

易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64

7.12 投资组合报告附注	65
§ 8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
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	68
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	易方达上证科创板综合增强	
基金主代码	023998	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 4 月 29 日	
基金管理人	易方达基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	539,110,403.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达上证科创板综合增强 A	易方达上证科创板综合增强 C
下属分级基金的交易代码	023998	023999
报告期末下属分级基金的份额总额	146,139,933.38 份	392,970,470.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 4%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。股票投资方面，本基金指数化投资以标的指数的构成为基础，通过对各成份股权重偏离的控制，实现对标的指数的跟踪。本基金利用基金管理人自主研发的定量投资模型，在控制组合风险与交易成本的基础上构建和优化投资组合，其中股票选择以指数成份股及备选成份股为主，同时适当投资于非成份股，并根据定量投资模型在全市场优选股票，对投资组合构成及权重进行优化调整。本基金通过采取多个定量投资模型，力争分散模型风险，提高投资组合表现。本基金投资存托凭证的策略依照股票投资策略执行。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。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，并可参与转融通证券出借业务、融资业务。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
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。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。 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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	潘琦
	联系电话	020-85102688	0755-22168257
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95511-3
传真		020-38798812	0755-82080387
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
办公地址		广东省广州市天河区珠江西路 21号52层；广东省广州市天河 区珠江东路30号42层；广东省 珠海市横琴新区荣粤道188号6 层	广东省深圳市福田区益田路 5023号平安金融中心B座
邮政编码		510627；510623；519031	518001
法定代表人		吴欣荣	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	易方达基金管理有限公司	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

§ 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）	
	易方达上证科创板综合	易方达上证科创板综合

	增强 A	增强 C
本期已实现收益	26,626,333.35	84,992,210.59
本期利润	96,744,953.85	291,179,853.25
加权平均基金份额本期利润	0.8301	0.7114
本期加权平均净值利润率	50.35%	43.73%
本期基金份额净值增长率	55.96%	55.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达上证科创板综合增强 A	易方达上证科创板综合增强 C
期末可供分配利润	58,918,571.11	155,414,869.83
期末可供分配基金份额利润	0.4032	0.3955
期末基金资产净值	320,722,146.55	858,390,868.92
期末基金份额净值	2.1946	2.1844
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	易方达上证科创板综合增强 A	易方达上证科创板综合增强 C
基金份额累计净值增长率	119.46%	118.44%

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

易方达上证科创板综合增强 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
过去三个月	57.70%	2.38%	52.44%	2.24%	5.26%	0.14%
过去六个月	55.96%	2.20%	50.92%	2.11%	5.04%	0.09%
过去一年	110.15%	1.92%	98.19%	1.86%	11.96%	0.06%
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	119.46%	1.80%	109.74%	1.76%	9.72%	0.04%

易方达上证科创板综合增强 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
过去三个月	57.55%	2.38%	52.44%	2.24%	5.11%	0.14%
过去六个月	55.65%	2.20%	50.92%	2.11%	4.73%	0.09%
过去一年	109.33%	1.92%	98.19%	1.86%	11.14%	0.06%
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	118.44%	1.80%	109.74%	1.76%	8.70%	0.04%

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

易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金
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 4 月 29 日至 2026 年 6 月 30 日)

易方达上证科创板综合增强 A



易方达上证科创板综合增强 C



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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
殷明	本基金的基金经理，易方达易百智能量化策略混合、易方达中证 1000 量化增强、易方达上证科创板 100 增强策略 ETF、易方达上证科创板综合增强策略 ETF、易方达创业板	2025-04-29	-	10 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所研究员，国盛证券有限责任公司研究所金融工程分析师，易方达基金管理有限公司量化研究员。

	增强的基金经理，量化投资部总经理助理、量化投资决策委员会委员				
--	--------------------------------	--	--	--	--

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济顶住压力运行在合理区间，一季度增长开局良好，二季度增速有所回落。二季度的放缓主要受短期因素与外部环境影响：中东地缘冲突带来的能源供给冲击推升国际油价并沿产业链传导，部分石化相关行业受到扰动；同时部分需求在政策带动下已于前期集中释放，叠加房地产仍处调整阶段，内生需求偏弱，国内供强需弱的结构性矛盾较为突出。结构层面亮点亦较为清晰：物价温和上涨，对外贸易增势良好，以信息服务业和高技术制造业为代表的新动能增速明显领先，新质生产力对经济增长的支撑作用持续显现。宏观政策方面，上半年更加积极有为的政

策组合有效实施，财政与货币协同发力，市场流动性维持合理充裕，为实体经济与资本市场营造了总体适宜的环境。

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

本基金为上证科创板综合指数增强型证券投资基金，在紧密跟踪上证科创板综合指数的前提下，通过量化手段力争获取超越业绩比较基准的收益。本报告期内市场上涨高度集中于少数权重与热门品种、多数个股下跌的结构，对偏重分散化持股的量化选股策略构成了较大考验。在 A 股历史上，类似短期反转这样的因子长期有效，而这一规律在今年上半年显著被打破。相对应的，不少依赖捕捉短期定价偏差的统计套利策略今年超额收益也大幅收敛。为了应对新时代的结构化行情，我们在之前多策略体系的基础上继续研发了一些新的量化策略，例如针对特质交易日期发掘不同的交易特征，对模型进行了重构。总体来说，这些迭代工作都起到了不错的效果，帮助我们在报告期继续跑赢了基准指数。我们坚持相信，量化投资的本质不是一成不变的固守单一模型，而是不断根据市场的变化寻找持续有效的策略，使得模型能适应不同类型的市场环境。

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 2.1946 元，本报告期份额净值增长率为 55.96%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%；C 类基金份额净值为 2.1844 元，本报告期份额净值增长率为 55.65%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%。年化跟踪误差 4.13%，超过目标控制范围，主要是投资组合与指数权重的偏差有所扩大所致。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观政策有望加大逆周期和跨周期调节力度，持续扩大内需、优化供给，随着短期扰动因素逐步消除，前期受影响的行业有条件逐步恢复，经济增速有望企稳回升。需要跟踪的方面包括：价格相关指标能否在政策发力下出现积极变化，地产调整与消费修复的进展，以及中东局势演变下能源价格对中下游行业成本与盈利的影响。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

易方达上证科创板综合增强 A:本报告期内未实施利润分配。

易方达上证科创板综合增强 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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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	66,629,309.24	48,587,924.76
结算备付金		1,878,906.98	7,079,415.94
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,102,312,220.90	642,846,400.45
其中：股票投资		1,102,069,214.63	642,749,693.94
基金投资		-	-
债券投资		243,006.27	96,706.51
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		22,386,867.83	4,076,165.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,193,207,304.95	702,589,906.51
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		0.23	-
应付赎回款		13,024,861.84	22,569,234.95
应付管理人报酬		651,022.95	498,350.66
应付托管费		81,377.87	62,293.82
应付销售服务费		240,571.96	196,830.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.44	0.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	96,454.19	57,735.11
负债合计		14,094,289.48	23,384,444.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	539,110,403.69	483,687,635.55
未分配利润	6.4.7.8	640,002,611.78	195,517,826.22
净资产合计		1,179,113,015.47	679,205,461.77
负债和净资产总计		1,193,207,304.95	702,589,906.51

注：1.本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 4 月 29 日至 2025 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 2.1946 元，C 类基金份额净值 2.1844 元；基金份额总额 539,110,403.69 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 146,139,933.38 份，C 类基金份额总额 392,970,470.31 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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	上年度可比期间 2025 年 4 月 29 日（基 金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		393,143,389.62	19,944,486.98
1.利息收入		107,913.97	165,132.87
其中：存款利息收入	6.4.7.9	107,913.97	165,132.87
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）		116,433,663.31	6,458,896.51
其中：股票投资收益	6.4.7.10	114,314,232.37	5,201,045.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	310,006.37	-
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	269,903.44	-
股利收益	6.4.7.14	1,539,521.13	1,257,851.36
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	276,306,263.16	13,316,201.30
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	295,549.18	4,256.30
减：二、营业总支出		5,218,582.52	1,065,262.94
1. 管理人报酬		3,390,423.25	708,374.16
2. 托管费		423,802.90	88,546.79
3. 销售服务费		1,315,979.68	253,865.97
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		1,447.68	-
8. 其他费用	6.4.7.18	86,929.01	14,476.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		387,924,807.10	18,879,224.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		387,924,807.10	18,879,224.04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		387,924,807.10	18,879,224.04

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，上年度可比期间为 2025 年 4 月 29 日至 2025 年 6 月 30 日。

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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	483,687,635.55	195,517,826.22	679,205,461.77

产			
二、本期期初净资产	483,687,635.55	195,517,826.22	679,205,461.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	55,422,768.14	444,484,785.56	499,907,553.70
（一）、综合收益总额	-	387,924,807.10	387,924,807.10
（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）	55,422,768.14	56,559,978.46	111,982,746.60
其中：1.基金申购款	1,141,241,811.90	761,184,002.07	1,902,425,813.97
2.基金赎回款	-1,085,819,043.76	-704,624,023.61	-1,790,443,067.37
（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	539,110,403.69	640,002,611.78	1,179,113,015.47
项目	上年度可比期间		
	2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	582,243,421.05	-	582,243,421.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-216,765,937.66	16,004,444.19	-200,761,493.47
（一）、综合收益总额	-	18,879,224.04	18,879,224.04
（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）	-216,765,937.66	-2,874,779.85	-219,640,717.51
其中：1.基金申购款	38,724,387.14	384,923.88	39,109,311.02
2.基金赎回	-255,490,324.80	-3,259,703.73	-258,750,028.53

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	365,477,483.39	16,004,444.19	381,481,927.58

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 29 日，上年度可比期间为 2025 年 4 月 29 日至 2025 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金(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]710 号《关于准予易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 4 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 582,243,421.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 125,039.99 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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》的规定：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

至 2027 年 12 月 31 日，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税及金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，

该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	14,096,764.06
等于：本金	14,095,157.27
加：应计利息	1,606.79
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	52,532,545.18
等于：本金	52,529,541.90
加：应计利息	3,003.28
合计	66,629,309.24

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		760,665,999.86	-	1,102,069,214.63	341,403,214.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	242,997.67	8.60	243,006.27	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	242,997.67	8.60	243,006.27	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		760,908,997.53	8.60	1,102,312,220.90	341,403,214.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.36
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	86,780.45
其他应付款	9,672.38
合计	96,454.19

6.4.7.7 实收基金

易方达上证科创板综合增强 A

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	106,039,141.58	106,039,141.58
本期申购	164,820,095.18	164,820,095.18
本期赎回（以“-”号填列）	-124,719,303.38	-124,719,303.38
本期末	146,139,933.38	146,139,933.38

易方达上证科创板综合增强 C

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	377,648,493.97	377,648,493.97
本期申购	976,421,716.72	976,421,716.72
本期赎回（以“-”号填列）	-961,099,740.38	-961,099,740.38
本期末	392,970,470.31	392,970,470.31

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

易方达上证科创板综合增强 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	18,787,956.94	24,390,562.16	43,178,519.10
本期期初	18,787,956.94	24,390,562.16	43,178,519.10
本期利润	26,626,333.35	70,118,620.50	96,744,953.85
本期基金份额交易产生的变动数	13,504,280.82	21,154,459.40	34,658,740.22
其中：基金申购款	48,154,527.35	69,298,173.69	117,452,701.04
基金赎回款	-34,650,246.53	-48,143,714.29	-82,793,960.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,918,571.11	115,663,642.06	174,582,213.17

易方达上证科创板综合增强 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	65,561,844.30	86,777,462.82	152,339,307.12
本期期初	65,561,844.30	86,777,462.82	152,339,307.12
本期利润	84,992,210.59	206,187,642.66	291,179,853.25
本期基金份额交易产生的变动数	4,860,814.94	17,040,423.30	21,901,238.24
其中：基金申购款	261,530,610.48	382,200,690.55	643,731,301.03
基金赎回款	-256,669,795.54	-365,160,267.25	-621,830,062.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	155,414,869.83	310,005,528.78	465,420,398.61

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	27,007.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	59,625.89
结算备付金利息收入	17,525.22
其他	3,755.61
合计	107,913.97

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	114,314,232.37
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	114,314,232.37

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	1,080,492,435.68
减：卖出股票成本总额	965,277,977.12
减：交易费用	900,226.19
买卖股票差价收入	114,314,232.37

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	41.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	309,964.53
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	310,006.37

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	700,831.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	390,799.19
减：应计利息总额	39.43
减：交易费用	28.15
买卖债券差价收入	309,964.53

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

6.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	269,903.44

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	1,539,521.13
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	1,539,521.13

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	276,306,263.16
——股票投资	276,312,068.16
——债券投资	-5,805.00
——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	276,306,263.16

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	295,549.18
合计	295,549.18

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
港股通证券组合费	65.39
存托服务费	83.17
合计	86,929.01

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、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
易方达财富管理基金销售（广州）有限公司	基金管理人的子公司、基金销售机构

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**

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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	上年度可比期间 2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,390,423.25	708,374.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,618,868.57	296,481.37
应支付基金管理人的净管理费	1,771,554.68	411,892.79

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

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	423,802.90	88,546.79

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

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.3 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 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达上证科创板综合增强A	易方达上证科创板综合增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	4,870.86	4,870.86
平安银行	-	35,845.99	35,845.99
广发证券	-	1,047.30	1,047.30
易方达财富	-	209.97	209.97
合计	-	41,974.12	41,974.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达上证科创板综合增强A	易方达上证科创板综合增强C	合计
易方达基金管理有限公司	-	614.41	614.41
平安银行	-	31,666.54	31,666.54
合计	-	32,280.95	32,280.95

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，自动在月初 5 个工作日内，按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本报告期内和上年度可比期间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

易方达上证科创板综合增强 A

无。

易方达上证科创板综合增强 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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年4月29日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期存款	14,096,764.06	27,007.25	12,609,870.19	15,221.55

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
上年度可比期间 2025 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2025 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

				股/张)	
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

易方达上证科创板综合增强 A

本报告期内未发生利润分配。

易方达上证科创板综合增强 C

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
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	5,196	52,583.52	144,085.08	-
30151	尚水	2026-0	6 个月	新股	26.66	50.96	138	3,679.	7,032.	-

3	智能	4-10		流通受限				08	48	
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	715	7,993.70	12,576.85	-
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	72	2,411.28	2,442.96	-
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	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
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	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	25,143	216,732.66	1,443,711.06	-
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	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	3,248	371,181.44	2,198,701.12	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	2,230	233,391.80	1,714,624.70	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
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	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

				受限						
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,308	25,741.44	185,068.92	-
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	640	64,000.00	64,000.70	-
118070	南芯转债	2026-06-22	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	1,170	117,000.00	117,004.62	-
118071	华峰转债	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	620	62,000.00	62,000.95	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	18,459	5,829,129.91	16,235,244.27	-
688121	卓然股份	2026-05-06	重大事项停牌	6.48	2026-07-07	5.18	5,977	72,176.96	38,730.96	-
688260	昀冢科技	2026-06-26	重大事项停牌	144.00	2026-07-01	132.00	6,466	829,725.46	931,104.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。长期来看，本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%(2025 年 12 月 31 日：0.01%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	243,006.27	96,706.51
未评级	0.00	0.00
合计	243,006.27	96,706.51

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2026 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金可通过港股通投资香港市场，影响金融市场波动的因素比较复杂，包括经济发展、政策变化、资金供求、公司盈利的变化、利率汇率波动等。香港证券市场每日证券交易价格并无涨跌幅限制，这一因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险增加。

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	66,629,309.24	-	-	-	66,629,309.24
结算备付金	1,878,906.98	-	-	-	1,878,906.98
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	243,006.27	1,102,069,214.63	1,102,312,220.90
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	-	-	-	22,386,867.83	22,386,867.83
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	68,508,216.22	-	243,006.27	1,124,456,082.46	1,193,207,304.95
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	-	-	-	0.23	0.23
应付赎回款	-	-	-	13,024,861.84	13,024,861.84
应付管理人报酬	-	-	-	651,022.95	651,022.95
应付托管费	-	-	-	81,377.87	81,377.87
应付销售服务费	-	-	-	240,571.96	240,571.96
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.44	0.44
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	96,454.19	96,454.19
负债总计	-	-	-	14,094,289.48	14,094,289.48
利率敏感度缺口	68,508,216.22	-	243,006.27	1,110,361,792.98	1,179,113,015.47
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	48,587,924.76	-	-	-	48,587,924.76
结算备付金	7,079,415.94	-	-	-	7,079,415.94
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	96,706.51	642,749,693.94	642,846,400.45

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	-	-	-	4,076,165.36	4,076,165.36
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	55,667,340.70	-	96,706.51	646,825,859.30	702,589,906.51
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	22,569,234.95	22,569,234.95
应付管理人报酬	-	-	-	498,350.66	498,350.66
应付托管费	-	-	-	62,293.82	62,293.82
应付销售服务费	-	-	-	196,830.14	196,830.14
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	-	-	-	57,735.11	57,735.11
负债总计	-	-	-	23,384,444.74	23,384,444.74
利率敏感度缺口	55,667,340.70	-	96,706.51	623,441,414.56	679,205,461.77

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

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2026年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,125,901.37	-	1,125,901.37
资产合计	-	1,125,901.37	-	1,125,901.37
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,125,901.37	-	1,125,901.37
项目	上年度末			
	2025年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	186,243.96	-	186,243.96
资产合计	-	186,243.96	-	186,243.96
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	186,243.96	-	186,243.96

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升	-56,295.07	-9,312.20

	值 5%		
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	56,295.07	9,312.20

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	1,102,069,214.63	93.47	642,749,693.94	94.63
交易性金融资产—债券投资	243,006.27	0.02	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,102,312,220.90	93.49	642,749,693.94	94.63

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%	58,003,642.88	33,828,931.26
	2.业绩比较基准下降 5%	-58,003,642.88	-33,828,931.26

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	1,076,603,345.81
第二层次	17,448,085.50
第三层次	8,260,789.59
合计	1,102,312,220.90

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	1,102,069,214.63	92.36
	其中：股票	1,102,069,214.63	92.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	243,006.27	0.02
	其中：债券	243,006.27	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	68,508,216.22	5.74
8	其他各项资产	22,386,867.83	1.88
9	合计	1,193,207,304.95	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 1,125,901.37 元，占净值比例 0.10%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	718,479,751.92	60.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	174,746,146.38	14.82

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,598,288.98	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	741,961.69	0.06
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	905,566,148.97	76.80

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,874,431.82	0.24
C	制造业	164,978,538.71	13.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,556,880.00	0.39
F	批发和零售业	2,177,712.00	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,148,887.30	1.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,069,400.00	0.18
L	租赁和商务服务业	1,793,407.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	1,328,908.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	688,080.00	0.06
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	775,442.00	0.07
S	综合	983,894.00	0.08
	合计	195,377,164.29	16.57

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	1,125,901.37	0.10
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	1,125,901.37	0.10

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	44,350	70,762,642.50	6.00
2	688041	海光信息	153,031	56,667,379.30	4.81
3	688012	中微公司	60,542	28,363,927.00	2.41
4	688008	澜起科技	72,320	22,411,968.00	1.90
5	688981	中芯国际	137,730	21,874,278.60	1.86
6	688795	摩尔线程	24,864	17,686,348.96	1.50
7	688498	源杰科技	9,328	17,592,608.00	1.49
8	688802	沐曦股份	20,237	16,629,822.80	1.41
9	688072	拓荆科技	18,459	16,235,244.27	1.38
10	688525	佰维存储	30,025	14,854,268.25	1.26
11	688521	芯原股份	39,956	14,829,269.84	1.26
12	688702	盛科通信	30,247	11,796,027.53	1.00
13	688082	盛美上海	26,576	11,480,832.00	0.97
14	688347	华虹宏力	29,655	9,972,976.50	0.85
15	688120	华海清科	29,328	9,448,895.04	0.80

16	688361	中科飞测	21,965	9,444,950.00	0.80
17	688146	中船特气	26,576	9,301,334.24	0.79
18	688200	华峰测控	16,159	8,485,090.90	0.72
19	688183	生益电子	61,529	8,146,439.60	0.69
20	688037	芯源微	18,052	7,925,730.60	0.67
21	688126	沪硅产业	192,629	7,683,970.81	0.65
22	688249	晶合集成	129,989	7,673,250.67	0.65
23	688506	百利天恒	25,939	7,626,844.17	0.65
24	688629	华丰科技	40,488	7,591,904.88	0.64
25	688766	普冉股份	9,678	7,419,154.80	0.63
26	688111	金山办公	34,597	7,370,890.85	0.63
27	688172	燕东微	86,414	7,229,395.24	0.61
28	688110	东芯股份	33,592	6,842,690.40	0.58
29	688409	富创精密	22,272	6,820,800.00	0.58
30	688519	南亚新材	17,658	6,710,746.32	0.57
31	688048	长光华芯	13,322	6,687,644.00	0.57
32	688019	安集科技	18,190	6,174,777.40	0.52
33	688627	精智达	7,758	5,546,970.00	0.47
34	688313	仕佳光子	29,480	5,443,482.00	0.46
35	688147	微导纳米	33,573	5,434,797.24	0.46
36	688630	芯碁微装	9,812	5,390,614.68	0.46
37	688220	翱捷科技	41,190	5,120,740.80	0.43
38	688141	杰华特	31,602	4,850,907.00	0.41
39	688668	鼎通科技	12,706	4,743,149.80	0.40
40	688300	联瑞新材	18,869	4,611,583.60	0.39
41	688233	神工股份	20,340	4,361,302.80	0.37
42	688017	绿的谐波	10,293	4,301,032.98	0.36
43	688002	睿创微纳	26,778	4,142,288.82	0.35
44	688411	海博思创	14,204	4,136,204.80	0.35
45	688234	天岳先进	23,530	4,082,690.30	0.35
46	688362	甬矽电子	41,795	4,029,038.00	0.34
47	688691	灿芯股份	34,312	3,977,790.16	0.34
48	688187	时代电气	57,383	3,939,916.78	0.33
49	688535	华海诚科	21,008	3,928,496.00	0.33
50	688390	固德威	35,166	3,815,862.66	0.32
51	688343	云天励飞	46,220	3,774,325.20	0.32
52	688205	德科立	17,871	3,720,563.49	0.32
53	688800	瑞可达	38,599	3,704,346.03	0.31
54	688416	恒烁股份	24,795	3,471,300.00	0.29
55	688676	金盘科技	39,751	3,364,524.64	0.29
56	688662	富信科技	19,789	3,324,552.00	0.28
57	688469	芯联集成	307,745	3,265,174.45	0.28
58	688167	炬光科技	8,999	3,187,535.79	0.27
59	688368	晶丰明源	14,682	3,178,946.64	0.27

60	688372	伟测科技	17,069	3,174,834.00	0.27
61	688559	海目星	37,792	3,171,504.64	0.27
62	688188	柏楚电子	29,716	3,170,697.20	0.27
63	688195	腾景科技	16,333	3,145,409.14	0.27
64	688052	纳芯微	10,725	3,092,124.75	0.26
65	688449	联芸科技	35,675	3,079,109.25	0.26
66	688578	艾力斯	27,735	3,028,662.00	0.26
67	688432	有研硅	74,833	2,991,075.01	0.25
68	688123	聚辰股份	14,014	2,979,376.40	0.25
69	688615	合合信息	26,261	2,970,119.10	0.25
70	688231	隆达股份	80,439	2,954,524.47	0.25
71	688336	三生国健	55,557	2,950,076.70	0.25
72	688692	达梦数据	12,038	2,940,763.02	0.25
73	688550	瑞联新材	49,567	2,867,450.95	0.24
74	688063	派能科技	53,748	2,863,155.96	0.24
75	688472	阿特斯	262,080	2,835,705.60	0.24
76	688001	华兴源创	32,553	2,789,792.10	0.24
77	688025	杰普特	5,930	2,787,100.00	0.24
78	688006	杭可科技	75,744	2,768,443.20	0.23
79	688711	宏微科技	59,043	2,683,504.35	0.23
80	688403	汇成股份	67,527	2,680,821.90	0.23
81	688047	龙芯中科	17,092	2,643,619.64	0.22
82	688359	三孚新科	13,313	2,641,831.72	0.22
83	688036	传音控股	44,124	2,601,109.80	0.22
84	688777	中控技术	22,054	2,591,345.00	0.22
85	688097	博众精工	40,904	2,578,997.20	0.22
86	688625	呈和科技	30,269	2,555,006.29	0.22
87	688778	厦钨新能	46,842	2,548,204.80	0.22
88	688652	京仪装备	12,442	2,490,515.14	0.21
89	688392	骄成超声	10,905	2,477,397.90	0.21
90	688257	新锐股份	23,812	2,426,442.80	0.21
91	688388	嘉元科技	54,095	2,380,180.00	0.20
92	688503	聚和材料	17,665	2,344,145.50	0.20
93	688536	思瑞浦	6,411	2,334,180.99	0.20
94	688661	和林微纳	14,642	2,327,785.16	0.20
95	688603	天承科技	11,169	2,322,593.55	0.20
96	688518	联赢激光	73,665	2,276,248.50	0.19
97	688155	先惠技术	27,353	2,212,584.17	0.19
98	688028	沃尔德	13,946	2,173,763.02	0.18
99	688531	日联科技	12,133	2,157,732.72	0.18
100	688020	方邦股份	8,459	2,111,366.40	0.18
101	688385	复旦微电	29,376	2,094,215.04	0.18
102	688295	中复神鹰	34,293	2,076,098.22	0.18
103	688433	华曙高科	23,869	2,043,186.40	0.17

104	688223	晶科能源	429,439	2,039,835.25	0.17
105	688502	茂莱光学	2,931	2,032,941.60	0.17
106	688003	天准科技	15,889	2,022,669.70	0.17
107	688381	帝奥微	37,614	2,012,349.00	0.17
108	688322	奥比中光	15,153	1,978,224.15	0.17
109	688717	艾罗能源	23,932	1,976,065.24	0.17
110	688010	福光股份	40,519	1,970,438.97	0.17
111	688239	航宇科技	32,858	1,965,894.14	0.17
112	688258	卓易信息	16,424	1,946,900.96	0.17
113	688127	蓝特光学	19,579	1,910,910.40	0.16
114	688308	欧科亿	10,346	1,881,006.26	0.16
115	688789	宏华数科	34,645	1,842,074.65	0.16
116	688143	长盈通	10,399	1,828,976.12	0.16
117	688235	百济神州	7,132	1,815,878.52	0.15
118	688400	凌云光	27,398	1,813,747.60	0.15
119	688499	利元亨	34,320	1,803,516.00	0.15
120	688090	瑞松科技	16,861	1,794,853.45	0.15
121	688520	神州细胞	51,490	1,761,472.90	0.15
122	688612	威迈斯	59,310	1,754,982.90	0.15
123	688584	上海合晶	47,813	1,718,877.35	0.15
124	688719	爱科赛博	22,131	1,704,087.00	0.14
125	688484	南芯科技	30,157	1,703,568.93	0.14
126	688700	东威科技	19,010	1,699,494.00	0.14
127	688659	元琛科技	160,611	1,676,778.84	0.14
128	688331	荣昌生物	12,837	1,672,147.62	0.14
129	688192	迪哲医药	41,821	1,669,912.53	0.14
130	688352	顾中科技	69,014	1,668,758.52	0.14
131	688318	财富趋势	23,397	1,668,440.07	0.14
132	688551	科威尔	23,572	1,656,404.44	0.14
133	688059	华锐精密	8,174	1,632,429.54	0.14
134	688095	福昕软件	27,307	1,622,855.01	0.14
135	688316	青云科技	29,893	1,614,222.00	0.14
136	688383	新益昌	8,502	1,598,716.08	0.14
137	688510	航亚科技	63,776	1,522,970.88	0.13
138	688621	阳光诺和	27,481	1,508,981.71	0.13
139	688737	中自科技	78,178	1,496,326.92	0.13
140	688099	晶晨股份	14,320	1,473,528.00	0.12
141	688122	西部超导	23,438	1,472,140.78	0.12
142	688248	南网科技	20,875	1,444,132.50	0.12
143	688005	容百科技	47,114	1,441,688.40	0.12
144	688475	萤石网络	52,419	1,433,659.65	0.12
145	688332	中科蓝讯	9,002	1,417,815.00	0.12
146	688281	华秦科技	28,053	1,409,102.19	0.12
147	688009	中国通号	292,602	1,392,785.52	0.12

148	688720	艾森股份	13,655	1,379,155.00	0.12
149	688378	奥来德	22,244	1,379,128.00	0.12
150	688190	云路股份	15,098	1,369,539.58	0.12
151	688170	德龙激光	14,230	1,366,222.30	0.12
152	688663	新风光	15,367	1,359,364.82	0.12
153	688337	普源精电	17,864	1,338,549.52	0.11
154	688150	莱特光电	19,324	1,326,012.88	0.11
155	688084	晶品特装	25,733	1,293,855.24	0.11
156	688279	峰昭科技	5,731	1,286,265.64	0.11
157	688508	芯朋微	13,553	1,259,886.88	0.11
158	688655	迅捷兴	23,431	1,254,964.36	0.11
159	688297	中无人机	29,990	1,246,084.50	0.11
160	688396	华润微	12,533	1,222,594.15	0.10
161	688303	大全能源	69,277	1,207,498.11	0.10
162	688327	云从科技	96,581	1,203,399.26	0.10
163	688375	国博电子	11,530	1,202,579.00	0.10
164	688018	乐鑫科技	9,387	1,200,785.04	0.10
165	688379	华光新材	14,262	1,198,435.86	0.10
166	688549	中巨芯	32,006	1,178,140.86	0.10
167	688651	盛邦安全	35,882	1,156,118.04	0.10
168	688648	中邮科技	31,528	1,152,348.40	0.10
169	688246	嘉和美康	55,019	1,130,640.45	0.10
170	688055	龙腾光电	196,121	1,129,656.96	0.10
171	688733	壹石通	26,025	1,076,133.75	0.09
172	688599	天合光能	75,922	1,072,018.64	0.09
173	688386	泛亚微透	11,720	1,052,924.80	0.09
174	688775	影石创新	7,452	1,033,219.80	0.09
175	688180	君实生物	29,716	1,004,995.12	0.09
176	688202	美迪西	12,321	994,427.91	0.08
177	688088	虹软科技	27,871	990,814.05	0.08
178	688349	三一重能	64,460	978,502.80	0.08
179	688271	联影医疗	9,569	968,669.87	0.08
180	688596	正帆科技	12,165	961,764.90	0.08
181	688678	福立旺	39,556	956,068.52	0.08
182	688131	皓元医药	9,952	941,459.20	0.08
183	688135	利扬芯片	22,309	938,762.72	0.08
184	688260	昀冢科技	6,466	931,104.00	0.08
185	688206	概伦电子	20,844	924,848.28	0.08
186	688628	优利德	9,313	921,428.22	0.08
187	688293	奥浦迈	21,401	892,207.69	0.08
188	688353	华盛锂电	7,629	885,498.03	0.08
189	688686	奥普特	5,254	884,721.06	0.08
190	688278	特宝生物	15,516	844,070.40	0.07
191	688617	惠泰医疗	4,612	837,354.72	0.07

192	688699	明微电子	10,197	835,644.15	0.07
193	688356	键凯科技	10,791	831,770.28	0.07
194	688160	步科股份	7,445	809,792.65	0.07
195	688112	鼎阳科技	10,958	804,974.68	0.07
196	688275	万润新能	6,161	785,835.55	0.07
197	688590	新致软件	62,830	780,976.90	0.07
198	688365	光云科技	49,079	773,975.83	0.07
199	688328	深科达	8,074	772,681.80	0.07
200	688320	禾川科技	18,457	765,042.65	0.06
201	688107	安路科技	16,770	764,712.00	0.06
202	688543	国科军工	19,078	752,627.10	0.06
203	688312	燕麦科技	8,860	744,151.40	0.06
204	688226	威腾电气	17,354	743,271.82	0.06
205	688726	拉普拉斯	13,998	739,794.30	0.06
206	688387	信科移动	37,210	738,246.40	0.06
207	688238	和元生物	134,072	726,670.24	0.06
208	688031	星环科技	6,203	714,461.54	0.06
209	688148	芳源股份	82,035	703,860.30	0.06
210	688035	德邦科技	7,448	683,726.40	0.06
211	688321	微芯生物	25,109	661,119.97	0.06
212	688698	伟创电气	12,462	653,631.90	0.06
213	688779	五矿新能	80,590	653,584.90	0.06
214	688728	格科微	30,855	649,189.20	0.06
215	688410	山外山	45,207	649,172.52	0.06
216	688560	明冠新材	54,337	643,893.45	0.05
217	688561	奇安信	26,803	642,735.94	0.05
218	688252	天德钰	26,474	635,376.00	0.05
219	688516	奥特维	10,730	615,794.70	0.05
220	688277	天智航	34,246	585,606.60	0.05
221	688376	美埃科技	5,029	584,872.70	0.05
222	688697	纽威数控	42,173	573,131.07	0.05
223	688229	博睿数据	7,365	564,895.50	0.05
224	688428	诺诚健华	19,799	563,677.53	0.05
225	688153	唯捷创芯	17,409	559,177.08	0.05
226	688548	广钢气体	10,668	555,802.80	0.05
227	688100	威胜信息	18,067	552,669.53	0.05
228	688261	东微半导	5,255	551,407.15	0.05
229	688799	华纳药厂	12,086	542,298.82	0.05
230	688039	当虹科技	14,390	537,034.80	0.05
231	688305	科德数控	8,140	531,297.80	0.05
232	688391	钜泉科技	14,685	526,750.95	0.04
233	688598	金博股份	10,215	505,131.75	0.04
234	688707	振华新材	38,628	496,369.80	0.04
235	688182	灿勤科技	11,478	494,357.46	0.04

236	688609	九联科技	44,195	486,586.95	0.04
237	688577	浙海德曼	10,345	474,111.35	0.04
238	688221	前沿生物	21,111	472,886.40	0.04
239	688115	思林杰	5,727	471,045.75	0.04
240	688173	希荻微	24,477	468,489.78	0.04
241	688608	恒玄科技	2,792	466,794.48	0.04
242	688077	大地熊	17,491	463,336.59	0.04
243	688049	炬芯科技	9,836	461,406.76	0.04
244	688290	景业智能	6,731	446,669.16	0.04
245	688515	裕太微	1,780	442,792.80	0.04
246	688553	汇宇制药	40,362	429,048.06	0.04
247	688369	致远互联	20,164	423,645.64	0.04
248	688011	新光光电	5,959	416,355.33	0.04
249	688772	珠海冠宇	21,183	415,822.29	0.04
250	688373	盟科药业	91,714	415,464.42	0.04
251	688283	坤恒顺维	12,546	415,398.06	0.04
252	688093	世华科技	11,255	415,309.50	0.04
253	688486	龙迅股份	6,519	414,478.02	0.04
254	688401	路维光电	4,316	414,249.68	0.04
255	688292	浩瀚深度	21,861	406,614.60	0.03
256	688103	国力电子	5,452	405,683.32	0.03
257	688435	英方软件	12,554	401,728.00	0.03
258	688488	艾迪药业	31,254	401,613.90	0.03
259	689009	九号公司	10,267	391,686.05	0.03
260	688653	康希通信	22,290	387,400.20	0.03
261	688601	力芯微	6,377	386,127.35	0.03
262	688108	赛诺医疗	20,770	384,868.10	0.03
263	688593	新相微	9,804	381,571.68	0.03
264	688589	力合微	16,487	378,871.26	0.03
265	688360	德马科技	21,149	378,567.10	0.03
266	688259	创耀科技	9,612	376,021.44	0.03
267	688068	热景生物	4,334	375,324.40	0.03
268	688179	阿拉丁	13,439	372,394.69	0.03
269	688819	天能股份	16,725	371,295.00	0.03
270	688478	晶升股份	4,183	370,404.65	0.03
271	688377	迪威尔	15,531	366,220.98	0.03
272	688197	首药控股	10,836	362,030.76	0.03
273	688665	四方光电	5,507	361,809.90	0.03
274	688152	麒麟信安	13,053	358,696.44	0.03
275	688489	三未信安	15,689	356,140.30	0.03
276	688225	亚信安全	28,606	355,286.52	0.03
277	688456	有研粉材	2,545	355,282.00	0.03
278	688658	悦康药业	27,599	354,923.14	0.03
279	688023	安恒信息	9,656	354,568.32	0.03

280	688157	松井股份	13,231	349,166.09	0.03
281	688162	巨一科技	14,722	348,028.08	0.03
282	688232	新点软件	19,501	346,727.78	0.03
283	688399	硕世生物	7,561	343,193.79	0.03
284	688611	杭州柯林	4,784	341,816.80	0.03
285	688339	亿华通	18,190	340,153.00	0.03
286	688679	通源环境	8,054	338,992.86	0.03
287	688255	凯尔达	12,042	334,767.60	0.03
288	688269	凯立新材	10,409	330,069.39	0.03
289	688306	均普智能	32,452	327,765.20	0.03
290	688443	智翔金泰	13,947	324,267.75	0.03
291	688722	同益中	21,285	322,893.45	0.03
292	688419	耐科装备	4,000	314,600.00	0.03
293	688636	智明达	8,648	313,317.04	0.03
294	688501	青达环保	15,608	299,673.60	0.03
295	688538	和辉光电	114,350	297,310.00	0.03
296	688208	道通科技	11,763	296,309.97	0.03
297	688301	奕瑞科技	2,378	294,872.00	0.03
298	688177	百奥泰	17,148	288,429.36	0.02
299	688585	上纬新材	1,733	287,331.40	0.02
300	688065	凯赛生物	5,796	277,338.60	0.02
301	688558	国盛智科	8,422	276,746.92	0.02
302	688209	英集芯	9,495	276,114.60	0.02
303	688262	国芯科技	6,385	276,023.55	0.02
304	688166	博瑞医药	7,778	272,307.78	0.02
305	688181	八亿时空	4,285	268,241.00	0.02
306	688125	安达智能	1,633	266,995.50	0.02
307	688556	高测股份	19,918	264,511.04	0.02
308	688081	兴图新科	6,434	263,021.92	0.02
309	688768	容知日新	4,983	256,823.82	0.02
310	688139	海尔生物	9,632	254,477.44	0.02
311	688191	智洋创新	7,086	252,970.20	0.02
312	688302	海创药业	7,165	251,993.05	0.02
313	688758	赛分科技	11,348	249,769.48	0.02
314	688168	安博通	3,619	248,806.25	0.02
315	688660	电气风电	28,593	246,471.66	0.02
316	688227	品高股份	2,396	246,045.24	0.02
317	688230	芯导科技	3,070	241,946.70	0.02
318	688710	益诺思	3,549	238,492.80	0.02
319	688721	龙图光罩	4,066	237,373.08	0.02
320	688557	兰剑智能	7,518	233,283.54	0.02
321	688620	安凯微	14,216	230,299.20	0.02
322	688289	圣湘生物	15,918	229,219.20	0.02
323	688687	凯因科技	14,029	228,812.99	0.02

324	688682	霍莱沃	5,861	227,992.90	0.02
325	688522	纳睿雷达	11,364	227,507.28	0.02
326	688685	迈信林	4,100	225,090.00	0.02
327	688087	英科再生	6,677	223,145.34	0.02
328	688595	芯海科技	5,069	222,326.34	0.02
329	688073	毕得医药	4,124	221,953.68	0.02
330	688750	金天钛业	13,315	221,428.45	0.02
331	688080	映翰通	5,101	220,618.25	0.02
332	688091	上海谊众	5,465	219,693.00	0.02
333	688575	亚辉龙	25,069	219,604.44	0.02
334	688117	圣诺生物	8,096	218,834.88	0.02
335	688136	科兴制药	10,528	218,034.88	0.02
336	688787	海天瑞声	1,609	216,330.05	0.02
337	688562	航天软件	14,340	215,960.40	0.02
338	688062	迈威生物	7,622	215,321.50	0.02
339	688228	开普云	2,765	213,845.10	0.02
340	688007	光峰科技	16,034	213,252.20	0.02
341	688236	春立医疗	14,721	212,865.66	0.02
342	688380	中微半导	3,226	212,625.66	0.02
343	688133	泰坦科技	10,017	211,659.21	0.02
344	688626	翔宇医疗	4,780	211,562.80	0.02
345	688539	高华科技	6,629	211,332.52	0.02
346	688210	统联精密	5,196	210,489.96	0.02
347	688582	芯动联科	3,233	210,145.00	0.02
348	688169	石头科技	2,209	209,788.73	0.02
349	688185	康希诺	4,077	207,886.23	0.02
350	688176	亚虹医药	20,851	206,841.92	0.02
351	688602	康鹏科技	26,144	206,014.72	0.02
352	688199	久日新材	5,960	205,798.80	0.02
353	688156	路德科技	6,796	205,579.00	0.02
354	688291	金橙子	3,477	203,334.96	0.02
355	688566	吉贝尔	7,941	203,210.19	0.02
356	688505	复旦张江	27,414	202,315.32	0.02
357	688348	昱能科技	5,800	201,724.00	0.02
358	688633	星球石墨	6,759	200,945.07	0.02
359	688276	百克生物	14,410	200,875.40	0.02
360	688334	西高院	11,061	200,646.54	0.02
361	688119	中钢洛耐	41,635	197,766.25	0.02
362	688716	中研股份	6,239	196,091.77	0.02
363	688186	广大特材	12,929	195,874.35	0.02
364	688458	美芯晟	4,688	195,770.88	0.02
365	688709	成都华微	5,125	195,211.25	0.02
366	688311	盟升电子	7,452	195,167.88	0.02
367	688151	华强科技	13,056	194,142.72	0.02

368	688350	富淼科技	5,622	194,127.66	0.02
369	688027	国盾量子	381	192,027.81	0.02
370	688085	三友医疗	16,022	191,783.34	0.02
371	688580	伟思医疗	3,566	189,960.82	0.02
372	688267	中触媒	9,636	189,829.20	0.02
373	688196	卓越新能	5,266	189,049.40	0.02
374	688767	博拓生物	5,804	188,688.04	0.02
375	688212	澳华内镜	6,409	188,424.60	0.02
376	688070	纵横股份	5,029	187,732.57	0.02
377	688215	瑞晟智能	4,646	186,583.36	0.02
378	688563	航材股份	3,631	186,016.13	0.02
379	688398	赛特新材	7,081	183,468.71	0.02
380	688298	东方生物	10,207	182,297.02	0.02
381	688171	纬德信息	4,132	181,642.72	0.02
382	688588	凌志软件	19,857	180,500.13	0.02
383	688569	铁科轨道	11,162	180,266.30	0.02
384	688639	华恒生物	11,126	179,573.64	0.02
385	688533	上声电子	8,591	179,208.26	0.02
386	688098	申联生物	20,782	178,517.38	0.02
387	688319	欧林生物	4,055	178,338.90	0.02
388	688280	精进电动	32,462	178,216.38	0.02
389	688529	豪森智能	11,260	177,119.80	0.02
390	688113	联测科技	5,043	177,009.30	0.02
391	688203	海正生材	17,735	176,995.30	0.02
392	688317	之江生物	11,584	176,076.80	0.01
393	688244	永信至诚	12,325	175,754.50	0.01
394	688015	交控科技	11,384	175,085.92	0.01
395	688285	高铁电气	24,407	174,998.19	0.01
396	688286	敏芯股份	1,519	174,791.33	0.01
397	688425	铁建重工	42,931	172,582.62	0.01
398	688114	华大智造	3,346	170,913.68	0.01
399	688046	药康生物	7,012	169,690.40	0.01
400	688512	慧智微	10,619	169,585.43	0.01
401	688605	先锋精科	1,625	169,032.50	0.01
402	688079	美迪凯	5,489	168,786.75	0.01
403	688395	正弦电气	7,606	168,092.60	0.01
404	688207	格灵深瞳	8,303	166,890.30	0.01
405	688268	华特气体	620	165,850.00	0.01
406	688335	复洁科技	6,841	164,457.64	0.01
407	688513	苑东生物	3,657	160,761.72	0.01
408	688222	成都先导	4,971	159,618.81	0.01
409	688273	麦澜德	4,114	159,376.36	0.01
410	688693	锆威特	1,529	158,939.55	0.01
411	688696	极米科技	2,450	158,123.00	0.01

412	688237	超卓航科	2,924	156,200.08	0.01
413	688325	赛微微电	1,197	156,100.77	0.01
414	688656	浩欧博	1,608	155,606.16	0.01
415	688788	科思科技	3,447	155,046.06	0.01
416	688109	品茗科技	2,021	152,989.70	0.01
417	688579	地纬智能	19,970	151,572.30	0.01
418	688330	宏力达	4,406	149,054.98	0.01
419	688509	正元地信	34,390	147,189.20	0.01
420	688757	胜科纳米	2,153	143,605.10	0.01
421	688583	思看科技	1,667	142,978.59	0.01
422	688545	兴福电子	1,046	139,180.76	0.01
423	688363	华熙生物	3,890	139,145.30	0.01
424	688798	艾为电子	1,885	138,208.20	0.01
425	688530	欧莱新材	1,426	138,179.40	0.01
426	688158	优刻得	3,700	136,012.00	0.01
427	688517	金冠电气	7,082	123,793.36	0.01
428	688029	南微医学	1,656	118,900.80	0.01
429	688138	清溢光电	2,521	118,487.00	0.01
430	688689	银河微电	1,823	117,984.56	0.01
431	688677	海泰新光	1,124	113,670.12	0.01
432	688116	天奈科技	2,962	113,148.40	0.01
433	688056	莱伯泰科	1,700	109,735.00	0.01
434	688567	孚能科技	10,091	105,955.50	0.01
435	688600	皖仪科技	2,798	93,117.44	0.01
436	688016	心脉医疗	986	87,399.04	0.01
437	688058	宝兰德	4,097	85,709.24	0.01
438	688165	埃夫特	4,189	85,455.60	0.01
439	688480	赛恩斯	962	84,261.58	0.01
440	688307	中润光学	997	79,710.15	0.01
441	688128	中国电研	3,259	77,368.66	0.01
442	688552	航天南湖	2,708	76,176.04	0.01
443	688439	振华风光	1,609	74,335.80	0.01
444	688586	江航装备	6,351	74,243.19	0.01
445	688161	威高骨科	3,296	69,150.08	0.01
446	688326	经纬恒润	963	68,257.44	0.01
447	688591	泰凌微	1,928	66,284.64	0.01
448	688631	莱斯信息	1,320	61,921.20	0.01
449	688050	爱博医疗	1,592	58,028.40	0.00
450	688408	中信博	1,747	56,166.05	0.00
451	688776	国光电气	878	53,856.52	0.00
452	688218	江苏北人	946	51,992.16	0.00
453	688683	莱尔科技	1,307	49,561.44	0.00
454	688570	天玛智控	3,472	49,406.56	0.00
455	688345	博力威	827	48,032.16	0.00

456	688623	二元科技	475	47,718.50	0.00
457	688592	司南导航	1,132	46,910.08	0.00
458	688069	德林海	1,253	46,812.08	0.00
459	688045	必易微	566	45,721.48	0.00
460	688366	昊海生科	1,570	45,325.90	0.00
461	688101	三达膜	2,689	44,449.17	0.00
462	688523	航天环宇	840	44,016.00	0.00
463	688121	卓然股份	5,977	38,730.96	0.00
464	688216	气派科技	914	38,397.14	0.00
465	688211	中科微至	1,062	36,554.04	0.00
466	688568	中科星图	822	34,088.34	0.00
467	688175	高凌信息	1,341	33,726.15	0.00
468	688581	安杰思	646	33,404.66	0.00
469	688718	唯赛勃	2,086	33,313.42	0.00
470	688389	普门科技	3,395	33,237.05	0.00
471	688429	时创能源	3,242	33,035.98	0.00
472	688265	南模生物	870	30,093.30	0.00
473	688129	东来技术	1,127	29,516.13	0.00
474	688571	杭华股份	3,348	29,295.00	0.00
475	688357	建龙微纳	982	28,939.54	0.00
476	688247	宣泰医药	3,712	27,914.24	0.00
477	688358	祥生医疗	904	27,635.28	0.00
478	688618	三旺通信	892	27,446.84	0.00
479	688455	科捷智能	1,352	25,228.32	0.00
480	688102	斯瑞新材	520	24,533.60	0.00
481	688030	山石网科	1,474	23,274.46	0.00
482	688370	丛麟科技	1,106	23,137.52	0.00
483	688178	万德斯	675	22,821.75	0.00
484	688310	迈得医疗	1,329	20,426.73	0.00
485	688137	近岸蛋白	562	20,232.00	0.00
486	688355	明志科技	976	18,788.00	0.00
487	688638	誉辰智能	595	18,546.15	0.00
488	688468	科美诊断	3,191	18,156.79	0.00
489	688670	金迪克	1,007	17,058.58	0.00
490	688038	中科通达	952	16,012.64	0.00
491	688613	奥精医疗	1,107	15,619.77	0.00
492	688067	爱威科技	735	14,810.25	0.00
493	688118	普元信息	735	14,788.20	0.00
494	688089	嘉必优	1,370	14,535.70	0.00
495	688092	爱科科技	642	13,636.08	0.00
496	688393	安必平	766	13,619.48	0.00
497	688671	碧兴物联	373	13,267.61	0.00
498	688695	中创股份	674	12,603.80	0.00
499	688466	金科环境	971	12,457.93	0.00

500	688528	秦川物联	1,360	12,430.40	0.00
501	688329	艾隆科技	613	12,388.73	0.00
502	688021	奥福科技	631	12,216.16	0.00
503	688078	龙软科技	568	11,956.40	0.00
504	688681	科汇股份	814	11,379.72	0.00
505	688004	博汇科技	619	11,265.80	0.00
506	688565	力源科技	1,177	11,122.65	0.00
507	688701	卓锦股份	1,049	7,898.97	0.00
508	688061	灿瑞科技	66	3,278.22	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	300750	宁德时代	12,800	5,030,528.00	0.43
2	605117	德业股份	24,760	2,629,016.80	0.22
3	301235	华康洁净	31,000	2,325,310.00	0.20
4	300502	新易盛	3,360	2,039,520.00	0.17
5	600183	生益科技	11,100	1,924,740.00	0.16
6	600584	长电科技	17,500	1,812,125.00	0.15
7	300857	协创数据	5,272	1,791,952.80	0.15
8	603163	圣晖集成	11,900	1,743,350.00	0.15
9	603283	赛腾股份	21,220	1,718,395.60	0.15
10	300567	精测电子	5,400	1,715,040.00	0.15
11	300604	长川科技	5,000	1,707,100.00	0.14
12	002436	兴森科技	33,100	1,686,445.00	0.14
13	000021	深科技	26,000	1,671,020.00	0.14
14	002056	横店东磁	54,800	1,670,304.00	0.14
15	000657	中钨高新	17,400	1,665,528.00	0.14
16	300475	香农芯创	5,500	1,650,000.00	0.14
17	300903	科翔股份	15,600	1,580,436.00	0.13
18	600105	永鼎股份	23,200	1,565,536.00	0.13
19	300223	北京君正	6,100	1,518,290.00	0.13
20	001309	德明利	1,600	1,508,640.00	0.13
21	603083	剑桥科技	5,900	1,503,733.00	0.13
22	300390	天华新能	16,000	1,496,160.00	0.13
23	002487	大金重工	25,600	1,484,032.00	0.13
24	688783	西安奕材	25,143	1,443,711.06	0.12
25	605589	圣泉集团	22,200	1,411,254.00	0.12
26	601208	东材科技	19,900	1,408,721.00	0.12
27	002384	东山精密	5,300	1,390,455.00	0.12
28	300870	欧陆通	4,020	1,389,673.80	0.12
29	300454	深信服	14,300	1,375,660.00	0.12

30	002203	海亮股份	59,700	1,364,145.00	0.12
31	603688	石英股份	16,500	1,363,065.00	0.12
32	603950	长源东谷	16,100	1,359,323.00	0.12
33	600641	先导基电	33,900	1,351,254.00	0.11
34	301171	易点天下	39,440	1,339,382.40	0.11
35	301297	富乐德	21,700	1,328,908.00	0.11
36	603039	泛微网络	36,689	1,323,372.23	0.11
37	002364	中恒电气	24,100	1,296,580.00	0.11
38	301018	申菱环境	10,960	1,267,085.60	0.11
39	301377	鼎泰高科	2,300	1,267,070.00	0.11
40	301308	江波龙	1,800	1,266,840.00	0.11
41	002156	通富微电	16,600	1,259,442.00	0.11
42	002484	江海股份	11,900	1,249,500.00	0.11
43	300763	锦浪科技	13,500	1,219,725.00	0.10
44	002192	融捷股份	13,600	1,215,840.00	0.10
45	300438	鹏辉能源	14,500	1,201,325.00	0.10
46	301526	国际复材	25,700	1,199,419.00	0.10
47	300401	花园生物	54,400	1,190,816.00	0.10
48	301396	宏景科技	3,540	1,173,864.00	0.10
49	002240	盛新锂能	26,100	1,170,063.00	0.10
50	300570	太辰光	4,700	1,159,537.00	0.10
51	603124	江南新材	6,200	1,159,276.00	0.10
52	002885	京泉华	28,300	1,156,338.00	0.10
53	002851	麦格米特	6,900	1,153,542.00	0.10
54	002738	中矿资源	19,200	1,132,608.00	0.10
55	00981	中芯国际	14,500	1,125,901.37	0.10
56	002756	永兴材料	19,700	1,115,808.00	0.09
57	300442	润泽科技	13,400	1,113,138.00	0.09
58	301373	凌玮科技	7,100	1,104,050.00	0.09
59	300274	阳光电源	6,900	1,097,238.00	0.09
60	001359	平安电工	8,660	1,084,665.00	0.09
61	300548	长芯博创	3,900	1,084,200.00	0.09
62	300395	菲利华	8,000	1,069,840.00	0.09
63	300166	东方国信	60,137	1,065,026.27	0.09
64	600176	中国巨石	14,500	1,056,760.00	0.09
65	300757	罗博特科	1,700	1,052,300.00	0.09
66	000534	万泽股份	38,400	1,050,624.00	0.09
67	301486	致尚科技	5,000	1,041,600.00	0.09
68	300657	弘信电子	23,600	1,038,872.00	0.09
69	603067	振华股份	21,400	990,606.00	0.08
70	002957	科瑞技术	18,006	987,449.04	0.08
71	605060	联德股份	17,400	987,276.00	0.08
72	600673	东阳光	29,300	983,894.00	0.08
73	601869	长飞光纤	1,800	982,620.00	0.08

74	603228	景旺电子	13,500	977,535.00	0.08
75	000338	潍柴动力	35,500	967,375.00	0.08
76	600552	凯盛科技	29,600	964,368.00	0.08
77	301236	软通动力	22,700	963,615.00	0.08
78	601126	四方股份	15,200	960,640.00	0.08
79	300990	同飞股份	8,980	943,528.60	0.08
80	601636	旗滨集团	91,800	939,114.00	0.08
81	688809	强一股份	1,499	933,877.00	0.08
82	603308	应流股份	15,400	930,160.00	0.08
83	002283	天润工业	95,300	919,645.00	0.08
84	300088	长信科技	77,800	902,480.00	0.08
85	603063	禾望电气	17,000	899,130.00	0.08
86	301217	铜冠铜箔	5,400	891,378.00	0.08
87	002859	洁美科技	8,100	887,031.00	0.08
88	002595	豪迈科技	19,000	885,400.00	0.08
89	002466	天齐锂业	14,400	883,008.00	0.07
90	002080	中材科技	9,800	882,000.00	0.07
91	001339	智微智能	8,620	881,653.60	0.07
92	300400	劲拓股份	23,300	877,245.00	0.07
93	002463	沪电股份	5,700	870,960.00	0.07
94	002518	科士达	16,200	868,158.00	0.07
95	300408	三环集团	5,200	867,880.00	0.07
96	002922	伊戈尔	26,300	862,640.00	0.07
97	600563	法拉电子	4,500	858,600.00	0.07
98	300491	通合科技	22,400	855,456.00	0.07
99	688808	联讯仪器	419	852,762.27	0.07
100	600707	彩虹股份	50,300	849,567.00	0.07
101	300576	容大感光	16,470	843,593.40	0.07
102	603268	松发股份	6,000	835,680.00	0.07
103	300593	新雷能	27,500	826,650.00	0.07
104	002536	飞龙股份	17,500	825,650.00	0.07
105	301511	德福科技	5,700	819,945.00	0.07
106	003031	中瓷电子	4,500	811,350.00	0.07
107	688813	泰金新能	3,891	808,239.06	0.07
108	301397	溯联股份	24,710	799,615.60	0.07
109	301188	力诺药包	11,900	796,110.00	0.07
110	002448	中原内配	63,700	783,510.00	0.07
111	300602	飞荣达	15,300	783,360.00	0.07
112	301338	凯格精机	4,800	781,872.00	0.07
113	300976	达瑞电子	9,800	780,570.00	0.07
114	301392	汇成真空	2,700	779,328.00	0.07
115	300383	光环新网	62,500	777,500.00	0.07
116	301183	东田微	2,900	768,123.00	0.07
117	002975	博杰股份	5,400	766,800.00	0.07

118	300196	长海股份	25,800	762,906.00	0.06
119	300868	杰美特	5,200	762,892.00	0.06
120	002842	翔鹭钨业	15,800	761,560.00	0.06
121	300811	铂科新材	8,000	759,120.00	0.06
122	301200	大族数控	2,100	757,365.00	0.06
123	603002	宏昌电子	31,200	754,104.00	0.06
124	605100	华丰股份	18,640	753,428.80	0.06
125	002706	良信股份	69,000	752,790.00	0.06
126	603985	恒润股份	31,300	751,826.00	0.06
127	300693	盛弘股份	15,400	750,750.00	0.06
128	002916	深南电路	1,630	746,377.00	0.06
129	002460	赣锋锂业	11,300	739,020.00	0.06
130	600500	中化国际	93,600	732,888.00	0.06
131	300776	帝尔激光	3,400	730,864.00	0.06
132	000762	西藏矿业	27,000	720,900.00	0.06
133	600773	西藏城投	55,800	718,146.00	0.06
134	300617	安靠智电	13,500	715,365.00	0.06
135	000880	潍柴重机	31,000	713,310.00	0.06
136	002787	华源控股	22,100	711,620.00	0.06
137	001267	汇绿生态	13,200	706,200.00	0.06
138	000969	安泰科技	28,700	704,298.00	0.06
139	002741	光华科技	19,700	704,078.00	0.06
140	300819	聚杰微纤	9,500	703,190.00	0.06
141	300170	汉得信息	45,300	690,372.00	0.06
142	300816	艾可蓝	9,400	688,080.00	0.06
143	603773	沃格光电	4,100	668,177.00	0.06
144	300836	佰奥智能	9,000	665,910.00	0.06
145	300409	道氏技术	33,300	663,669.00	0.06
146	603306	华懋科技	6,400	663,616.00	0.06
147	300738	奥飞数据	32,700	661,194.00	0.06
148	300001	特锐德	17,200	650,676.00	0.06
149	603297	永新光学	4,400	646,580.00	0.05
150	300487	蓝晓科技	10,900	641,465.00	0.05
151	301086	鸿富瀚	3,060	640,396.80	0.05
152	603881	数据港	25,424	635,600.00	0.05
153	002429	兆驰股份	61,000	633,790.00	0.05
154	603031	安孚科技	11,400	607,050.00	0.05
155	002378	章源钨业	17,800	595,944.00	0.05
156	002980	华盛昌	5,100	594,354.00	0.05
157	601858	中国科传	34,300	593,733.00	0.05
158	603191	望变电气	37,000	584,230.00	0.05
159	603256	宏和科技	2,200	583,726.00	0.05
160	600577	精达股份	59,200	578,976.00	0.05
161	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05

162	301631	壹连科技	7,800	560,508.00	0.05
163	002843	泰嘉股份	25,900	556,073.00	0.05
164	300476	胜宏科技	1,600	554,288.00	0.05
165	300547	川环科技	16,500	550,935.00	0.05
166	002335	科华数据	12,850	545,482.50	0.05
167	600330	天通股份	17,500	539,700.00	0.05
168	603435	嘉德利	7,904	537,285.84	0.05
169	002782	可立克	25,400	534,670.00	0.05
170	301205	联特科技	1,600	534,560.00	0.05
171	300919	中伟新材	12,200	533,750.00	0.05
172	300620	光库科技	1,400	529,480.00	0.04
173	600710	苏美达	55,200	527,712.00	0.04
174	603855	华荣股份	30,400	526,832.00	0.04
175	301291	明阳电气	14,400	518,256.00	0.04
176	300499	高澜股份	13,300	514,710.00	0.04
177	603516	淳中科技	3,800	511,518.00	0.04
178	300394	天孚通信	1,680	508,502.40	0.04
179	600100	同方股份	74,200	508,270.00	0.04
180	300308	中际旭创	400	508,000.00	0.04
181	001314	亿道信息	8,200	506,760.00	0.04
182	002533	金杯电工	47,300	504,691.00	0.04
183	002112	三变科技	30,300	496,617.00	0.04
184	000628	高新发展	10,300	488,220.00	0.04
185	300571	平治信息	10,500	479,430.00	0.04
186	301489	思泉新材	2,880	473,990.40	0.04
187	002878	元隆雅图	40,300	465,465.00	0.04
188	603629	利通电子	2,600	464,906.00	0.04
189	002167	东方锆业	20,300	448,021.00	0.04
190	600216	浙江医药	39,200	446,880.00	0.04
191	300457	赢合科技	20,700	436,356.00	0.04
192	002400	省广集团	68,400	431,604.00	0.04
193	605168	三人行	8,400	425,376.00	0.04
194	600531	豫光金铅	27,100	399,996.00	0.03
195	600590	泰豪科技	38,500	388,850.00	0.03
196	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.03
197	002995	天地在线	21,400	378,352.00	0.03
198	601958	金钼股份	13,100	368,241.00	0.03
199	300315	掌趣科技	92,300	359,970.00	0.03
200	300959	线上线下	2,400	354,744.00	0.03
201	300748	金力永磁	10,500	323,925.00	0.03
202	300224	正海磁材	23,600	314,588.00	0.03
203	002315	焦点科技	13,350	310,788.00	0.03
204	001288	运机集团	12,900	306,891.00	0.03
205	002733	雄韬股份	9,700	300,506.00	0.03

206	000970	中科三环	19,500	296,205.00	0.03
207	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.02
208	603186	华正新材	1,200	270,360.00	0.02
209	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
210	600301	华锡有色	4,300	263,676.00	0.02
211	301313	凡拓数创	4,700	235,752.00	0.02
212	003036	泰坦股份	2,400	221,976.00	0.02
213	600869	远东股份	6,300	210,861.00	0.02
214	688820	盛合晶微	1,308	185,068.92	0.02
215	002281	光迅科技	700	179,858.00	0.02
216	300243	瑞丰高材	7,700	167,398.00	0.01
217	001399	惠科股份	5,196	144,085.08	0.01
218	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
219	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
220	300533	冰川网络	6,740	110,536.00	0.01
221	300654	世纪天鸿	10,200	99,144.00	0.01
222	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
223	300378	鼎捷数智	2,600	93,860.00	0.01
224	603598	引力传媒	5,400	92,610.00	0.01
225	600640	国脉文化	9,400	90,898.00	0.01
226	300785	值得买	2,400	88,008.00	0.01
227	600986	浙文互联	12,200	85,156.00	0.01
228	300364	中文在线	3,500	82,565.00	0.01
229	301110	青木科技	2,140	81,020.40	0.01
230	002123	梦网科技	10,900	78,371.00	0.01
231	301361	众智科技	2,400	72,072.00	0.01
232	603444	吉比特	200	71,684.00	0.01
233	000758	中色股份	10,900	71,613.00	0.01
234	300292	吴通控股	12,800	69,376.00	0.01
235	600988	赤峰黄金	2,600	68,432.00	0.01
236	600489	中金黄金	3,600	64,980.00	0.01
237	000975	山金国际	3,800	64,600.00	0.01
238	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
239	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
240	600967	内蒙一机	4,600	49,910.00	0.00
241	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
242	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
243	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
244	600549	厦门钨业	300	25,560.00	0.00
245	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
246	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
247	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
248	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
249	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00

250	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
251	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
252	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
253	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
254	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
255	601112	振石股份	715	12,576.85	0.00
256	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
257	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
258	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
259	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
260	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
261	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
262	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
263	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	688256	寒武纪	32,799,519.14	4.83
2	688041	海光信息	28,744,841.96	4.23
3	688795	摩尔线程	20,152,398.53	2.97
4	688802	沐曦股份	17,773,388.59	2.62
5	688981	中芯国际	11,027,076.60	1.62
5	00981	中芯国际	994,702.63	0.15
6	688012	中微公司	10,674,657.06	1.57
7	688008	澜起科技	8,649,172.56	1.27
8	688111	金山办公	8,129,340.94	1.20
9	688472	阿特斯	7,877,351.00	1.16
10	300750	宁德时代	6,845,045.00	1.01
11	688411	海博思创	6,520,442.83	0.96
12	688223	晶科能源	6,336,008.08	0.93
13	688521	芯原股份	6,128,621.30	0.90
14	688126	沪硅产业	5,863,023.15	0.86
15	688506	百利天恒	5,786,707.45	0.85
16	688072	拓荆科技	5,764,487.35	0.85
17	688036	传音控股	5,648,818.61	0.83
18	688498	源杰科技	5,638,569.33	0.83
19	688525	佰维存储	5,549,079.72	0.82
20	688702	盛科通信	5,483,091.81	0.81

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	688256	寒武纪	32,996,863.73	4.86
2	688041	海光信息	30,828,890.16	4.54
3	688981	中芯国际	14,664,276.26	2.16
4	688008	澜起科技	12,128,689.85	1.79
5	688012	中微公司	11,690,533.89	1.72
6	688223	晶科能源	8,151,981.35	1.20
7	688775	影石创新	7,122,662.98	1.05
8	688521	芯原股份	6,716,784.82	0.99
9	688795	摩尔线程	6,453,744.73	0.95
10	688498	源杰科技	6,420,558.62	0.95
11	688111	金山办公	6,251,456.83	0.92
12	688525	佰维存储	6,164,471.07	0.91
13	688271	联影医疗	6,061,141.68	0.89
14	688472	阿特斯	6,012,323.80	0.89
15	688802	沐曦股份	5,963,186.04	0.88
16	688072	拓荆科技	5,826,684.48	0.86
17	688599	天合光能	5,685,605.99	0.84
18	688347	华虹宏力	5,641,433.21	0.83
19	688031	星环科技	5,319,985.98	0.78
20	688375	国博电子	5,250,685.64	0.77

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	1,148,285,429.65
卖出股票收入（成交）总额	1,080,492,435.68

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）	243,006.27	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	243,006.27	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	118070	南芯转债	1,170	117,004.62	0.01
2	111025	圣泉转债	640	64,000.70	0.01
3	118071	华峰转债	620	62,000.95	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

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。若本基金投资股指期货、国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，综合考虑流动性、基差水平等因素。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,386,867.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,386,867.83

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	16,235,244.27	1.38	重大事项停牌
2	688795	摩尔线程	2,198,701.12	0.19	新股流通受限
3	688802	沐曦股份	1,714,624.70	0.15	新股流通受限

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
易方达上证科创板综合增强 A	12,724	11,485.38	38,151,853.96	26.11%	107,988,079.42	73.89%
易方达上证科创板综合增强 C	31,139	12,619.88	9,955,853.49	2.53%	383,014,616.82	97.47%
合计	43,863	12,290.78	48,107,707.45	8.92%	491,002,696.24	91.08%

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	易方达上证科创板综合增强 A	82,894.76	0.0567%
	易方达上证科创板综合增强 C	19,765.09	0.0050%
	合计	102,659.85	0.0190%

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	易方达上证科创板综合增强 A	0
	易方达上证科创板综合增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达上证科创板综合增强 A	0~10
	易方达上证科创板综合增强 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达上证科创板综合增强 A	易方达上证科创板综合增强 C
基金合同生效日（2025 年 4 月 29 日）基金份额总额	154,987,518.31	427,255,902.74
本报告期期初基金份额总额	106,039,141.58	377,648,493.97
本报告期基金总申购份额	164,820,095.18	976,421,716.72
减：本报告期基金总赎回份额	124,719,303.38	961,099,740.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	146,139,933.38	392,970,470.31

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	3	2,226,184,005.31	100.00%	213,591.83	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平安证券股份有限公司。本基金管理人与平安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 0.00959%、债券 0.00000%。

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
平安证券	700,831.30	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	证券时报、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及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
3	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	证券时报	2026-01-22
4	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
6	关于易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2026 年因港股通不提供服务暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-27
7	关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 7 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
8	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
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	证券时报	2026-03-31
10	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	证券时报	2026-04-22
11	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
12	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
13	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
14	关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-20
15	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
16	易方达基金管理有限公司关于公司旗下部分	证券时报、基金管理人网	2026-06-19

	基金估值调整情况的公告	站及中国证监会基金电 子披露网站	
17	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2026-06-23
18	关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的提示性公告	证券时报、基金管理人网 站及中国证监会基金电 子披露网站	2026-06-26

§ 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

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达上证科创板综合指数增强型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、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