

易方达国证新能源电池交易型开放式指数证券投资基金发 起式联接基金

2026 年第 2 季度报告

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：国投证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人国投证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

基金简称	易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式
基金主代码	021033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 4 月 23 日
报告期末基金份额总额	888,145,435.81 份
投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为易方达国证新能源电池 ETF 的联接基金，主要通过投资于易方达国证新能源电池 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内，主要投资策略包括目标 ETF 投资策略、

	股票（含存托凭证）投资策略、债券和货币市场工具投资策略、衍生品投资策略、参与转融通证券出借业务策略、融资业务策略等。	
业绩比较基准	国证新能源电池指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	国投证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式 A	易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式 C
下属分级基金的交易代码	021033	021034
报告期末下属分级基金的份额总额	232,223,322.80 份	655,922,113.01 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	易方达国证新能源电池交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159566
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 1 月 31 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 2 月 8 日
基金管理人名称	易方达基金管理有限公司
基金托管人名称	国投证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务，并可根据相关法律法规参与融资业务。
业绩比较基准	国证新能源电池指数收益率
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。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	易方达国证新能源电 池 ETF 联接发起式 A	易方达国证新能源电 池 ETF 联接发起式 C
1.本期已实现收益	2,570,444.33	6,594,735.11
2.本期利润	14,950,631.62	43,127,745.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0664	0.0638
4.期末基金资产净值	415,623,726.12	1,166,278,911.46

5.期末基金份额净值	1.7898	1.7781
------------	--------	--------

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式 A:

阶段	净值增长率 ①	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	5.34%	2.18%	5.10%	2.19%	0.24%	-0.01%
过去六个月	8.03%	1.93%	7.79%	1.94%	0.24%	-0.01%
过去一年	59.80%	1.92%	64.76%	1.99%	-4.96%	-0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合 同生效起 至今	78.98%	2.01%	95.03%	2.11%	-16.05%	-0.10%

易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式 C:

阶段	净值增长率 ①	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	5.26%	2.18%	5.10%	2.19%	0.16%	-0.01%
过去六个月	7.87%	1.93%	7.79%	1.94%	0.08%	-0.01%
过去一年	59.33%	1.92%	64.76%	1.99%	-5.43%	-0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-

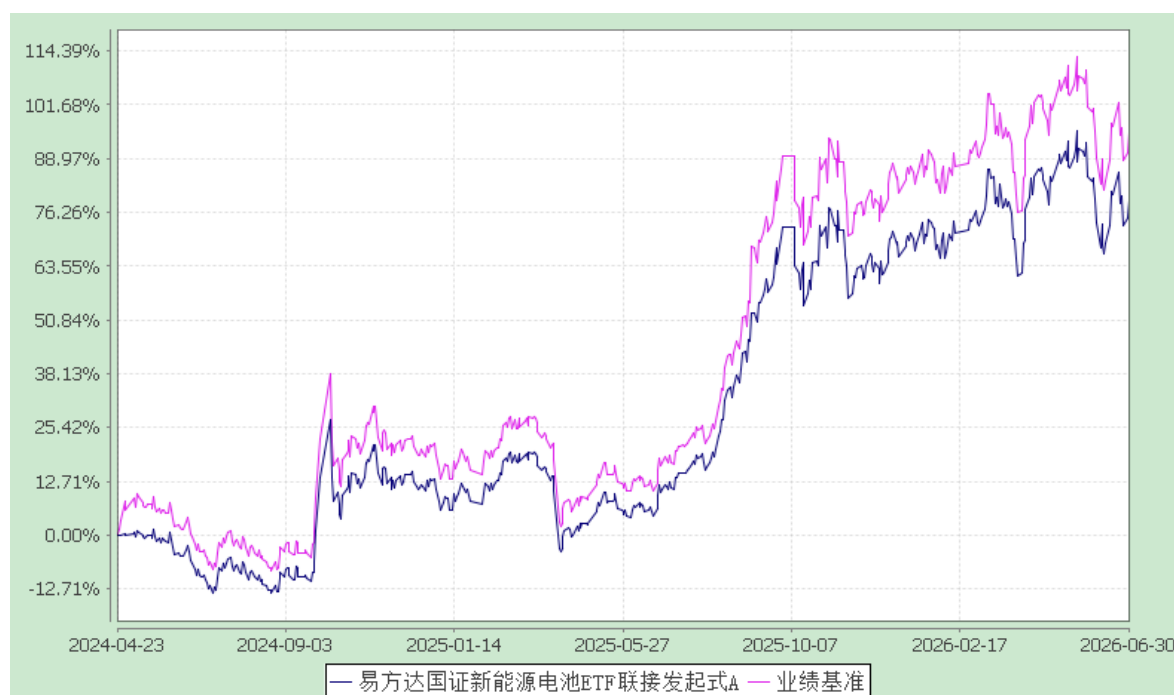
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	77.81%	2.01%	95.03%	2.11%	-17.22%	-0.10%

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

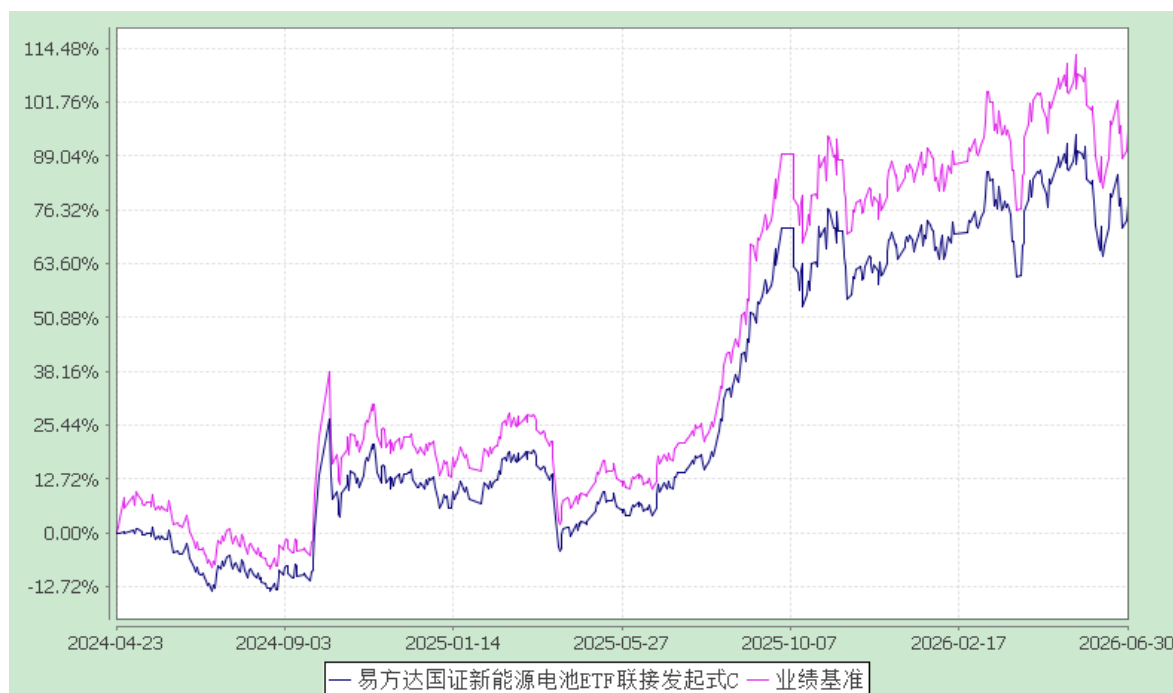
易方达国证新能源电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024 年 4 月 23 日至 2026 年 6 月 30 日)

易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式 A:



易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式 C:



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘文魁	本基金的基金经理（报告期内已离职），易方达中证稀土产业 ETF（自 2023 年 09 月 09 日至 2026 年 05 月 29 日）、易方达上证科创板人工智能 ETF（自 2025 年 01 月 16 日至 2026 年 05 月 29 日）、易方达中证红利价值 ETF（自 2025 年 04 月 16 日至 2026 年 05 月 29 日）、易方达中证国资央企 50ETF（自 2025 年 05 月 08 日至 2026 年 05 月 29 日）、易方达中证红利价值 ETF 联接（自 2025 年 07 月 29 日至 2026 年 05 月 29 日）、	2024-04-23	2026-05-30	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司基金运作高级经理，银华基金管理股份有限公司量化研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司基金经理助理，易方达中证 A100ETF 联接发起式、易方达创业板成长 ETF、易方达上证科创板 100ETF 联接发起式、易方达创业板成长 ETF 联接发起式的基金经理。

	易方达中证国资央企 50ETF 联接发起式（自 2025 年 11 月 25 日至 2026 年 05 月 29 日）、易方达中证细分有色金属产业主题 ETF 联接发起式（自 2025 年 12 月 31 日至 2026 年 05 月 29 日）、易方达国证石油天然气 ETF（自 2026 年 03 月 11 日至 2026 年 05 月 29 日）、易方达中证细分有色金属产业主题 ETF（自 2026 年 04 月 22 日至 2026 年 05 月 29 日）、易方达中证工业有色金属主题 ETF（自 2026 年 04 月 30 日至 2026 年 05 月 29 日）的基金经理				
李栩	本基金的基金经理，易方达中证港股通互联网 ETF、易方达中证 2000ETF、易方达中证生物科技主题 ETF 联接发起式（自 2023 年 09 月 19 日至 2026 年 04 月 10 日）、易方达国证信息技术创新主题 ETF、易方达中证港股通互联网 ETF 联接发起式、易方达国证机器人产业 ETF、易方达上证科创板芯片 ETF 联接发起式、易方达国证新能源电池 ETF、易方达中证 A50ETF、易方达中证半导体材料设备主题 ETF、易方达上证科创板芯片 ETF、易方达上证科创板芯片设计主题 ETF、易方达中证电池主题 ETF、易方达中证电池主题 ETF 联接发起式的基金经理，易方达中证海外中国互联网 50（QDII-ETF）、易	2026-05-30	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司分析师，易方达基金管理有限公司研究员、指数投资部总经理助理，易方达中证物联网主题 ETF、易方达中证沪港深 500ETF、易方达中证物联网主题 ETF 联接发起式、易方达中证沪港深 500ETF 联接发起式的基金经理。

	方达国证信息技术创新主题 ETF 联接发起式、易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式(自 2024 年 05 月 18 日至 2026 年 05 月 29 日)、易方达中证 A50ETF 联接发起式、易方达国证机器人产业 ETF 联接发起式、易方达中证半导体材料设备主题 ETF 联接发起式的基金经理助理，指数研究发展部总经理助理				
--	--	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

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、决策流程和交易流程，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，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 30 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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为易方达国证新能源电池 ETF 的联接基金，报告期内主要通过投资易方达国证新能源电池 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。易方达国证新能源电池 ETF 跟踪国证新能源电池指数，该指数由沪深北交易所新能源发电产业储能电池相关上市公司组成，以反映该主题领域的证券价格变化情况。

2026 年二季度，随着更加积极有为的宏观政策持续显效，工业生产加快，装备制造业和高技术制造业较快增长，货物进出口较快增长，贸易结构继续优化，工业企业利润保持较快增长。其中，1—5 月份规模以上工业企业利润同比增长 18.8%，从行业看，全球人工智能技术变革带来高端算力芯片和存储芯片需求爆发，推动电子行业利润高速增长，1—5 月份，电子行业利润增长 103.9%，对全部规模以上工业企业利润增长的贡献率达 43.1%，是规模以上工业企业利润较快增长的重要支撑。资本市场方面，随着外部地缘政治冲突的逐步缓和以及全球人工智能产业的持续景气，投资者风险偏好快速修复，交易活跃度持续提升，二季度内万得全 A 指数上涨 12.82%。其中，国证新能源电池指数二季度内上涨 5.28%，收益率表现弱于 A 股市场整体。

储能产业在能源转型和 AI 用电需求激增两条核心逻辑下，有望保持较高的需求增速。随着新能源逐渐成为发电主力、AI 在电力需求中的比重快速提升，新型电力系统的供需两侧都呈现出波动性加剧、分布愈发分散的特征：供给端风光出力具有天然的间歇性与随机性，伴随装机占比持续提升，系统调峰调频压力呈非线性增长，供电稳定性与安全裕度面临持续挑战；需求端 AI 算力中心、大功率快充等新型负荷兼具高功率密度与全天候运行特征，持续拉大用电峰谷差，同时分布式光伏、分散用能场景的普及也让负荷分布更加碎片化，传统集中式电网的调度适配难度显著上升。储能作为响应速度快、部署灵活的电力平滑装置，既可以集中式配套新能源场站实现并网消纳与出力平滑，也适合分布式安装在配网侧、工商业园区与负荷终端，就地完成供需平衡与电能质量治理，同时还能提供调频备用、容量支撑、黑启动等多重电网服务，将在新型电力系统中发挥更加重要的作用，成为新的核心基础设施。我国在储能全产业链都具备突出优势，已形成全球领先的产能规模与成本优势，有望深度受益于此轮全球能源转型浪潮和 AI 用电需求扩张。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，

坚持既定的指数化投资策略，依据基金申赎变动等情况进行日常组合管理，力求跟踪误差最小化。

4.5 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 1.7898 元，本报告期份额净值增长率为 5.34%，同期业绩比较基准收益率为 5.10%；C 类基金份额净值为 1.7781 元，本报告期份额净值增长率为 5.26%，同期业绩比较基准收益率为 5.10%。年化跟踪误差 0.56%，在合同规定的目标控制范围之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,501,740,430.76	90.66
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	118,741,022.23	7.17

8	其他资产	36,040,303.93	2.18
9	合计	1,656,521,756.92	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	易方达国证新能源电池交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	易方达基金管理有限公司	1,501,740,430.76	94.93

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.5 报告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。

5.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.8 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。

5.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

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

5.12.2 本基金本报告期末未持有股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,512,049.11
2	应收证券清算款	18,066,026.85
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,462,227.97
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	36,040,303.93

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达国证新能源 电池ETF联接发起式 A	易方达国证新能源 电池ETF联接发起式 C
报告期期初基金份额总额	175,475,452.38	665,565,033.86
报告期期间基金总申购份额	252,656,360.92	1,166,076,786.00
减：报告期期间基金总赎回份额	195,908,490.50	1,175,719,706.85

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	232,223,322.80	655,922,113.01

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式 A	易方达国证新能源电池 ETF 联接发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	24,621,977.43	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	14,621,527.39	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,450.04	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	4.3064	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2026-06-22	-14,621,527.39	-27,152,176.36	-
合计			-14,621,527.39	-27,152,176.36	

§ 8 报告期末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	10,000,450.04	1.1260%	10,000,450.04	1.1260%	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	10,000,450.04	1.1260%	10,000,450.04	1.1260%	-

	50.04		50.04		
--	-------	--	-------	--	--

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达国证新能源电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的文件；
- 2.《易方达国证新能源电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；
- 3.《易方达国证新能源电池交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；
- 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、营业执照。

10.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

10.3 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
二〇二六年七月二十一日