.00	3.61
52	300842	帝科股份	480,892.00	3.52
53	600577	精达股份	476,795.00	3.49
54	601033	永兴股份	476,225.00	3.49
55	000063	中兴通讯	474,131.00	3.47
56	002034	旺能环境	463,845.00	3.40
57	600590	泰豪科技	460,478.00	3.37
58	600901	江苏金租	460,362.00	3.37
59	301393	昊帆生物	451,408.00	3.31
60	600699	均胜电子	449,101.00	3.29
61	600131	国网信通	445,416.00	3.26
62	301358	湖南裕能	438,303.00	3.21
63	603383	顶点软件	436,881.00	3.20
64	688428	诺诚健华	436,714.89	3.20
65	300682	朗新集团	433,308.00	3.17

66	600592	龙溪股份	423,050.00	3.10
67	688131	皓元医药	423,024.94	3.10
68	000831	中国稀土	420,050.00	3.08
69	002384	东山精密	420,018.00	3.08
70	600480	凌云股份	412,807.00	3.02
71	600143	金发科技	410,243.00	3.01
72	688778	厦钨新能	404,716.73	2.96
73	300475	香农芯创	403,029.00	2.95
74	002352	顺丰控股	401,304.00	2.94
75	300435	中泰股份	399,959.00	2.93
76	603341	龙旗科技	395,820.00	2.90
77	688408	中信博	395,351.83	2.90
78	688139	海尔生物	393,685.57	2.88
79	603799	华友钴业	387,879.00	2.84
80	603236	移远通信	383,896.00	2.81
81	605376	博迁新材	383,123.00	2.81
82	688768	容知日新	382,466.03	2.80
83	600406	国电南瑞	381,667.00	2.80
84	603129	春风动力	380,144.00	2.78
85	603605	珀莱雅	379,043.00	2.78
86	000928	中钢国际	376,518.00	2.76
87	300394	天孚通信	374,666.00	2.74
88	300207	欣旺达	374,518.00	2.74
89	300633	开立医疗	371,695.00	2.72
90	000672	上峰水泥	370,323.80	2.71
91	002916	深南电路	370,079.00	2.71
92	601126	四方股份	368,008.00	2.70
93	300570	太辰光	367,865.00	2.69
94	300628	亿联网络	363,473.00	2.66
95	688486	龙迅股份	362,562.59	2.66
96	002475	立讯精密	360,548.00	2.64
97	002139	拓邦股份	358,773.00	2.63
98	603986	兆易创新	356,315.00	2.61
99	601127	赛力斯	356,149.00	2.61
100	000951	中国重汽	355,767.00	2.61
101	600426	华鲁恒升	351,556.00	2.58
102	002850	科达利	349,450.00	2.56
103	688369	致远互联	349,141.29	2.56
104	600184	光电股份	348,348.00	2.55
105	603529	爱玛科技	343,627.00	2.52
106	601567	三星医疗	340,694.00	2.50
107	688246	嘉和美康	340,441.71	2.49
108	603108	润达医疗	340,257.00	2.49

109	600031	三一重工	338,301.00	2.48
110	601098	中南传媒	337,938.00	2.48
111	688331	荣昌生物	335,643.73	2.46
112	300476	胜宏科技	334,093.00	2.45
113	601298	青岛港	333,333.00	2.44
114	002223	鱼跃医疗	331,386.00	2.43
115	300857	协创数据	330,224.00	2.42
116	689009	九号公司	329,276.72	2.41
117	688195	腾景科技	328,166.74	2.40
118	601689	拓普集团	327,874.00	2.40
119	688289	圣湘生物	327,803.55	2.40
120	601336	新华保险	327,117.00	2.40
121	002881	美格智能	326,663.00	2.39
122	603606	东方电缆	325,967.00	2.39
123	002597	金禾实业	323,524.00	2.37
124	301517	陕西华达	323,002.00	2.37
125	002064	华峰化学	322,419.00	2.36
126	601857	中国石油	321,628.00	2.36
127	301205	联特科技	321,547.00	2.36
128	002891	中宠股份	321,461.00	2.36
129	000400	许继电气	319,950.00	2.34
130	301421	波长光电	319,055.00	2.34
131	000519	中兵红箭	319,001.00	2.34
132	000423	东阿阿胶	315,269.00	2.31
133	603855	华荣股份	315,145.00	2.31
134	301498	乖宝宠物	313,004.00	2.29
135	601003	柳钢股份	312,135.00	2.29
136	688041	海光信息	309,632.36	2.27
137	688258	卓易信息	309,079.45	2.26
138	002865	钧达股份	308,164.00	2.26
139	688153	唯捷创芯	307,651.92	2.25
140	000157	中联重科	305,404.00	2.24
141	300760	迈瑞医疗	303,837.00	2.23
142	002657	中科金财	303,299.00	2.22
143	300685	艾德生物	301,940.00	2.21
144	001270	*ST 铖昌	301,654.51	2.21
145	002463	沪电股份	301,621.00	2.21
146	300803	指南针	301,384.25	2.21
147	605166	聚合顺	299,159.00	2.19
148	300515	三德科技	298,908.00	2.19
149	688133	泰坦科技	296,586.24	2.17
150	600316	洪都航空	294,961.00	2.16
151	688337	普源精电	294,953.89	2.16

152	688160	步科股份	292,906.54	2.15
153	600732	爱旭股份	291,349.00	2.13
154	300378	鼎捷数智	290,069.00	2.13
155	002867	周大生	289,187.00	2.12
156	300638	广和通	288,092.00	2.11
157	002456	欧菲光	288,078.00	2.11
158	300972	万辰集团	287,699.00	2.11
159	002315	焦点科技	284,834.00	2.09
160	603109	神驰机电	284,732.00	2.09
161	002979	雷赛智能	284,250.00	2.08
162	600612	老凤祥	282,027.00	2.07
163	002956	西麦食品	281,140.00	2.06
164	603533	掌阅科技	281,119.00	2.06
165	002991	甘源食品	281,114.00	2.06
166	002714	牧原股份	280,426.00	2.05
167	000657	中钨高新	274,192.00	2.01

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	115,585,392.17
卖出股票收入（成交）总额	110,482,689.41

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

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，苏州东山精密制造股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到苏州市吴中区消防救援大队的处罚。紫金矿业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到福建省上杭县住房和城乡建设局的处罚。

本基金对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规定的备选股票库。

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	13,256.08
2	应收清算款	633,063.97
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	100,218.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	746,538.50

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

份额级别	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
易方达科鑫量化选股股票发起式 A	34	576,369.44	10,000,000.00	51.03%	9,596,561.00	48.97%
易方达科鑫量化选股股票发起式 C	17	24,711.49	0.00	0.00%	420,095.26	100.00%
合计	51	392,483.46	10,000,000.00	49.96%	10,016,656.26	50.04%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	易方达科鑫量化选股股票发起式 A	4,909,669.27	25.0537%
	易方达科鑫量化选股股票发起式 C	53,791.00	12.8045%
	合计	4,963,460.27	24.7967%

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	份额级别	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	易方达科鑫量化选股股票发起式 A	>100
	易方达科鑫量化选股股票发起式 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达科鑫量化选股股票发起式 A	>100
	易方达科鑫量化选股股票发起式 C	0
	合计	>100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	49.9584%	10,000,000.00	49.9584%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	49.9584%	10,000,000.00	49.9584%	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达科鑫量化选股股票发起式 A	易方达科鑫量化选股股票发起式 C
基金合同生效日（2024 年 12 月 11 日）基金份额总额	14,088,644.27	17,100.00
本报告期期初基金份额总额	14,089,666.03	40,770.33
本报告期基金总申购份额	5,687,090.79	753,345.74
减：本报告期基金总赎回份额	180,195.82	374,020.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	19,596,561.00	420,095.26

§ 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 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，

管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	
诚通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	997,110.50	0.44%	363.97	0.80%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	3	225,065,131.08	99.56%	45,013.49	99.20%	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为东兴证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为诚通证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华西证券股份有限公司、江海证券有限公司、民生证券股份有限公司、摩根大通证券（中国）有限公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司。

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有调整，调整后的标准如下：

- 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
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	185,236.61	100.00%	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金 2025 年港股通非交易日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-22
2	易方达基金管理有限公司董事长变更公告	证券日报、基金管理人网	2025-03-22

		站及中国证监会基金电 子披露网站	
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2025-03-22
4	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2025-03-22
5	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2025-03-22
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券日报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2025-03-25
7	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（2024 年度）	基金管理人网站及中国 证监会基金电子披露网 站	2025-03-31
8	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分基金估值调整情况的公告	证券日报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2025-04-08
9	关于旗下部分基金 2025 年 4 月 18 日至 2025 年 4 月 21 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券日报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2025-04-15
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	证券日报	2025-04-22
11	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2025-05-17
12	关于旗下部分基金 2025 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券日报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2025-06-26

§ 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	2025 年 01 月 01 日	10,000,000.	0.00	0.00	10,000,000.0	49.96

		~2025 年 06 月 30 日	00			0	%
个人	1	2025 年 01 月 01 日 ~2025 年 02 月 25 日	3,500,000.0 0	0.00	0.00	3,500,000.00	17.49 %
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；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；本基金基金合同生效满三年后继续存续时，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。							

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科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达科鑫量化选股股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

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
二〇二五年八月三十日